

NEUBERGER BERMAN



## NEUBERGER BERMAN INVESTMENT FUNDS PLC JAHRESBERICHT 2024

GEPRÜFTER JAHRESABSCHLUSS  
FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

# Inhaltsverzeichnis

|  | SEITE |
|--|-------|
| <b>GESCHÄFTSFÜHRUNG UND VERWALTUNG</b>   | 1     |
| <b>ALLGEMEINE INFORMATIONEN</b>  | 4     |
| <b>BERICHT DER DIREKTOREN</b>  | 47    |
| <b>BERICHT DER VERWAHRSTELLE AN DIE ANTEILINHABER</b>  | 53    |
| <b>BERICHT DER UNABHÄNGIGEN WIRTSCHAFTSPRÜFER AN DIE GESELLSCHAFTER DER NEUBERGER BERMAN INVESTMENT FUNDS PLC</b>  | 54    |
| <b>BERICHT DER UNABHÄNGIGEN WIRTSCHAFTSPRÜFER AN DIE DIREKTOREN DER NEUBERGER BERMAN INVESTMENT FUNDS PLC</b>  | 57    |
| <b>BERICHT DES INVESTMENT-MANAGERS</b>   | 59    |
| <b>AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS</b>  |       |
| <b>Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund (oder „Absolute Return Multi Strategy“) – Aufstellung des Wertpapierbestands</b>   | 112   |
| <b>Neuberger Berman Asia Responsible Transition Bond Fund (oder „Asia Responsible Transition Bond“) – Aufstellung des Wertpapierbestands</b>                                       | 113   |
| <b>Neuberger Berman China A-Share Equity Fund (oder „China A-Share Equity“) – Aufstellung des Wertpapierbestands</b>   | 118   |
| <b>Neuberger Berman China Bond Fund (oder „China Bond“) – Aufstellung des Wertpapierbestands</b>   | 120   |
| <b>Neuberger Berman China Equity Fund (oder „China Equity“) – Aufstellung des Wertpapierbestands</b>   | 123   |
| <b>Neuberger Berman Climate Innovation Fund (oder „Climate Innovation“) – Aufstellung des Wertpapierbestands</b>   | 126   |
| <b>Neuberger Berman CLO Income Fund (oder „CLO Income“) – Aufstellung des Wertpapierbestands</b>   | 129   |
| <b>Neuberger Berman Commodities Fund (oder „Commodities“) – Aufstellung des Wertpapierbestands</b>   | 140   |
| <b>Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund (oder „Corporate Hybrid Bond“) – Aufstellung des Wertpapierbestands</b>   | 143   |
| <b>Neuberger Berman Developed Market FMP – 2027 Fund (oder „Developed Market FMP – 2027“) – Aufstellung des Wertpapierbestands</b>   | 148   |
| <b>Neuberger Berman EMD Corporate – Social and Environmental Transition Fund (oder „EMD Corporate – Social and Environmental Transition“) – Aufstellung des Wertpapierbestands</b> | 151   |
| <b>Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund (oder „Emerging Market Debt - Hard Currency“) – Aufstellung des Wertpapierbestands</b>                               | 162   |
| <b>Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund (oder „Emerging Market Debt - Local Currency“) – Aufstellung des Wertpapierbestands</b>                             | 173   |
| <b>Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund (oder „Emerging Market Debt Blend“) – Aufstellung des Wertpapierbestands</b>   | 189   |

## Inhaltsverzeichnis (Fortsetzung)

|   | SEITE |
|---|-------|
| Neuberger Berman Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Fund (oder „Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 217   |
| Neuberger Berman Emerging Markets Equity Fund (oder „Emerging Markets Equity“) – Aufstellung des Wertpapierbestands   | 230   |
| Neuberger Berman Euro Bond Fund (oder „Euro Bond“) – Aufstellung des Wertpapierbestands   | 236   |
| Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund (oder „Euro Bond Absolute Return“) – Aufstellung des Wertpapierbestands   | 243   |
| Neuberger Berman European High Yield Bond Fund (oder „European High Yield Bond“) – Aufstellung des Wertpapierbestands   | 253   |
| Neuberger Berman European Sustainable Equity Fund (oder „European Sustainable Equity“) – Aufstellung des Wertpapierbestands   | 262   |
| Neuberger Berman Event Driven Fund (oder „Event Driven“) – Aufstellung des Wertpapierbestands   | 264   |
| Neuberger Berman Global Bond Fund (oder „Global Bond“) – Aufstellung des Wertpapierbestands   | 268   |
| Neuberger Berman Global Equity Megatrends Fund (oder „Global Equity Megatrends“) – Aufstellung des Wertpapierbestands   | 290   |
| Neuberger Berman Global Flexible Credit Income Fund (oder „Global Flexible Credit Income“) – Aufstellung des Wertpapierbestands   | 292   |
| Neuberger Berman Global High Yield Engagement Fund (oder „Global High Yield Engagement“) – Aufstellung des Wertpapierbestands   | 311   |
| Neuberger Berman Global Investment Grade Credit Fund (oder „Global Investment Grade Credit“) – Aufstellung des Wertpapierbestands   | 334   |
| Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund (oder „Global Opportunistic Bond“) – Aufstellung des Wertpapierbestands   | 344   |
| Neuberger Berman Global Real Estate Securities Fund (oder „Global Real Estate Securities“) – Aufstellung des Wertpapierbestands   | 367   |
| Neuberger Berman Global Sustainable Equity Fund (oder „Global Sustainable Equity“) – Aufstellung des Wertpapierbestands   | 368   |
| Neuberger Berman Global Value Fund (oder „Global Value“) – Aufstellung des Wertpapierbestands   | 370   |
| Neuberger Berman High Yield Bond Fund (oder „High Yield Bond“) – Aufstellung des Wertpapierbestands   | 379   |
| Neuberger Berman InnovAsia Fund (oder „InnovAsia“) – Aufstellung des Wertpapierbestands   | 398   |
| Neuberger Berman Japan Equity Engagement Fund (oder „Japan Equity Engagement“) – Aufstellung des Wertpapierbestands   | 402   |
| Neuberger Berman Next Generation Connectivity Fund (oder „Next Generation Connectivity“) – Aufstellung des Wertpapierbestands   | 406   |
| Neuberger Berman Next Generation Mobility Fund (oder „Next Generation Mobility“) – Aufstellung des Wertpapierbestands   | 412   |
| Neuberger Berman Next Generation Space Economy Fund (oder „Next Generation Space Economy“) – Aufstellung des Wertpapierbestands   | 415   |

## Inhaltsverzeichnis (Fortsetzung)

|   | SEITE |
|---|-------|
| Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund (oder „Short Duration Emerging Market Debt“) – Aufstellung des Wertpapierbestands                           | 417   |
| Neuberger Berman Short Duration Euro Bond Fund (oder „Short Duration Euro Bond“) – Aufstellung des Wertpapierbestands   | 428   |
| Neuberger Berman Short Duration High Yield Engagement Fund (oder „Short Duration High Yield Engagement“) – Aufstellung des Wertpapierbestands                         | 441   |
| Neuberger Berman Strategic Income Fund (oder „Strategic Income“) – Aufstellung des Wertpapierbestands   | 452   |
| Neuberger Berman Sustainable Asia High Yield Fund (oder „Sustainable Asia High Yield“) – Aufstellung des Wertpapierbestands   | 505   |
| Neuberger Berman Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency Fund (oder „Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency“) – Aufstellung des Wertpapierbestands | 508   |
| Neuberger Berman Tactical Macro Fund (oder „Tactical Macro“) – Aufstellung des Wertpapierbestands   | 515   |
| Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (oder „Uncorrelated Strategies“) – Aufstellung des Wertpapierbestands   | 518   |
| Neuberger Berman US Equity Fund (oder „US Equity“) – Aufstellung des Wertpapierbestands   | 623   |
| Neuberger Berman US Equity Premium Fund (oder „US Equity Premium“) – Aufstellung des Wertpapierbestands   | 626   |
| Neuberger Berman US Large Cap Value Fund (oder „US Large Cap Value“) – Aufstellung des Wertpapierbestands   | 629   |
| Neuberger Berman US Long Short Equity Fund (oder „US Long Short Equity“) – Aufstellung des Wertpapierbestands   | 633   |
| Neuberger Berman US Multi Cap Opportunities Fund (oder „US Multi Cap Opportunities“) – Aufstellung des Wertpapierbestands   | 641   |
| Neuberger Berman US Real Estate Securities Fund (oder „US Real Estate Securities“) – Aufstellung des Wertpapierbestands   | 645   |
| Neuberger Berman US Small Cap Fund (oder „US Small Cap“) – Aufstellung des Wertpapierbestands   | 648   |
| Neuberger Berman US Small Cap Intrinsic Value Fund (oder „US Small Cap Intrinsic Value“) – Aufstellung des Wertpapierbestands   | 653   |
| <b>BILANZEN</b>   | 657   |
| <b>GEWINN- UND VERLUSTRECHNUNG</b>  | 672   |
| <b>AUFSTELLUNG ÜBER DIE ENTWICKLUNG DES AUF INHABER RÜCKZAHLBARER, GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDEN NETTOVERMÖGENS</b>   | 687   |
| <b>AUFSTELLUNGEN DER WESENTLICHEN KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT)</b>  | 695   |

# Inhaltsverzeichnis (Fortsetzung)

SEITE

## **ANMERKUNGEN ZUM GEPRÜFTEN JAHRESABSCHLUSS**

|  |      |
|--|------|
| Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze  | 799  |
| Finanzvermögen und -verbindlichkeiten erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet   | 808  |
| Barmittel und Barmitteläquivalente   | 837  |
| Kontenüberziehung  | 857  |
| Anteilkapital  | 857  |
| Gebühren des Managers, der Verwaltungsstelle, der Vertriebsstelle und der Verwahrstelle  | 979  |
| Honorare und Aufwendungen der Direktoren   | 1000 |
| Vergütung der Abschlussprüfer  | 1000 |
| Sonstige Gebühren und Kosten   | 1000 |
| Transaktionen verbundener Parteien   | 1001 |
| Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten | 1025 |
| Angaben zu Finanzinstrumenten  | 1053 |
| Vergleichszahlen für den Nettoinventarwert   | 1210 |
| Wechselkurse   | 1322 |
| Berichtigung der Währungsumrechnung  | 1323 |
| Vereinbarungen über Verrechnungsprovisionen (Soft Commissions)   | 1324 |
| Getrennte Haftung  | 1324 |
| Effizientes Portfoliomanagement  | 1324 |
| Kreditfazilität  | 1325 |
| Ungedechte Kreditzusagen   | 1325 |
| Wesentliche Ereignisse während des Geschäftsjahres   | 1325 |
| Wesentliche Ereignisse seit dem Ende des Geschäftsjahres   | 1326 |
| Genehmigung des Abschlusses  | 1327 |
| Finanzkennzahlen   | 1328 |
| Derivative Kontrakte   | 1489 |
| Saldierung von Finanzinstrumenten  | 1509 |
| Geschlossene Fonds   | 1602 |

|  |      |
|--|------|
| <b>ANHANG I – GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT)</b> | 1603 |
|--|------|

|  |      |
|--|------|
| <b>ANHANG II – PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT)</b> | 1632 |
|--|------|

|   |      |
|---|------|
| <b>ANHANG III – INFORMATIONEN ÜBER DAS GESAMTRISIKO (UNGEPRÜFT)</b> | 1659 |
|---|------|

|  |      |
|--|------|
| <b>ANHANG II – VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (UNGEPRÜFT)</b> | 1661 |
|--|------|

|   |      |
|---|------|
| <b>ANHANG V – ANGABEN ZUR VERGÜTUNG (UNGEPRÜFT)</b> | 1688 |
|---|------|

|  |      |
|--|------|
| <b>ANHANG VI – GLOSSAR DER INDIZES (UNGEPRÜFT)</b> | 1689 |
|--|------|

|   |      |
|---|------|
| <b>ANHANG VII – INVESTMENT-MANAGER, SUB-INVESTMENT-MANAGER UND UNTERBERATER (UNGEPRÜFT)</b> | 1693 |
|---|------|

|   |      |
|---|------|
| <b>ANHANG VIII – OFFENLEGUNGSVERORDNUNG (UNGEPRÜFT)</b> | 1667 |
|---|------|

## Geschäftsführung und Verwaltung

Die folgenden Informationen wurden aus dem Verkaufsprospekt übernommen und sollten in Verbindung mit dem vollständigen Text des Verkaufsprospekts und den dort aufgeführten Definitionen gelesen werden.

### Direktoren:

Gráinne Alexander (Irin)\*\*

Michelle Green (Britin)\*

Naomi Daly (Irin)\*\*\*

Andy Olding (Brite)\* (bis zum 26. November 2024)

Mary Brady (Irin)\* (ernannt zum 3. Februar 2025)

\*Nicht geschäftsführender Direktor

\*\*Unabhängiger, nicht geschäftsführender Direktor

\*\*\*Unabhängiger, nicht geschäftsführender Direktor und Vorsitzender

### Rechtsberater für irisches Recht:

Matheson LLP (aufgelöst am 16. Dezember 2024)

70 Sir John Rogerson's Quay

Dublin 2

Irland

Maples and Calder (Ireland) LLP (seit dem 17. Dezember 2024)

75 St. Stephen's Green

Dublin 2

Irland

D02 PR50

### Verwahrstelle:

Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited

30 Herbert Street

Dublin 2

Irland

### Manager:

Neuberger Berman Asset Management Ireland Limited

2 Central Plaza

Dame Street

Dublin 2

Irland

### Vertriebsstellen und Sub-Investment-Manager:

Neuberger Berman Asia Limited

20<sup>th</sup> Floor

Jardine House

1 Connaught Place

Central Hong Kong

Neuberger Berman Singapore Pte. Limited

Stufe 15

Ocean Financial Centre

10 Collyer Quay

Singapur 049315

### Vertriebsstellen und Sub-Investment-Manager (Fortsetzung):

Neuberger Berman Europe Limited

The Zig Zag Building

70 Victoria Street

London SW1E 6SQ

England

### Vertriebsstelle:

Neuberger Berman BD LLC

1290 Avenue of the Americas

New York, NY 10104-0002

USA

Neuberger Berman Canada ULC

181 Bay Street Suite 815

Toronto, ON M5J 2V1

Kanada

### Nicht verbundener Unterberater:

Neuberger Berman Fund Management

(China) Limited

Unit 11, 30F

No.88 Central Avenue

China (Shanghai) Pilot Free Trade Zone, 200120

Volksrepublik China

Neuberger Berman Information Consulting

(Shanghai) Limited (ehemals Neuberger Berman

Investment Management (Shanghai) Limited)

20/F, HKRI Centre Two, 288 Shimen Yi Road

Jing'an District, Shanghai 200041

Volksrepublik China

### Verwaltungsstelle:

Brown Brothers Harriman Fund

Administration Services (Ireland) Limited

30 Herbert Street

Dublin 2

Irland

### Unabhängige Wirtschaftsprüfer:

Ernst & Young

Chartered Accountants

Harcourt Centre

Harcourt Street

Dublin 2

Irland

## Geschäftsführung und Verwaltung (Fortsetzung)

### Vertreter in der Schweiz:\*\*\*\*

BNP Paribas Securities Services S.A. Paris  
Succursale de Zürich  
Selnaustrasse 16  
P.O. Box 2119 CH-8002  
Zürich  
Schweiz

\*\*\*\*Der Verkaufsprospekt, die Satzung, die Wesentlichen Anlegerinformationen, der Jahres- und Halbjahresbericht sowie ein Verzeichnis aller Käufe und Verkäufe, die innerhalb des Berichtszeitraums erfolgten, sind kostenlos beim Vertreter in der Schweiz erhältlich.

### Secretary des Fonds und eingetragener Geschäftssitz:

Matsack Trust Limited ((aufgelöst am 31. Dezember 2024)  
70 Sir John Rogerson's Quay  
Dublin 2  
Irland

MFD Secretaries Limited (seit dem 1. Januar 2025)  
32 Molesworth Street  
Dublin 2  
Irland  
D02 Y512  
32 Molesworth Street  
Dublin 2  
Irland

### Sub-Investment-Manager:

Neuberger Berman Investment Advisers LLC  
1290 Avenue of the Americas  
New York, NY 10104-0002  
USA

Neuberger Berman Canada ULC  
181 Bay Street Suite 815  
Toronto, ON M5J 2V1  
Kanada

Neuberger Berman Alternatives Advisers LLC  
325 N Saint Paul Street, Suite 4900  
Dallas, TX 75201  
USA

Neuberger Berman East Asia Limited  
5-1 Manunouchi 1-Chrome  
Chiyoda-ku  
Tokio  
Japan

Green Court Capital Management Limited  
20<sup>th</sup> Floor  
Jardine House  
1 Connaught Place  
Central Hong Kong

### Hauptvertreter und Vertriebsstelle in Taiwan:

Neuberger Berman Taiwan (SITE) Limited  
20F., Not. 68, See 5, Zhongxiao E. Road  
XinYi District  
Taipei City 110  
Taiwan  
Republik China

### Nicht verbundene Unterberater:

Portman Square Capital  
4<sup>th</sup> Floor Reading Bridge House  
George Street  
Reading, Berkshire  
RG1 8LS  
Großbritannien

AllianceBernstein LP  
1345 Avenue of the Americas  
New York, NY 10105  
USA

Soloda Investment Advisors LLP  
(aufgelöst am 1. August 2024)  
3<sup>rd</sup> Floor Strand Bridge House  
138-142 Strand London WC2R 1HH  
Großbritannien

Altiq LLP  
29 Farm Street  
London W1J 5RL  
Großbritannien

BH-DG Systematic Trading LLP  
20 North Audley Street  
London W1K 6LX  
Großbritannien

True Partner Capital USA Holding Inc  
111 West Jackson Boulevard, Suite 1700  
Chicago, IL 60604  
USA

P/E Global LLC  
75 State Street, 31st Floor  
Boston, MA 02109  
USA

Cipher Capital LP  
(aufgelöst am 1. August 2024)  
400 Madison Ave, Suite 12-A  
New York, NY 10017  
USA

## Geschäftsführung und Verwaltung (Fortsetzung)

**Nicht verbundene Unterberater (Fortsetzung):**

G10 Capital Limited

4<sup>th</sup> Floor

3 More London Riverside

London SE21 2AQ

Großbritannien

Crabel Capital Management, LLC

10250 Constellation Blvd., Suite 2650

Los Angeles, CA 90067

USA

## Allgemeine Informationen

Die folgenden Informationen wurden aus dem Verkaufsprospekt übernommen und sollten in Verbindung mit dem vollständigen Text des Verkaufsprospekts und den dort aufgeführten Definitionen gelesen werden.

Neuberger Berman Investment Funds plc (der „Fonds“) ist ein Investmentfonds mit variablem Kapital, der am 11. Dezember 2000 in Irland gemäß des Companies Act von 2014 (in seiner geltenden Fassung) unter der Registernummer 336425 als Aktiengesellschaft gegründet wurde. Der Fonds wurde von der Central Bank of Ireland (die „Zentralbank“) als ein Organismus für Gemeinsame Anlagen in Wertpapieren gemäß den Bestimmungen EG-Richtlinie über Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (European Communities (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) von 2011 (in der jeweils gültigen Fassung) (die „OGAW-Vorschriften“) genehmigt. Der Fonds besitzt die Struktur eines Umbrella-Fonds, bei dem das Anteilkapital in verschiedene Anteilserien unterteilt ist und jede Anteilserie ein separates Anlageportfolio bildet (jeweils ein „Portfolio“). Die Anteile eines Portfolios können in verschiedene Klassen unterteilt werden, um die Möglichkeit unterschiedlicher Zeichnungs- und/oder Rücknahmegebühren und/oder Dividenden und/oder Kosten und/oder Gebührenvereinbarungen und/oder Währungen, einschließlich unterschiedlicher Gesamtkostenquoten (TER), zu schaffen. Wie im Abschnitt „Geschäftsführung und Verwaltung“ des Prospekts beschrieben, haben die Direktoren Neuberger Berman Asset Management Ireland Limited („NBAMIL“) am 1. Juli 2021 zum Manager bestellt, um die laufenden Geschäfte des Fonds in Übereinstimmung mit den Anforderungen der Zentralbank zu führen.

Am 31. Dezember 2024 umfasste der Fonds 50 separate Anlageportfolios („Portfolios“), die jeweils mehrere Serien rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile repräsentierten. Diese werden in der nachstehenden Tabelle angegeben:

| Portfolio  | Auflegungsdatum*  | SFDR-Kategorie** |
|--|-------------------|------------------|
| Asia Responsible Transition Bond <sup>1</sup>                        | 29. Juni 2015     | Artikel 8        |
| China A-Share Equity <sup>2</sup>                                    | 28. Juli 2020     | Artikel 8        |
| China Bond <sup>1</sup>  | 28. August 2015   | Artikel 8        |
| China Equity <sup>1</sup>  | 14. Juli 2009     | Artikel 6        |
| Climate Innovation <sup>2</sup>                                      | 1. August 2023    | Artikel 8        |
| CLO Income <sup>2</sup>  | 12. Juli 2018     | Artikel 8        |
| Commodities <sup>2</sup>   | 9. Februar 2022   | Artikel 6        |
| Corporate Hybrid Bond <sup>2</sup>                                   | 19. November 2015 | Artikel 8        |
| Developed Market FMP – 2027 <sup>2</sup>                             | 31. Juli 2023     | Artikel 8        |
| EMD Corporate – Social and Environmental Transition <sup>1</sup>     | 14. Juni 2013     | Artikel 8        |
| Emerging Market Debt – Hard Currency <sup>1</sup>                    | 31. Mai 2013      | Artikel 8        |
| Emerging Market Debt – Local Currency <sup>1</sup>                   | 28. Juni 2013     | Artikel 8        |
| Emerging Market Debt Blend <sup>1</sup>                              | 23. April 2014    | Artikel 8        |
| Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend <sup>2</sup> | 10. Juli 2017     | Artikel 8        |
| Emerging Markets Equity <sup>1</sup>                                 | 4. Oktober 2010   | Artikel 8        |
| Euro Bond <sup>2</sup>   | 14. November 2018 | Artikel 8        |
| Euro Bond Absolute Return <sup>2</sup>                               | 29. November 2018 | Artikel 8        |
| European High Yield Bond <sup>1</sup>                                | 27. Juni 2014     | Artikel 8        |
| European Sustainable Equity <sup>1</sup>                             | 24. Februar 2021  | Artikel 8        |
| Event Driven <sup>2</sup>  | 26. Oktober 2022  | Artikel 6        |
| Global Bond <sup>1</sup>   | 16. Juli 2012     | Artikel 8        |
| Global Equity Megatrends <sup>1</sup>                                | 27. April 2018    | Artikel 8        |
| Global Flexible Credit Income <sup>1</sup>                           | 1. Juni 2020      | Artikel 8        |
| Global High Yield Engagement <sup>2</sup>                            | 4. August 2016    | Artikel 8        |
| Global Investment Grade Credit <sup>1</sup>                          | 1. September 2021 | Artikel 8        |
| Global Opportunistic Bond <sup>2</sup>                               | 20. Dezember 2016 | Artikel 8        |
| Global Sustainable Equity <sup>1</sup>                               | 24. Februar 2021  | Artikel 8        |
| Global Value <sup>2</sup>  | 18. Dezember 2014 | Artikel 8        |

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

| Portfolio   | Auflegungsdatum*  | SFDR-Kategorie** |
|---|-------------------|------------------|
| High Yield Bond <sup>1</sup>                                  | 3. Mai 2006       | Artikel 8        |
| InnovAsia <sup>2</sup>  | 14. Juli 2021     | Artikel 8        |
| Japan Equity Engagement <sup>1</sup>                          | 12. Mai 2020      | Artikel 8        |
| Next Generation Connectivity <sup>1</sup>                     | 8. April 2020     | Artikel 8        |
| Next Generation Mobility <sup>1</sup>                         | 21. August 2018   | Artikel 8        |
| Next Generation Space Economy <sup>1</sup>                    | 10. Mai 2022      | Artikel 8        |
| Short Duration Emerging Market Debt <sup>1</sup>              | 31. Oktober 2013  | Artikel 8        |
| Short Duration Euro Bond <sup>2</sup>                         | 31. Oktober 2018  | Artikel 8        |
| Short Duration High Yield Engagement <sup>1</sup>             | 20. Dezember 2011 | Artikel 8        |
| Strategic Income <sup>1</sup>                                 | 26. April 2013    | Artikel 8        |
| Sustainable Asia High Yield <sup>1</sup>                      | 13. Dezember 2021 | Artikel 8        |
| Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency <sup>2</sup> | 19. Januar 2022   | Artikel 9        |
| Tactical Macro <sup>2</sup>                                   | 30. Juni 2023     | Artikel 6        |
| Uncorrelated Strategies <sup>2</sup>                          | 22. Mai 2017      | Artikel 6        |
| US Equity <sup>2</sup>  | 18. Dezember 2015 | Artikel 8        |
| US Equity Premium <sup>2</sup>                                | 30. Dezember 2016 | Artikel 6        |
| US Large Cap Value <sup>1</sup>                               | 20. Dezember 2021 | Artikel 8        |
| US Long Short Equity <sup>2</sup>                             | 28. Februar 2014  | Artikel 8        |
| US Multi Cap Opportunities <sup>1</sup>                       | 13. Juni 2006     | Artikel 8        |
| US Real Estate Securities <sup>1</sup>                        | 1. Februar 2006   | Artikel 8        |
| US Small Cap <sup>1</sup>                                     | 1. Juli 2011      | Artikel 8        |
| US Small Cap Intrinsic Value <sup>2</sup>                     | 30. April 2015    | Artikel 8        |

\*Erster Tag des Geschäftsbetriebs.

\*\*Nähere Angaben zur Sustainable Finance Disclosure Regulation entnehmen Sie bitte Anhang VIII.

<sup>1</sup> Das Portfolio ist von der Hong Kong Securities and Futures Commission (die „SFC“) autorisiert und kann somit für die Öffentlichkeit in Hongkong angeboten werden.

<sup>2</sup> Das Portfolio ist von der Securities and Futures Commission (SFC) nicht zugelassen und für Anleger in Hongkong nicht verfügbar

Für den Fonds besteht eine getrennte Haftung zwischen seinen Portfolios. Dementsprechend sind sämtliche Verbindlichkeiten, die im Namen eines Portfolios eingegangen werden bzw. einem Portfolios zuzurechnen sind, ausschließlich aus dem Vermögen des betreffenden Portfolios zu begleichen.

Der Neuberger Berman Macro Opportunities FX Fund (oder „Macro Opportunities FX“), der Neuberger Berman Global Diversified Income FMP – 2024 (oder „Global Diversified Income FMP – 2024“) und der Neuberger Berman Global Real Estate Securities Fund (oder „Global Real Estate Securities“) wurden am 8. Februar 2024, 28. Juni 2024 bzw. 31. Dezember 2024 aufgelöst und stehen daher nicht mehr zur Zeichnung zur Verfügung. Der Neuberger Berman Uncorrelated Trading Fund, der Neuberger Berman Global High Yield Sustainable Action Fund, der Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund, der Neuberger Berman Emerging Markets Select Equity Fund und der Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund wurden in den vorangegangenen Berichtsjahren aufgelöst und stehen daher nicht mehr zur Zeichnung zur Verfügung. Der Neuberger Berman Diversified Currency Fund, der Neuberger Berman Multi-Style Premia Fund und der Neuberger Berman Global Equity Index PutWrite Fund wurden in den vorangegangenen Berichtsjahren aufgelöst und ihre Zulassung wurde von der Zentralbank am 9. August 2024 widerrufen.

Die vollständige Liste der Manager, Sub-Investment-Manager und Unterberater für jedes Portfolio finden Sie in Anhang VII.

Nähere Angaben zur Sustainable Finance Disclosure Regulation entnehmen Sie bitte Anhang VIII.

Anlageziele und eine Liste der aktiven Anteilklassen der Portfolios, die zum 31. Dezember 2024 zur Anlage verfügbar waren, sind im folgenden beschrieben:

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### Asia Responsible Transition Bond

Das Anlageziel des Asia Responsible Transition Bond (ehemals: „Asian Debt – Hard Currency“) (das „Portfolio“) ist es, eine möglichst hohe risikobereinigte Gesamtrendite (Erträge zuzüglich Kapitalzuwachs) aus auf Hartwährungen lautenden, in Asien emittierten Schuldtiteln zu erzielen.

Um sein Ziel zu erreichen, investiert das Portfolio vorwiegend in Schuldtitel und Geldmarktinstrumente, die von Regierungen, staatlichen Stellen oder Unternehmen, die ihren Hauptsitz in Ländern Asiens haben oder dort einen überwiegenden Teil ihrer Geschäftstätigkeit ausüben, emittiert werden und die auf Hartwährungen lauten. Als Hartwährungen im Sinne des Portfolios werden folgende Währungen definiert: US-Dollar, Euro, britisches Pfund, japanischer Yen und Schweizer Franken. Anleger sollten beachten, dass öffentliche Emittenten auch Unternehmen sein können, die direkt oder indirekt zu 100 % in staatlicher Hand sind.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Jahresende (im Folgenden „Geschäftsjahresende“ oder „das beendete Geschäftsjahr“) aufgeführt:

| Name der Anteilklasse                               | Auflegungsdatum der Anteilklasse | Währung |
|---|----------------------------------|---------|
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) <sup>1</sup> | 30. Juni 2015                    | USD     |
| Thesaurierende Klasse USD A <sup>1</sup>            | 30. Juni 2015                    | USD     |
| Thesaurierende Klasse USD C1                        | 15. Oktober 2019                 | USD     |
| Thesaurierende Klasse USD I                         | 30. Juni 2015                    | USD     |
| Ausschüttende Klasse USD I                          | 30. Juni 2015                    | USD     |
| Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich)             | 23. September 2022               | USD     |
| Thesaurierende Klasse USD I4                        | 23. September 2022               | USD     |
| Thesaurierende Klasse USD M                         | 14. August 2019                  | USD     |
| Ausschüttende Klasse USD X (Monatlich)              | 23. September 2022               | USD     |
| Thesaurierende Klasse USD X                         | 8. Juni 2021                     | USD     |
| Thesaurierende Klasse USD Z                         | 12. Dezember 2022                | USD     |

<sup>1</sup>Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

### China A-Share Equity

Das Anlageziel des China A-Share Equity (das „Portfolio“) ist die Erwirtschaftung von langfristigem Kapitalzuwachs, überwiegend durch die Anlage in ein Portfolio aus chinesischen A-Aktien, die ein Engagement an der wirtschaftlichen Entwicklung der Volksrepublik China (die „VRC“) bieten.

Das Portfolio ist bestrebt, sein Anlageziel zu erreichen, indem es über die Stock Connects und über die RQFII-Quota direkt in chinesische A-Aktien und indirekt, hauptsächlich durch Anlagen in eigenkapitalbezogene Wertpapiere, die von internationalen Investmentbanken begeben werden, sowie ebenfalls durch Aktien- und Schuldtitel, die von Unternehmen ausgegeben werden können, die von verbundenen Unternehmen des Sub-Investment-Managers verwaltet werden, investiert.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| Name der Anteilklasse                                 | Auflegungsdatum der Anteilklasse | Währung |
|---|----------------------------------|---------|
| Thesaurierende Klasse CNY I                           | 28. Juli 2020                    | CNY     |
| Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) | 28. Juli 2020                    | USD     |
| Ausschüttende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)  | 28. Juli 2020                    | USD     |

### China Bond

Das Anlageziel des China Bond (das „Portfolio“) ist es, eine attraktive, risikobereinigte Gesamtrendite (Erträge zuzüglich Kapitalzuwachs) zu erzielen, indem er in festverzinsliche Instrumente aus China in lokaler Währung investiert.

Um sein Ziel zu erreichen, investiert das Portfolio vorwiegend in Schuldtitel und Geldmarktinstrumente, die innerhalb der VRC durch die Regierung der VRC, staatliche Stellen der VRC oder Unternehmen, die ihren Hauptsitz in der VRC haben oder einen überwiegenden Teil ihrer Geschäftstätigkeit in der VRC ausüben, emittiert werden und die auf die Währung der PRC lauten oder über die RQFII-Quota (Renminbi Qualified Foreign Institutional Investor) in der Währung der VRC engagiert sind. Anleger des Portfolios sollten beachten, dass öffentliche Emittenten auch Unternehmen sein können, die direkt oder indirekt zu 100 % in staatlicher Hand sind.

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### China Bond (Fortsetzung)

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| Name der Anteilklasse  | Auflegungsdatum der Anteilklasse | Währung |
|--|----------------------------------|---------|
| Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) <sup>1</sup>              | 4. November 2020                 | CNY     |
| Ausschüttende Klasse CNY I <sup>1</sup>                          | 8. Juni 2018                     | CNY     |
| Thesaurierende Klasse CNY Z                                      | 8. September 2015                | CNY     |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) (nicht währungsgesichert) | 12. März 2019                    | SGD     |
| Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)            | 8. September 2015                | USD     |
| Thesaurierende Klasse USD Z                                      | 29. März 2019                    | USD     |
| Thesaurierende Klasse USD Z (nicht währungsgesichert)            | 10. April 2018                   | USD     |

<sup>1</sup>Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

### China Equity

Das Anlageziel des China Equity (das „Portfolio“) ist die Erzielung einer möglichst hohen Gesamtrendite (Erträge zuzüglich Wertzuwachs) am Aktienmarkt Großchinas. Um dieses Ziel zu erreichen, investiert das Portfolio überwiegend in Dividendenpapiere und equity-linked (eigenkapitalbezogene) Wertpapiere, die an anerkannten Märkten notiert sind oder gehandelt werden und von Unternehmen ausgegeben werden, die:

- nach den Gesetzen der Volksrepublik China („VRC“), der Sonderverwaltungszone („SAR“) Hongkong, der Sonderverwaltungszone („SAR“) Macau oder Taiwans (der „Großraum China“) gegründet wurden oder nach diesen Gesetzen organisiert sind oder dort ihren Hauptsitz haben;
- einen Großteil ihres Gesamtumsatzes oder -gewinns grundsätzlich aus (a) Waren, die im Großraum China hergestellt oder verkauft werden, (b) Investments, die im Großraum China getätigt werden, oder (c) Dienstleistungen, die im Großraum China erbracht werden, generieren, oder
- grundsätzlich die Mehrheit ihres Vermögens im Großraum China halten (jeweils ein „großchinesisches Unternehmen“).

Das Portfolio kann auch in hybride Wertpapiere und equity-linked (eigenkapitalbezogene) Wertpapiere, wie z. B. Wandelschuldverschreibungen, wandelbare Vorzugsaktien, Optionsanleihen, einschließlich derivativer Finanzinstrumente (FDI), investieren, die von großchinesischen Unternehmen ausgegeben werden oder eine Beteiligung an der Performance großchinesischer Unternehmen ermöglichen.

Zur Klarstellung wird festgehalten, dass das Portfolio in Wertpapiere wie hier beschrieben investieren kann, die von großchinesischen Unternehmen, welche an anerkannten Märkten außerhalb des Großraums China notiert sind oder gehandelt werden, unter anderem auch in den USA, Großbritannien, Singapur und Japan, ausgegeben werden oder ein Engagement in solchen Unternehmen ermöglichen.

Das Portfolio investiert in erster Linie in Unternehmen mit mittlerer und hoher Marktkapitalisierung.

Green Court Capital Management Limited, der Sub-Investment-Manager, wendet einen research-intensiven, fundamentalen Bottom-up-Ansatz an. Durch laufende Beurteilung der makroökonomischen Faktoren und Marktfaktoren wird die Einzeltitelauswahl verbessert. Der Anlageansatz ist diskretionär und berücksichtigt verschiedene Faktoren und Anlagestrategien über verschiedene Zeithorizonte.

Das Portfolio ist in erster Linie so aufgebaut, dass es über- und untergewichtete Positionen in der Markt-Benchmark MSCI China Index einght. Die Entscheidungen, ob die Positionen des Portfolios gegenüber der Benchmark unter- oder übergewichtet werden, werden in erster Linie auf Basis der Bewertung, der Bewertungsqualität und makroökonomischer Faktoren, einschließlich Variablen wie Wachstumschancen, Wettbewerbsvorteile und Risikomerkmale, über kurz-, mittel- und langfristige Anlagehorizonte getroffen, aber wo relevant, haben die Anforderungen der Zentralbank in Bezug auf Konzentrationsbeschränkungen, wie im Abschnitt „Anlagebeschränkungen“ im Verkaufsprospekt beschrieben, Vorrang vor diesen Faktoren.

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### China Equity (Fortsetzung)

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| Name der Anteilklasse                    | Auflegungsdatum der Anteilklasse | Währung |
|--|----------------------------------|---------|
| Thesaurierende Klasse CHF I              | 31. Juli 2015                    | CHF     |
| Thesaurierende Klasse EUR A <sup>1</sup> | 14. Juli 2009                    | EUR     |
| Thesaurierende Klasse EUR I              | 14. Juli 2009                    | EUR     |
| Thesaurierende Klasse EUR Z              | 3. Juni 2014                     | EUR     |
| Thesaurierende Klasse SGD A <sup>1</sup> | 1. Dezember 2014                 | SGD     |
| Thesaurierende Klasse USD A <sup>1</sup> | 14. Juli 2009                    | USD     |
| Ausschüttende Klasse USD A <sup>1</sup>  | 27. August 2014                  | USD     |
| Thesaurierende Klasse USD I              | 14. Juli 2009                    | USD     |
| Thesaurierende Klasse USD I2             | 11. August 2014                  | USD     |
| Thesaurierende Klasse USD M              | 27. Mai 2016                     | USD     |
| Thesaurierende Klasse USD U              | 27. Juni 2014                    | USD     |
| Thesaurierende Klasse USD Z              | 1. August 2014                   | USD     |

<sup>1</sup>Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

### Climate Innovation

Das Anlageziel des Climate Innovation (das „Portfolio“) ist es, einen langfristigen Kapitalzuwachs zu erzielen, indem er hauptsächlich in ein Portfolio aus globalen Beteiligungspapieren investiert. Der Schwerpunkt liegt dabei auf Unternehmen, die an Technologien und/oder Aktivitäten im Zusammenhang mit Klimainnovation beteiligt sind oder daraus Nutzen ziehen.

Das Portfolio ist bestrebt, sein Anlageziel zu erreichen, indem es vorrangig in Aktienwerte investiert, die weltweit an anerkannten Märkten (zu denen auch Schwellenländer gehören können) notiert sind oder gehandelt werden und von Unternehmen mit beliebiger Marktkapitalisierungen aus allen Wirtschaftssektoren begeben werden. Das Portfolio kann in Unternehmen mit beliebiger Marktkapitalisierung investieren.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| Name der Anteilklasse        | Auflegungsdatum der Anteilklasse | Währung |
|------------------------------|----------------------------------|---------|
| Thesaurierende Klasse USD A  | 1. August 2023                   | USD     |
| Thesaurierende Klasse USD I  | 1. August 2023                   | USD     |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 1. August 2023                   | USD     |
| Thesaurierende Klasse USD Z  | 1. August 2023                   | USD     |

### CLO Income

Das Anlageziel des CLO Income (das „Portfolio“) ist es, eine attraktive Gesamtrendite (eine Kombination aus Kapitalzuwachs und laufenden Erträgen) zu erzielen, indem er hauptsächlich in Mezzanine-Schuldtitel in USD und EUR investiert, die auf variabel verzinsliche, besicherte Schuldtitel („CLO“) mit variablem Zinssatz lauten, sowie ebenfalls in US-amerikanische Hochzinsanleihen, die an anerkannten Märkten notiert sind oder gehandelt werden.

Das Portfolio strebt danach, sein Ziel durch einen disziplinierten Anlageprozess zu erreichen, der darauf abzielt, CLO-Mezzanine-Schuldtitel zu identifizieren, die durch ein zugrunde liegendes Portfolio von Krediten mit einem höheren Portfolio-Score gesichert sind.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| Name der Anteilklasse       | Auflegungsdatum der Anteilklasse | Währung |
|-----------------------------|----------------------------------|---------|
| Thesaurierende Klasse EUR A | 9. Juni 2022                     | EUR     |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 12. Juli 2018                    | EUR     |
| Ausschüttende Klasse EUR I2 | 15. November 2018                | EUR     |
| Thesaurierende Klasse EUR X | 28. März 2024                    | EUR     |

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### CLO Income (Fortsetzung)

| <i>Name der Anteilklasse</i>                         | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|--|---|----------------|
| Ausschüttende Klasse EUR X                           | 12. September 2024                      | EUR            |
| Thesaurierende Klasse GBP Z                          | 12. Dezember 2019                       | GBP            |
| Ausschüttende Klasse JPY I                           | 1. August 2024                          | JPY            |
| Ausschüttende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert) | 1. August 2024                          | JPY            |
| Thesaurierende Klasse SEK I                          | 12. Juli 2018                           | SEK            |
| Thesaurierende Klasse USD A                          | 9. Juni 2022                            | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I                          | 12. Juli 2018                           | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD I                           | 17. August 2023                         | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD I2                          | 21. März 2019                           | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I4                         | 25. April 2024                          | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD I5                          | 12. Juli 2018                           | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD U                          | 24. Oktober 2024                        | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD Z                          | 18. April 2019                          | USD            |

### Commodities

Das Anlageziel des Commodities (das „Portfolio“) ist es, eine möglichst hohe Gesamtrendite (Erträge zuzüglich Kapitalzuwachs) durch Engagements in einer breiten Palette an Rohstoffen zu erzielen.

Um sein Ziel zu erreichen, wird das Portfolio Engagements in einer breiten Palette an Rohstoffgruppen anstreben, u. a. Energie, Edelmetalle, Industriemetalle, Lebewild, Agrarrohstoffe und Landwirtschaft.

Das Portfolio ist bestrebt, dieses Engagement durch eine Mischung von Anlagen zu erhalten, u. a. hauptsächlich Anlagen in rohstoffbezogene derivative Finanzinstrumente („FDI“) und Direktanlagen in die Aktien und aktienbezogenen Wertpapiere (nämlich Stamm- und Vorzugsaktien, ADRs und GDRs) von rohstoffabhängigen Unternehmen. Ferner kann das Portfolio ein Engagement in Rohstoffen anstreben, indem es in Anteile von Organismen für gemeinsame Anlagen investiert, u. a. börsengehandelte Fonds („ETFs“) und andere Portfolios des Fonds, wenn diese Anlage ein Rohstoffengagement in Einklang mit der Anlagepolitik des Portfolios bietet.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i>                           | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|--|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)  | 14. Dezember 2022                       | GBP            |
| Thesaurierende Klasse GBP I2                           | 4. Dezember 2024                        | GBP            |
| Thesaurierende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert) | 9. August 2024                          | GBP            |
| Thesaurierende Klasse GBP I5                           | 29. März 2022                           | GBP            |
| Thesaurierende Klasse GBP P                            | 5. August 2024                          | GBP            |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 15. März 2022                           | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 9. Februar 2022                         | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I3                           | 27. November 2024                       | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I5                           | 4. März 2022                            | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD M                            | 14. April 2022                          | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD Z                            | 15. Februar 2022                        | USD            |

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### Corporate Hybrid Bond

Das Anlageziel des Corporate Hybrid Bond (das „Portfolio“) ist die Erzielung einer attraktiven Gesamrendite (Ertrag zuzüglich Kapitalzuwachs).

Um sein Ziel zu erreichen, investiert das Portfolio vorwiegend in hybride Unternehmensanleihen, die ein Rating von Investment Grade oder unter Investment Grade aufweisen. Das Portfolio strebt die Anwendung von Grundsätzen der fundamentalen Bottom-up-Analyse bei der Auswahl der Wertpapiere zur Anlage an, d. h. die Analysen, die Neuberger Berman Investment Advisers LLC (der „Sub-Investment-Manager“) durchführt, konzentrieren sich auf die Stärken der einzelnen Wertpapiere, anstatt Wertpapiere auf Basis breiterer Themen, wie etwa nach Branchen, auszuwählen.

Die Analyse der Stärke eines Wertpapiers erfolgt individuell für jedes Wertpapier statt auf Basis breiterer Themen. So wird beispielsweise das Bonitätsrating des Wertpapiers im Verhältnis zu seiner erwarteten Rendite analysiert. Das Portfolio setzt den Schwerpunkt auf Wertpapiere, die weltweit an anerkannten Märkten notiert sind oder gehandelt werden, und ist nicht an Branchen oder Sektoren gebunden. Das Portfolio kann bei seinem Engagement zwischen geografischen Regionen und Ländern sowie zwischen Sektoren und Emittenten in Abhängigkeit von den wirtschaftlichen oder regionalen Fundamentaldaten (wie etwa der Bewertung der einzelnen Wertpapiere im Vergleich zu ähnlichen Wertpapieren) rotieren. Das Portfolio kann durch seine Anlagen in nachrangigen Schuldtiteln und/oder Wertpapieren mit Ratings unter Investment Grade ein mittleres Volatilitätsniveau aufweisen.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i>           | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|--|---|----------------|
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | 23. September 2016                      | AUD            |
| Ausschüttende Klasse CHF A             | 15. Februar 2024                        | CHF            |
| Thesaurierende Klasse CHF I3           | 26. Juni 2024                           | CHF            |
| Thesaurierende Klasse CHF P            | 27. April 2017                          | CHF            |
| Ausschüttende Klasse CHF P             | 17. Juni 2016                           | CHF            |
| Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) | 18. Juli 2016                           | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR A            | 3. Juni 2016                            | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I            | 19. November 2015                       | EUR            |
| Ausschüttende Klasse EUR I             | 19. November 2015                       | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I2           | 3. Februar 2017                         | EUR            |
| Ausschüttende Klasse EUR I2            | 24. Dezember 2020                       | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I3           | 13. September 2016                      | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I5           | 19. November 2015                       | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR M            | 18. Februar 2016                        | EUR            |
| Ausschüttende Klasse EUR M             | 13. Februar 2017                        | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR P            | 27. April 2017                          | EUR            |
| Ausschüttende Klasse EUR P             | 24. Juni 2016                           | EUR            |
| Thesaurierende Klasse GBP I            | 9. März 2017                            | GBP            |
| Thesaurierende Klasse GBP I2           | 15. Mai 2017                            | GBP            |
| Ausschüttende Klasse GBP I2            | 24. August 2016                         | GBP            |
| Thesaurierende Klasse GBP P            | 16. August 2019                         | GBP            |
| Ausschüttende Klasse GBP P             | 19. Mai 2017                            | GBP            |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | 2. August 2019                          | SGD            |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 18. Juli 2016                           | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD A            | 10. August 2016                         | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD A             | 23. April 2021                          | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD C1           | 13. Dezember 2017                       | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) | 19. September 2024                      | USD            |

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

| <i>Name der Anteilklasse</i> | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|------------------------------|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse USD I  | 14. Juni 2016                           | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD I   | 23. April 2021                          | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 3. Februar 2017                         | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD I2  | 3. Februar 2017                         | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD M  | 15. Dezember 2017                       | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD M   | 15. Dezember 2017                       | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD P  | 5. Mai 2017                             | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD Z  | 20. Januar 2017                         | USD            |

### Developed Market FMP – 2027

Das Anlageziel des Developed Market FMP – 2027 (das „Portfolio“) ist die Maximierung der laufenden Erträge während der Laufzeit des Portfolios, indem in eine diversifizierte Mischung aus globalen festverzinslichen Wertpapieren, einschließlich hochverzinslicher Wertpapiere, investiert wird.

Das Portfolio ist bestrebt, sein Anlageziel in erster Linie durch Anlagen in Schuldtiteln und Geldmarktinstrumenten zu erreichen, unter anderem durch den Einsatz von FDI, die von Regierungen, staatlichen Stellen sowie von Unternehmen weltweit begeben werden.

Die Wertpapiere werden typischerweise weltweit an anerkannten Märkten notiert oder gehandelt, und es wird kein besonderer Schwerpunkt auf bestimmte Branchen gesetzt. Die Wertpapiere können von einer anerkannten Ratingagentur mit Investment Grade oder niedriger bewertet sein oder gar keine Bonitätsbewertung aufweisen.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i> | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|------------------------------|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse EUR A  | 31. Juli 2023                           | EUR            |
| Ausschüttende Klasse EUR I   | 15. September 2023                      | EUR            |
| Thesaurierende Klasse USD A  | 31. Juli 2023                           | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD A   | 31. Juli 2023                           | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I  | 31. Juli 2023                           | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD I   | 21. August 2023                         | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD X  | 31. Juli 2023                           | USD            |

### EMD Corporate – Social and Environmental Transition

Das Anlageziel des EMD Corporate – Social and Environmental Transition (vormals: „Sustainable Emerging Market Corporate Debt (das „Portfolio“) ist es, eine möglichst hohe eine attraktive risikobereinigte Gesamtrendite (Erträge zuzüglich Kapitalzuwachs) aus in Schwellenländern emittierten Schuldtiteln zu erzielen.

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert das Portfolio vorwiegend in Schuldtitel und Geldmarktinstrumente, die von Unternehmen emittiert werden, welche ihren Hauptsitz in Schwellenländern haben oder einen überwiegenden Teil ihrer Geschäftstätigkeit in Schwellenländern ausüben, und die auf die Hartwährungen oder die Währungen dieser Schwellenländer lauten. Als Hartwährungen im Sinne des Portfolios werden folgende Währungen definiert: US-Dollar, Euro, britisches Pfund, japanischer Yen und Schweizer Franken.

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### EMD Corporate – Social and Environmental Transition (Fortsetzung)

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i>                        | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|---|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse CHF I                         | 28. Juni 2013                           | CHF            |
| Thesaurierende Klasse EUR A <sup>1</sup>            | 17. Dezember 2015                       | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I                         | 28. Juni 2013                           | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I3                        | 29. Juli 2016                           | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR M                         | 18. Februar 2016                        | EUR            |
| Ausschüttende Klasse EUR M                          | 18. Februar 2016                        | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR X                         | 20. Juli 2015                           | EUR            |
| Thesaurierende Klasse GBP I                         | 28. Juni 2013                           | GBP            |
| Thesaurierende Klasse SEK A                         | 1. Februar 2018                         | SEK            |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) <sup>1</sup> | 31. Oktober 2014                        | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD A <sup>1</sup>            | 28. Juni 2013                           | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD C1                        | 29. August 2017                         | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I                         | 28. Juni 2013                           | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD I                          | 28. Juni 2013                           | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I2                        | 25. März 2015                           | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD M                         | 3. Oktober 2017                         | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD M                          | 3. November 2017                        | USD            |

<sup>1</sup>Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

### Emerging Market Debt – Hard Currency

Das Anlageziel des Emerging Market Debt – Hard Currency (das „Portfolio“) ist es, eine möglichst hohe risikobereinigte Gesamtrendite (Erträge zuzüglich Kapitalzuwachs) aus auf Hartwährungen lautenden Schuldtiteln aus Schwellenländern zu erzielen.

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert das Portfolio vorwiegend in Schuldtitel und Geldmarktinstrumente, die von öffentlichen und privaten Emittenten in Schwellenländern emittiert werden und auf Hartwährungen lauten. Als „Hartwährungen“ im Sinne des Portfolios werden folgende Währungen definiert: US-Dollar, Euro,ritisches Pfund, japanischer Yen und Schweizer Franken. Anleger sollten beachten, dass öffentliche Emittenten auch Unternehmen sein können, die direkt oder indirekt zu 100 % in staatlicher Hand sind.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i>                           | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|--|---|----------------|
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) <sup>1</sup>    | 26. Februar 2019                        | AUD            |
| Ausschüttende Klasse AUD I                             | 26. Mai 2020                            | AUD            |
| Thesaurierende Klasse CAD I3 (nicht währungsgesichert) | 31. Oktober 2022                        | CAD            |
| Thesaurierende Klasse CHF I2                           | 13. Januar 2020                         | CHF            |

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### Emerging Market Debt – Hard Currency (Fortsetzung)

| <i>Name der Anteilklasse</i>                           | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|--|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse CHF P                            | 24. Januar 2018                         | CHF            |
| Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) <sup>1</sup>    | 16. April 2018                          | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR A <sup>1</sup>               | 31. Mai 2013                            | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I                            | 31. Mai 2013                            | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)  | 17. September 2019                      | EUR            |
| Ausschüttende Klasse EUR I                             | 7. Oktober 2016                         | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I2                           | 18. Dezember 2019                       | EUR            |
| Ausschüttende Klasse EUR I2                            | 6. November 2019                        | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I3                           | 29. Juli 2016                           | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I4                           | 10. Dezember 2015                       | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert) | 5. Juli 2022                            | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR M                            | 18. Februar 2016                        | EUR            |
| Ausschüttende Klasse EUR M                             | 18. Februar 2016                        | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR P                            | 23. Januar 2018                         | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR Z                            | 29. Dezember 2017                       | EUR            |
| Thesaurierende Klasse GBP I                            | 16. Dezember 2016                       | GBP            |
| Ausschüttende Klasse GBP I                             | 21. Februar 2018                        | GBP            |
| Thesaurierende Klasse GBP I2                           | 26. Januar 2018                         | GBP            |
| Ausschüttende Klasse GBP I2                            | 6. Juli 2015                            | GBP            |
| Thesaurierende Klasse GBP P                            | 14. März 2018                           | GBP            |
| Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) <sup>1</sup>    | 9. Januar 2019                          | HKD            |
| Thesaurierende Klasse JPY I                            | 11. Dezember 2017                       | JPY            |
| Thesaurierende Klasse SEK A                            | 5. November 2015                        | SEK            |
| Thesaurierende Klasse SEK I2                           | 19. Mai 2021                            | SEK            |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) <sup>1</sup>    | 17. Februar 2015                        | SGD            |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) <sup>1</sup>    | 31. Oktober 2014                        | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD A <sup>1</sup>               | 31. Mai 2013                            | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD A                             | 30. Oktober 2020                        | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD C1                           | 24. August 2017                         | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 31. Mai 2013                            | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD I                             | 31. Mai 2013                            | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I2                           | 15. November 2016                       | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD I2                            | 20. April 2018                          | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD I3                            | 20. März 2019                           | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD M                            | 25. August 2017                         | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD M                             | 15. September 2017                      | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD P                            | 11. Januar 2018                         | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD X                            | 16. Dezember 2021                       | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD Z                            | 26. April 2017                          | USD            |

<sup>1</sup>Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### Emerging Market Debt – Local Currency

Das Anlageziel des Emerging Market Debt – Local Currency (das „Portfolio“) ist es, eine möglichst hohe risikobereinigte Gesamrendite (Erträge zuzüglich Kapitalzuwachs) aus lokalen Währungen und lokalen Zinssätzen von Schwellenländern zu erzielen.

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert das Portfolio vorwiegend in Schuldtitel und Geldmarktinstrumente, die von Regierungen und staatlichen Stellen in Schwellenländern oder von Unternehmen, die ihren Hauptsitz in Schwellenländern haben oder einen überwiegenden Teil ihrer Geschäftstätigkeit in Schwellenländern ausüben, emittiert werden und die auf die lokalen Währungen dieser Schwellenländer lauten oder dem Währungsrisiko dieser Währungen unterliegen.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i>                           | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|--|---|----------------|
| Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich)                 | 4. Juni 2015                            | AUD            |
| Thesaurierende Klasse AUD B                            | 4. Juni 2015                            | AUD            |
| Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)                 | 4. Juni 2015                            | AUD            |
| Thesaurierende Klasse AUD E                            | 4. Juni 2015                            | AUD            |
| Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)                 | 4. Juni 2015                            | AUD            |
| Thesaurierende Klasse AUD T                            | 4. Juni 2015                            | AUD            |
| Thesaurierende Klasse EUR A <sup>1</sup>               | 28. Juni 2013                           | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I                            | 28. Juni 2013                           | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)  | 27. Juni 2017                           | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert) | 29. Dezember 2015                       | EUR            |
| Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)  | 14. März 2017                           | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR Y (nicht währungsgesichert)  | 25. Januar 2021                         | EUR            |
| Thesaurierende Klasse GBP I                            | 22. September 2017                      | GBP            |
| Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) | 2. November 2016                        | GBP            |
| Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)  | 2. November 2016                        | GBP            |
| Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)  | 25. Januar 2021                         | GBP            |
| Thesaurierende Klasse SEK A                            | 5. November 2015                        | SEK            |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) <sup>1</sup>    | 4. März 2015                            | SGD            |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) <sup>1</sup>    | 31. Oktober 2014                        | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD A <sup>1</sup>               | 28. Juni 2013                           | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich)                 | 4. Juni 2015                            | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD B                            | 4. Juni 2015                            | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)                 | 4. Juni 2015                            | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD E                            | 4. Juni 2015                            | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)                 | 2. September 2021                       | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 28. Juni 2013                           | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD I                             | 14. Oktober 2016                        | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I2                           | 13. August 2014                         | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I5                           | 26. September 2018                      | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)                 | 31. März 2016                           | USD            |

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### Emerging Market Debt – Local Currency (Fortsetzung)

| <i>Name der Anteilklasse</i>           | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|--|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse USD T            | 4. Juni 2015                            | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD X            | 23. Oktober 2013                        | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD Y            | 14. Januar 2021                         | USD            |
| Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich) | 5. Juni 2015                            | ZAR            |
| Thesaurierende Klasse ZAR B            | 5. Juni 2015                            | ZAR            |
| Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich) | 5. Juni 2015                            | ZAR            |
| Thesaurierende Klasse ZAR E            | 5. Juni 2015                            | ZAR            |
| Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) | 5. Juni 2015                            | ZAR            |
| Thesaurierende Klasse ZAR T            | 5. Juni 2015                            | ZAR            |

<sup>1</sup>Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

### Emerging Market Debt Blend

Das Anlageziel des Emerging Market Debt Blend (das „Portfolio“) ist es, eine möglichst hohe Gesamtrendite aus einer Mischung aus auf Hartwährungen lautenden, in Schwellenländern emittierten Schuldtiteln, lokalen Währungen von Schwellenländern und Schuldtiteln von Unternehmen in Schwellenländern zu erzielen.

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert das Portfolio vorwiegend in Schuldtitel und Geldmarktinstrumente, die von Regierungen und staatlichen Stellen in Schwellenländern oder von Unternehmen, die ihren Hauptsitz in Schwellenländern haben oder einen überwiegenden Teil ihrer Geschäftstätigkeit in Schwellenländern ausüben, emittiert werden und die auf die lokalen Währungen dieser Schwellenländer lauten oder dem Währungsrisiko dieser Währungen unterliegen oder auf Hartwährungen lauten. Als Hartwährungen im Sinne des Portfolios werden folgende Währungen definiert: US-Dollar, Euro,ritisches Pfund, japanischer Yen und Schweizer Franken.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i>                           | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|--|---|----------------|
| Ausschüttende Klasse AUD I3                            | 6. November 2019                        | AUD            |
| Thesaurierende Klasse EUR A <sup>1</sup>               | 4. Dezember 2015                        | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I                            | 8. Juli 2014                            | EUR            |
| Ausschüttende Klasse EUR I                             | 19. Juni 2015                           | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I2                           | 27. Mai 2014                            | EUR            |
| Ausschüttende Klasse EUR I2                            | 24. Februar 2015                        | EUR            |
| Ausschüttende Klasse EUR I3                            | 5. November 2019                        | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert) | 23. März 2017                           | EUR            |

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

| Name der Anteilklasse                                 | Auflegungsdatum der Anteilklasse | Währung |
|---|----------------------------------|---------|
| Thesaurierende Klasse EUR I5                          | 23. April 2014                   | EUR     |
| Thesaurierende Klasse EUR M                           | 29. Januar 2016                  | EUR     |
| Ausschüttende Klasse EUR M                            | 29. Januar 2016                  | EUR     |
| Thesaurierende Klasse EUR Z                           | 2. Juni 2014                     | EUR     |
| Thesaurierende Klasse GBP I                           | 31. März 2016                    | GBP     |
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | 12. April 2017                   | GBP     |
| Ausschüttende Klasse GBP I                            | 22. Mai 2018                     | GBP     |
| Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)  | 22. Mai 2018                     | GBP     |
| Thesaurierende Klasse GBP P                           | 13. Mai 2019                     | GBP     |
| Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) | 13. Mai 2019                     | GBP     |
| Thesaurierende Klasse GBP Z                           | 17. März 2016                    | GBP     |
| Thesaurierende Klasse NOK U                           | 13. März 2017                    | NOK     |
| Thesaurierende Klasse SEK A                           | 5. November 2015                 | SEK     |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) <sup>1</sup>   | 15. September 2017               | SGD     |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) <sup>1</sup>   | 15. September 2017               | USD     |
| Thesaurierende Klasse USD A <sup>1</sup>              | 4. Februar 2016                  | USD     |
| Thesaurierende Klasse USD C1                          | 24. August 2017                  | USD     |
| Thesaurierende Klasse USD I                           | 23. April 2014                   | USD     |
| Ausschüttende Klasse USD I                            | 1. Juni 2016                     | USD     |
| Ausschüttende Klasse USD I2                           | 24. Februar 2015                 | USD     |
| Thesaurierende Klasse USD I5                          | 24. Juli 2023                    | USD     |
| Thesaurierende Klasse USD M                           | 25. August 2017                  | USD     |
| Ausschüttende Klasse USD M                            | 26. September 2017               | USD     |
| Thesaurierende Klasse USD Z                           | 28. September 2015               | USD     |

<sup>1</sup>Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

### Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend

Das Anlageziel des Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend (das „Portfolio“) ist es, eine ansprechende Gesamrendite aus einer Mischung aus auf Hartwährungen und Lokalwährungen lautenden Schuldtiteln mit Investment Grade zu erzielen, die von Regierungen, quasistaatlichen und staatsnahen Stellen und Unternehmen in Schwellenländern begeben wurden, die die im Abschnitt „Nachhaltige Anlagekriterien“ des Prospekts definiert sind (die „Nachhaltigkeitskriterien“).

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert das Portfolio vorwiegend in Schuldtitel und Geldmarktinstrumente mit Investment Grade, die von Regierungen und staatlichen Stellen in Schwellenländern oder von Unternehmen, die ihren Hauptsitz in Schwellenländern haben oder einen überwiegenden Teil ihrer Geschäftstätigkeit in Schwellenländern ausüben, emittiert werden und die auf die Währungen dieser Schwellenländer („lokale Währungen“) lauten oder dem Währungsrisiko dieser Währungen unterliegen oder auf Hartwährungen lauten. Als Hartwährungen im Sinne des Portfolios werden folgende Währungen definiert: US-Dollar, Euro, britisches Pfund, japanischer Yen und Schweizer Franken.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| Name der Anteilklasse        | Auflegungsdatum der Anteilklasse | Währung |
|------------------------------|----------------------------------|---------|
| Thesaurierende Klasse AUD I2 | 16. Februar 2021                 | AUD     |
| Thesaurierende Klasse NOK I  | 9. Mai 2018                      | NOK     |
| Thesaurierende Klasse NOK I3 | 5. September 2023                | NOK     |
| Thesaurierende Klasse USD I  | 10. Juli 2017                    | USD     |
| Thesaurierende Klasse USD Z  | 2. November 2017                 | USD     |

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### Emerging Markets Equity

Das Anlageziel des Emerging Markets Equity (das „Portfolio“) ist die Erwirtschaftung von langfristigem Kapitalzuwachs. Um dieses Ziel zu erreichen, investiert das Portfolio vorwiegend in Dividendenpapiere und equity-linked (eigenkapitalbezogene) Wertpapiere weltweit, die an anerkannten Märkten notiert sind oder gehandelt werden und von Unternehmen ausgegeben werden, die:

- überwiegend an einer anerkannten Börse in Schwellenländern gehandelt werden;
- nach den Gesetzen von Schwellenländern organisiert sind und ihren Hauptsitz in Schwellenländern haben; oder
- deren Gesamtumsatz und/oder Gesamtvermögen zu mindestens 50 % aus in Schwellenländern hergestellten Waren, erzielten Umsätzen oder Gewinnen oder Dienstleistungen stammen. Das Portfolio kann auch in andere Organismen für gemeinsame Anlagen investieren, die ein Engagement in solchen Wertpapieren ermöglichen, allerdings nur bis zu maximal 10 % des Nettoinventarwerts des Portfolios.

Neuberger Berman Investment Advisers LLC (der „Sub-Investment Manager“) wendet bei der Auswahl der Wertpapiere einen fundamentalen, research-intensiven Bottom-up-Ansatz an und setzt den Schwerpunkt auf Unternehmen mit hohen Renditen. Hierbei werden wirtschaftliche, gesetzliche und geschäftliche Entwicklungen berücksichtigt, um Länder und Wirtschaftssektoren (wie Energie, Finanzen, Gesundheitswesen, Telekommunikationsdienstleistungen und Versorger) zu identifizieren, die seiner Einschätzung nach besonders attraktiv sind.

Der Sub-Investment-Manager ist bestrebt, in Unternehmen zu investieren, von denen er glaubt, dass sie über nachhaltiges Wachstum des freien Cashflows verfügen und zu attraktiven Bewertungen gehandelt werden. Mit dem so konstruierten Portfolio soll das Risiko verringert werden, indem es über viele Branchen innerhalb der von ihm identifizierten Länder und Wirtschaftssektoren diversifiziert, wobei generell beabsichtigt ist, über Länder und geografische Regionen hinweg diversifiziert zu bleiben.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i>                         | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|--|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse AUD B                          | 30. November 2016                       | AUD            |
| Thesaurierende Klasse AUD E                          | 30. November 2016                       | AUD            |
| Thesaurierende Klasse AUD T                          | 30. November 2016                       | AUD            |
| Ausschüttende Klasse CAD I (nicht währungsgesichert) | 24. Januar 2018                         | CAD            |
| Ausschüttende Klasse CAD I2                          | 17. Dezember 2021                       | CAD            |
| Thesaurierende Klasse EUR I                          | 4. Oktober 2010                         | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR M                          | 18. Februar 2016                        | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR Z                          | 5. Februar 2018                         | EUR            |
| Thesaurierende Klasse GBP I                          | 15. Januar 2014                         | GBP            |
| Thesaurierende Klasse GBP Z                          | 17. März 2016                           | GBP            |
| Thesaurierende Klasse USD A <sup>1</sup>             | 4. Oktober 2010                         | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD B                          | 30. November 2016                       | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD E                          | 30. November 2016                       | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I                          | 4. Oktober 2010                         | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD M                          | 27. Mai 2016                            | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD T                          | 30. November 2016                       | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD Z                          | 30. Juni 2014                           | USD            |
| Thesaurierende Klasse ZAR B                          | 30. November 2016                       | ZAR            |
| Thesaurierende Klasse ZAR E                          | 30. November 2016                       | ZAR            |
| Thesaurierende Klasse ZAR T                          | 30. November 2016                       | ZAR            |

<sup>1</sup>Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### Euro Bond

Das Anlageziel des Euro Bond (ehemals: „Euro Opportunistic Bond“) (das „Portfolio“) ist die Erzielung einer attraktiven Gesamrendite (Ertrag und Kapitalzuwachs), indem er in einen diversifizierten Mix aus fest- und variabel verzinslichen, in Euro denominierten Schuldtiteln investiert.

Das Portfolio strebt danach, sein Anlageziel durch einen disziplinierten Anlageprozess zu erreichen, der in auf Euro lautende Anleihen über eine Vielzahl von Sektoren und Laufzeiten hinweg investiert und dabei eine Kombination aus Top-down- und Bottom-up-Strategien zur Identifizierung einer Vielzahl an Wertquellen einsetzt. Top-down-Strategien konzentrieren sich auf makroökonomische Aspekte sowie Länder- und Sektoranalysen. Bottom-up-Strategien bewerten die Eigenschaften einzelner Instrumente oder Emittenten.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i> | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|------------------------------|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse EUR A  | 19. September 2024                      | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I  | 14. November 2018                       | EUR            |
| Ausschüttende Klasse EUR I   | 14. November 2018                       | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR M  | 24. Dezember 2024                       | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR Z  | 12. April 2024                          | EUR            |

### Euro Bond Absolute Return

Das Anlageziel des Euro Bond Absolute Return (das „Portfolio“) ist es, über einen Marktzyklus (für gewöhnlich 3-5 Jahre) unabhängig von Marktbedingungen und mit moderater Volatilität positive absolute Renditen zu erzielen. Dies soll durch die Umsetzung einer uneingeschränkten Strategie erreicht werden, die Long- und synthetische Short-Positionen in einem diversifizierten Portfolio von überwiegend in Euro denominierten Schuldtiteln kombiniert.

Das Portfolio strebt danach, sein Anlageziel durch einen disziplinierten Anlageprozess zu erreichen, bei dem eine Kombination aus Top-down und Bottom-up-Strategien zur Identifizierung vielfacher Wertquellen eingesetzt wird. Top-down-Strategien konzentrieren sich auf makroökonomische Aspekte sowie Länder- und Sektoranalysen. Bottom-up-Strategien bewerten die Eigenschaften einzelner Instrumente oder Emittenten.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i> | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|------------------------------|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse EUR A  | 23. Dezember 2024                       | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I  | 29. November 2018                       | EUR            |
| Ausschüttende Klasse EUR I   | 29. November 2018                       | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 | 20. Dezember 2024                       | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 | 28. März 2019                           | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR Z  | 4. April 2024                           | EUR            |
| Thesaurierende Klasse USD Z  | 22. November 2019                       | USD            |

### European High Yield Bond

Das Anlageziel des European High Yield Bond (das „Portfolio“) ist es, am europäischen Markt für hochverzinsliche Festzinsanlagen eine möglichst hohe Gesamrendite (Erträge zuzüglich Kapitalzuwachs) zu erzielen.

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert das Portfolio vorwiegend in fest verzinsliche Hochzins-Unternehmensanleihen, die (i) auf eine europäische Währung lauten oder (ii) von Unternehmen jeder Branche emittiert oder garantiert werden, die ihren Hauptsitz in einem europäischen Land haben oder einen überwiegenden Teil ihrer Geschäftstätigkeit in einem europäischen Land ausüben und an anerkannten Märkten notiert sind oder gehandelt werden.

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### European High Yield Bond (Fortsetzung)

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i>                        | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|---|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse CHF I                         | 14. März 2023                           | CHF            |
| Thesaurierende Klasse EUR I                         | 27. Juni 2014                           | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I2                        | 8. November 2023                        | EUR            |
| Ausschüttende Klasse EUR I5                         | 15. Juli 2024                           | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR M                         | 29. Januar 2016                         | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR X                         | 20. Februar 2018                        | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR Y                         | 4. Januar 2023                          | EUR            |
| Ausschüttende Klasse EUR Y                          | 27. Juni 2023                           | EUR            |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) <sup>1</sup> | 31. Oktober 2014                        | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I                         | 27. Juni 2014                           | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD X                         | 12. Januar 2018                         | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD Z                         | 26. April 2019                          | USD            |

<sup>1</sup>Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

### European Sustainable Equity

Anlageziel des European Sustainable Equity (das „Portfolio“) ist es, über einen Anlagehorizont von 3 bis 5 Jahren eine jährliche Überschussrendite von mindestens 2 % gegenüber der Benchmark (dem MSCI Europe Index (Total Return, Net of Tax, EUR)) vor Gebühren zu erzielen, indem hauptsächlich in ein Portfolio aus europäischen Aktienbeständen investiert wird, die den Nachhaltigkeitskriterien (wie im Prospekt dargelegt) Rechnung tragen.

Anleger sollten beachten, dass die Zielrendite weder über den Anlagehorizont noch über einen Zeitraum von 12 Monaten oder einen beliebigen Zeitraum garantiert ist und das Kapital des Portfolios einem Risiko unterliegt. Darüber hinaus werden Anleger darauf hingewiesen, dass es innerhalb des Anlagehorizonts erhebliche Zeiträume geben kann, in denen die Wertentwicklung des Portfolios von der angestrebten Rendite abweicht, und dass das Portfolio bisweilen negative Renditen verzeichnen kann. Es kann keine Garantie gegeben werden, dass das Portfolio letztendlich sein Anlageziel erreicht.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i>            | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|---|---|----------------|
| Ausschüttende Klasse EUR A <sup>1</sup> | 12. Januar 2022                         | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I             | 24. Februar 2021                        | EUR            |
| Ausschüttende Klasse EUR I              | 24. Februar 2021                        | EUR            |
| Ausschüttende Klasse EUR I3             | 7. Oktober 2021                         | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I5            | 20. Juli 2021                           | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR M             | 24. Februar 2021                        | EUR            |

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### European Sustainable Equity (Fortsetzung)

| Name der Anteilklasse                                 | Auflegungsdatum der Anteilklasse | Währung |
|---|----------------------------------|---------|
| Thesaurierende Klasse EUR Z                           | 29. März 2021                    | EUR     |
| Thesaurierende Klasse USD A (nicht währungsgesichert) | 15. März 2021                    | USD     |
| Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) | 15. März 2021                    | USD     |
| Thesaurierende Klasse USD M (nicht währungsgesichert) | 15. März 2021                    | USD     |

<sup>1</sup>Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

### Event Driven

Das Anlageziel des Event Driven (das „Portfolio“) ist es, durch den Einsatz von Event-Driven-Strategien (Ereignisorientierte Strategien) positive, marktneutrale und risikobereinigte absolute Renditen mit geringer Korrelation zu breiteren Aktienmärkten zu generieren.

Das Portfolio ist bestrebt, sein Anlageziel zu erreichen, indem es sowohl Long-Positionen als auch synthetische Short-Positionen in globalen Dividendenpapieren durch die Nutzung von Event-Driven-Strategien eingeht. Event-Driven-Strategien basieren auf angekündigten oder erwarteten Ereignissen oder einer Reihe von Ereignissen und auf Anlagen in die Wertpapiere von Unternehmen, auf die sich das Eintreten dieser Ereignisse auswirken könnte. Das Portfolio geht Engagements in Dividendenpapieren ein, die an anerkannten Märkten in Industrieländern notiert oder gehandelt werden, und die Kapitalmaßnahmen unterliegen oder voraussichtlich unterliegen werden, insbesondere Fusionen, Übernahmeofferten, Tauschangebote, Übernahmeangebote, Ausgliederungen, Stellvertreter-Kämpfe, Liquidationen, Kapitalaufstockungen, Unternehmensumstrukturierungen, Rechtsstreitigkeiten, gesetzliche oder aufsichtsrechtliche Ereignisse oder nachkonkursliche Situationen. Das Portfolio geht Long-Positionen in Bezug auf Dividendenpapiere ein, bei denen es mit einem Wertanstieg infolge dieser Ereignisse rechnet, und geht synthetische Short-Positionen in Dividendenpapieren ein, bei denen es infolge dieser Ereignisse einen Wertrückgang erwartet.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| Name der Anteilklasse        | Auflegungsdatum der Anteilklasse | Währung |
|------------------------------|----------------------------------|---------|
| Thesaurierende Klasse EUR I  | 17. Januar 2023                  | EUR     |
| Ausschüttende Klasse EUR I5  | 20. Mai 2024                     | EUR     |
| Thesaurierende Klasse GBP I5 | 26. Oktober 2022                 | GBP     |
| Ausschüttende Klasse GBP I5  | 26. Oktober 2022                 | GBP     |
| Thesaurierende Klasse GBP P  | 26. Oktober 2022                 | GBP     |
| Thesaurierende Klasse JPY I  | 25. Oktober 2024                 | JPY     |
| Thesaurierende Klasse USD I  | 26. Oktober 2022                 | USD     |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 26. Oktober 2022                 | USD     |

### Global Bond

Das Anlageziel des Global Bond (das „Portfolio“) ist es, an den weltweiten Rentenmärkten eine möglichst hohe Gesamrendite (Erträge zuzüglich Kapitalzuwachs) zu erzielen.

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert das Portfolio in erster Linie in:

- Schuldtitel mit Investment-Grade-Rating, die von Regierungen und Behörden der Mitgliedstaaten der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung („OECD“) begeben werden; und
- Schuldtitel mit Investment-Grade-Rating, die von Unternehmen emittiert werden, welche ihren Hauptsitz in OECD-Ländern haben oder den überwiegenden Teil ihrer Geschäftstätigkeit dort ausüben.

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### Global Bond (Fortsetzung)

Alle Wertpapiere werden an anerkannten Märkten notiert oder gehandelt, und es wird kein besonderer Schwerpunkt auf bestimmte Branchen gesetzt.

Der Anlage-Ansatz basiert auf vier grundlegenden differenzierenden Faktoren:

- Diversifizierung durch den Einsatz verschiedener, nicht korrelierender Alpha-Quellen;
- Aktives Währungsmanagement;
- Integriertes Global Macro Overlay; und
- Hauseigene Risikomanagementsysteme.

Darüber hinaus führen der Manager und Sub-Investment-Manager Datenanalysen durch und versuchen, Chancen über verschiedene Zeithorizonte zu nutzen. Kern der Anlagephilosophie sind die qualitativen Beurteilungen des Managers und Sub-Investment-Managers, die in allen Phasen des Anlageprozesses durchgeführt werden. Dieser Ermessensspielraum gibt dem Investment-Manager die Möglichkeit, Informationen und Ereignisse zu berücksichtigen, die nicht ohne weiteres quantifiziert werden können, so zum Beispiel politische Ereignisse, Veränderungen der regulatorischen Rahmenbedingungen oder die Wirkung von Marktpositionierung und Absicherung.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i>                                    | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|---|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse EUR I Benchmark Währungsgesicherte Klasse | 31. August 2023                         | EUR            |
| Ausschüttende Klasse GBP P                                      | 15. August 2024                         | GBP            |
| Thesaurierende Klasse USD C1                                    | 3. Januar 2018                          | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I Benchmark Währungsgesicherte Klasse | 26. September 2022                      | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I                                     | 16. Juli 2012                           | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD M                                     | 2. Juli 2018                            | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD Z                                     | 20. Januar 2017                         | USD            |

### Global Equity Megatrends

Das Anlageziel des Global Equity Megatrends (das „Portfolio“) ist die Erwirtschaftung von langfristigem Kapitalzuwachs, überwiegend durch die Anlage in ein Portfolio aus Aktienpositionen, die langfristigen globalen Themen ausgesetzt sind.

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert das Portfolio vorwiegend in Aktien, die an anerkannten Märkten weltweit notiert sind oder gehandelt werden (hierzu können auch Schwellenländer zählen) und von Unternehmen aller Marktkapitalisierungskategorien und Branchen emittiert werden.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i>                           | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|--|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)  | 13. August 2024                         | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I                            | 22. Dezember 2023                       | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)  | 19. Oktober 2018                        | EUR            |
| Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) | 17. Mai 2024                            | GBP            |
| Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)  | 20. Juni 2024                           | GBP            |
| Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)  | 5. Juli 2023                            | GBP            |
| Thesaurierende Klasse HKD A <sup>1</sup>               | 20. Dezember 2024                       | HKD            |
| Thesaurierende Klasse SGD A <sup>1</sup>               | 8. Dezember 2023                        | SGD            |
| Thesaurierende Klasse USD A <sup>1</sup>               | 27. April 2018                          | USD            |

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### Global Equity Megatrends (Fortsetzung)

| <i>Name der Anteilklasse</i> | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|------------------------------|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 27. April 2018                          | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I  | 27. April 2018                          | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I4 | 27. März 2024                           | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD M  | 27. April 2018                          | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD U  | 11. Oktober 2024                        | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD Z  | 25. Februar 2022                        | USD            |

<sup>1</sup>Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

### Global Flexible Credit Income

Das Anlageziel des Global Flexible Credit Income (das „Portfolio“) ist es, eine möglichst hohe Gesamtrendite aus einem hohen laufenden Ertrag und langfristigem Kapitalzuwachs zu erzielen, indem er in eine diversifizierte Mischung aus fest- und variabel verzinslichen globalen Schuldtiteln einschließlich Hochzinstiteln investiert.

Das Portfolio ist bestrebt, sein Anlageziel in erster Linie durch Anlagen in Schuldtiteln und Geldmarktinstrumenten zu erreichen, unter anderem durch den Einsatz von FDI, die von Regierungen, staatlichen Stellen sowie von Unternehmen weltweit, auch innerhalb der Schwellenländer, begeben werden. Die Wertpapiere werden typischerweise weltweit an anerkannten Märkten notiert oder gehandelt, und es wird kein besonderer Schwerpunkt auf bestimmte Branchen gesetzt. Die Wertpapiere können von einer Anerkannten Ratingagentur mit Investment Grade oder niedriger bewertet sein.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i>                        | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|---|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse CAD I5                        | 18. März 2021                           | CAD            |
| Thesaurierende Klasse EUR I                         | 29. September 2020                      | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR M                         | 13. August 2020                         | EUR            |
| Thesaurierende Klasse GBP I5                        | 1. Juni 2020                            | GBP            |
| Ausschüttende Klasse GBP P                          | 15. August 2024                         | GBP            |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) <sup>1</sup> | 5. Februar 2024                         | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD A <sup>1</sup>            | 16. September 2020                      | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I                         | 1. Juni 2020                            | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD I                          | 1. Juni 2020                            | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD M                         | 16. September 2020                      | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD U                         | 9. Oktober 2024                         | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD Z                         | 1. Juni 2020                            | USD            |

<sup>1</sup>Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### Global High Yield Engagement

Das Anlageziel des Global High Yield Engagement (ehemals: „Global High Yield SDG Engagement“) (das „Portfolio“) ist es, am globalen Markt für hochverzinsliche Festzinsanlagen eine möglichst hohe Gesamrendite (Erträge zuzüglich Kapitalzuwachs) zu erzielen.

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert das Portfolio vorwiegend in:

- auf US-Dollar und andere Währungen lautende hochverzinsliche Festzinspapiere, die von Unternehmen einer beliebigen Branche emittiert oder garantiert werden; und
- hochverzinsliche Festzinspapiere mit kurzer Duration, die von Regierungen und staatlichen Stellen weltweit emittiert werden und vorwiegend auf US-Dollar lauten, die weltweit ansässig sind und an anerkannten Märkten notiert oder gehandelt werden.

Das Portfolio investiert vorwiegend in Wertpapiere, die auf im BofA Merrill Lynch Global High Yield Constrained Index (in USD abgesicherte Gesamrendite) enthaltene Währungen lauten.

Darüber hinaus kann das Portfolio auch in Wertpapiere von Unternehmen investieren, die ihren Sitz in Schwellenländern haben sowie in staatliche Wertpapiere von Schwellenländern, was im Vergleich zu Anlagen in höher entwickelten Ländern mit einem zusätzlichen Risiko verbunden sein kann.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i>     | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|----------------------------------|---|----------------|
| Ausschüttende Klasse AUD I       | 3. Mai 2022                             | AUD            |
| Thesaurierende Klasse AUD I4     | 12. Februar 2024                        | AUD            |
| Thesaurierende Klasse CHF I4     | 3. Mai 2022                             | CHF            |
| Ausschüttende Klasse CHF I4      | 3. Mai 2022                             | CHF            |
| Thesaurierende Klasse CHF X      | 3. Mai 2022                             | CHF            |
| Thesaurierende Klasse EUR I4     | 3. Mai 2022                             | EUR            |
| Ausschüttende Klasse EUR I4      | 3. Mai 2022                             | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR X      | 3. Mai 2022                             | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR Z (PF) | 4. August 2016                          | EUR            |
| Thesaurierende Klasse GBP I4     | 3. Mai 2022                             | GBP            |
| Thesaurierende Klasse GBP X      | 3. Mai 2022                             | GBP            |
| Thesaurierende Klasse USD A      | 16. August 2016                         | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I      | 4. August 2016                          | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I4     | 3. Mai 2022                             | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD M       | 29. Januar 2018                         | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD X      | 10. November 2020                       | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD Z      | 4. August 2016                          | USD            |

### Global Investment Grade Credit

Das Anlageziel des Global Investment Grade Credit (das „Portfolio“) besteht darin, vor Gebühren über einen Marktzyklus (von in der Regel 3 Jahren) eine durchschnittliche Zielrendite von 1% über der Benchmark (Bloomberg Barclays Global Aggregate Corporate Index (Total Return, Hedged USD)) zu erzielen. Zu diesem Zweck wird überwiegend in globale Unternehmensanleihen mit Investment-Grade-Rating investiert.

Anleger sollten beachten, dass die Zielrendite weder über einen Marktzyklus noch über einen Zeitraum von 12 Monaten oder einen beliebigen Zeitraum garantiert ist und das Kapital des Portfolios einem Risiko unterliegt. Darüber hinaus werden Anleger darauf hingewiesen, dass es innerhalb eines Marktzyklus erhebliche Zeiträume geben kann, in denen die Wertentwicklung des Portfolios von der angestrebten Rendite abweicht, und dass das Portfolio bisweilen negative Renditen verzeichnen kann. Es kann keine Garantie gegeben werden, dass das Portfolio letztendlich sein Anlageziel erreicht.

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### Global Investment Grade Credit (Fortsetzung)

Das Portfolio wird überwiegend in festverzinsliche Wertpapiere mit Investment-Grade-Rating investieren, die von Unternehmen emittiert werden, welche ihren Hauptsitz in OECD-Ländern haben oder den überwiegenden Teil ihrer Geschäftstätigkeit dort ausüben. Das Portfolio strebt die Anwendung von Grundsätzen der fundamentalen Bottom-up-Analyse bei der Auswahl der Wertpapiere zur Anlage an, d. h. die Analysen des Managers und des Sub-Investment-Managers konzentrieren sich auf die Stärken der einzelnen Wertpapiere, anstatt Wertpapiere auf Basis breiterer Themen, wie etwa nach Branchen, auszuwählen. So wird das Rating des Wertpapiers im Verhältnis zur vorgeschlagenen Rendite analysiert, und die Merkmale des Wertpapiers werden unter die Lupe genommen, um die Vorhersagbarkeit von Cashflows zu bestimmen. Hierzu werden Faktoren wie das Cashflow-Profil des Emittenten, die Verschuldung und der Verschuldungsgrad herangezogen.

Das Portfolio wird den Schwerpunkt auf Wertpapiere legen, die weltweit an anerkannten Märkten notiert sind oder gehandelt werden, und ist nicht an Branchen oder Sektoren gebunden. Das Portfolio kann bei seinem Engagement zwischen geografischen Regionen und Ländern sowie zwischen Sektoren und Emittenten in Abhängigkeit von den wirtschaftlichen oder regionalen Fundamentaldaten (wie etwa der Bewertung der einzelnen Wertpapiere im Vergleich zu ähnlichen Wertpapieren) rotieren.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i> | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|------------------------------|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse EUR I  | 27. Juli 2023                           | EUR            |
| Ausschüttende Klasse GBP P   | 25. Juli 2024                           | GBP            |
| Ausschüttende Klasse GBP X   | 6. September 2024                       | GBP            |
| Thesaurierende Klasse USD I  | 1. September 2021                       | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD X  | 1. September 2021                       | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD Z  | 1. September 2021                       | USD            |

### Global Opportunistic Bond

Das Anlageziel des Global Opportunistic Bond (das „Portfolio“) ist die Erzielung einer attraktiven Gesamrendite (Ertrag und Kapitalzuwachs), indem er opportunistisch in einen diversifizierten Mix aus fest- und variabel verzinslichen Schuldtiteln in allen Sektoren und unter unterschiedlichen Marktbedingungen investiert.

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert das Portfolio vorwiegend in festverzinsliche Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die von Regierungen, staatlichen Stellen und Unternehmen weltweit emittiert werden. Die Wertpapiere werden weltweit an anerkannten Märkten notiert oder gehandelt, und es wird kein besonderer Schwerpunkt auf bestimmte Branchen gesetzt. Die Wertpapiere können von einer Anerkannten Ratingagentur mit Investment Grade oder niedriger bewertet sein. Ergänzend kann das Portfolio auch Vorzugsaktien von öffentlichen Emittenten oder Unternehmen halten.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i> | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|------------------------------|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse EUR I  | 27. November 2020                       | EUR            |
| Thesaurierende Klasse GBP P  | 16. Januar 2020                         | GBP            |
| Thesaurierende Klasse USD A  | 22. September 2017                      | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I  | 20. Dezember 2016                       | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD I   | 20. Dezember 2016                       | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 23. April 2018                          | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD I2  | 24. Oktober 2024                        | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD Z  | 16. Mai 2019                            | USD            |

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### Global Sustainable Equity

Das Anlageziel des Global Sustainable Equity (das „Portfolio“) ist es, über einen Anlagehorizont von 3 bis 5 Jahren eine jährliche Überschussrendite von mindestens 2 % gegenüber der Benchmark (dem MSCI World Index (Total Return, Net of Tax, USD)) vor Gebühren zu erzielen, indem hauptsächlich in ein Portfolio aus globalen Aktienbeständen investiert wird, welche die Nachhaltigkeitskriterien (wie im Prospekt dargelegt) erfüllen.

Anleger sollten beachten, dass die Zielrendite weder über den Anlagehorizont noch über einen Zeitraum von 12 Monaten oder einen beliebigen Zeitraum garantiert ist und das Kapital des Portfolios einem Risiko unterliegt. Darüber hinaus werden Anleger darauf hingewiesen, dass es innerhalb des Anlagehorizonts erhebliche Zeiträume geben kann, in denen die Wertentwicklung des Portfolios von der angestrebten Rendite abweicht, und dass das Portfolio bisweilen negative Renditen verzeichnen kann. Es kann keine Garantie gegeben werden, dass das Portfolio letztendlich sein Anlageziel erreicht.

Um dieses Ziel zu erreichen, wird das Portfolio vorwiegend in Aktien investieren, die an anerkannten Märkten weltweit notiert sind oder gehandelt werden (hierzu können auch Schwellenländer zählen) und von Unternehmen aller Marktkapitalisierungskategorien und Branchen emittiert werden.

Das Portfolio wird in erster Linie in Aktien von Unternehmen investieren, deren Verhaltensweisen, Prozesse und Geschäftstätigkeiten Fortschritte auf Systemebene zur Erlangung ökologischer und sozialer Ziele bewirken, wie z. B. durch: Zugang zur Gesundheitsversorgung, nachhaltigen Konsum (d. h. die Nutzung von Produkten, Energie und Dienstleistungen mit möglichst geringen Umweltauswirkungen) sowie bewusste Verbraucher, Zugang zu Informationen und digitale Revolution, Energiewende und industrielle Innovation, Ressourceneffizienz, Entwicklung des Humankapitals, Fintech und finanzielle Inklusion (d. h. die Verfügbarkeit von Finanzdienstleistungen und Chancengleichheit beim Zugang zu derlei Dienstleistungen). Um das Anlageziel des Portfolios zu erreichen, investiert der Sub-Investment-Manager in qualitativ hochwertige Unternehmen, die (i) attraktive nachhaltige Produkte oder Dienstleistungen anbieten, (ii) bei ihrer Geschäftstätigkeit eine Verpflichtung zu Nachhaltigkeit unter Beweis stellen und (iii) wirtschaftlich wettbewerbsfähig sind, wie nachstehend detaillierter erläutert.

Der Sub-Investment-Manager beabsichtigt, einen Anlageprozess zu verfolgen, der sich auf die Analyse von „Best-in-Class“-Unternehmen innerhalb eines Anlageuniversums von börsennotierten Aktien erstreckt, die von Unternehmen hauptsächlich aus Industrieländern weltweit begeben werden, und zwar sowohl in finanzieller als auch in ESG-Hinsicht (Umwelt, Soziales, Governance). Die Finanz- und ESG-Analysen werden es dem Sub-Investment-Manager ermöglichen, Unternehmen zu bewerten und identifizieren, die im Hinblick auf ihre Performance bei finanziellen und ESG-Faktoren als „Best-in-Class“ erachtet werden.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| Name der Anteilklasse                                  | Auflegungsdatum der Anteilklasse | Währung |
|--|----------------------------------|---------|
| Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert) | 24. Februar 2021                 | EUR     |
| Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)  | 24. Februar 2021                 | EUR     |
| Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert)  | 31. März 2021                    | EUR     |
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)  | 6. April 2021                    | GBP     |
| Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert) | 6. April 2021                    | GBP     |
| Thesaurierende Klasse USD A <sup>1</sup>               | 2. Dezember 2021                 | USD     |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 24. Februar 2021                 | USD     |
| Ausschüttende Klasse USD I                             | 24. Februar 2021                 | USD     |
| Thesaurierende Klasse USD M                            | 15. März 2021                    | USD     |
| Thesaurierende Klasse USD Z                            | 25. Februar 2022                 | USD     |

<sup>1</sup>Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

### Global Value

Das Anlageziel des Global Value (ehemals: „Global Sustainable Value“) (das „Portfolio“) ist es, langfristigen Kapitalzuwachs zu erzielen.

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert das Portfolio vorwiegend in Aktien, die von Unternehmen emittiert werden, welche an anerkannten Märkten weltweit notiert sind oder gehandelt werden (hierzu können auch Schwellenländer zählen).

Durch Analysen werden Anlagethemen ermittelt (d. h. Merkmale von Aktien, von denen angenommen wird, dass sie systematisch an die Erwirtschaftung von überdurchschnittlichen Renditen gekoppelt sind). Die Anlagethemen werden zur Beurteilung der Merkmale von Wertpapieremittenten eingesetzt und sind maßgeblich für die Einzeltitelauswahl. Zu den Themen gehören insbesondere die Bewertung, die Ertragsqualität, die Preisdynamik und die Börsenstimmung im Zusammenhang mit den einzelnen Emissionen.

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### Global Value (Fortsetzung)

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i>                           | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|--|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse EUR M                            | 29. Januar 2016                         | EUR            |
| Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert) | 27. September 2022                      | GBP            |
| Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)  | 20. Oktober 2023                        | GBP            |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 14. August 2017                         | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 18. Dezember 2014                       | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD Z                            | 24. Mai 2016                            | USD            |

### High Yield Bond

Das Anlageziel des High Yield Bond (das „Portfolio“) ist es, am Markt für hochverzinsliche Festzinsanlagen eine möglichst hohe Gesamrendite (Erträge zuzüglich Kapitalzuwachs) zu erzielen. Um dieses Ziel zu erreichen, investiert das Portfolio in erster Linie in:

- hochverzinsliche Festzinsanlagen, die von Unternehmen in den USA und außerhalb der USA emittiert werden, die ihren Hauptsitz in den USA haben oder einen überwiegenden Teil ihrer Geschäftstätigkeit in den USA ausüben, sowie
- hochverzinsliche Festzinspapiere, die von Regierungen und staatlichen Stellen weltweit emittiert werden und vorwiegend auf US-Dollar lauten, die an anerkannten Märkten notiert oder gehandelt werden.

Darüber hinaus kann das Portfolio, obwohl es seine Anlagen auf die USA konzentriert, auch in Wertpapiere von Unternehmen mit Sitz in Schwellenländern sowie in Wertpapiere von Regierungen von Schwellenländern investieren. Dies kann im Vergleich zu Anlagen in höher entwickelten Volkswirtschaften mit zusätzlichen Risiken verbunden sein.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i>                        | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|---|---|----------------|
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) <sup>1</sup> | 5. September 2012                       | AUD            |
| Thesaurierende Klasse AUD A <sup>1</sup>            | 28. August 2012                         | AUD            |
| Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich)              | 22. Juli 2013                           | AUD            |
| Thesaurierende Klasse AUD B                         | 10. Dezember 2020                       | AUD            |
| Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)              | 2. Juli 2014                            | AUD            |
| Thesaurierende Klasse AUD E                         | 2. Juli 2014                            | AUD            |
| Ausschüttende Klasse AUD I                          | 29. Dezember 2011                       | AUD            |
| Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)              | 27. Juni 2013                           | AUD            |
| Ausschüttende Klasse AUD T (Wöchentlich)            | 11. Juni 2013                           | AUD            |
| Thesaurierende Klasse AUD T                         | 2. August 2013                          | AUD            |
| Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich) <sup>1</sup> | 23. Juli 2013                           | CAD            |
| Thesaurierende Klasse CHF A                         | 5. Juli 2011                            | CHF            |
| Thesaurierende Klasse CHF I                         | 27. Mai 2011                            | CHF            |
| Thesaurierende Klasse CHF I2                        | 22. Oktober 2013                        | CHF            |
| Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)              | 1. August 2012                          | CNY            |
| Ausschüttende Klasse CNY I (Monatlich)              | 9. November 2012                        | CNY            |
| Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) <sup>1</sup> | 19. Juni 2012                           | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR A <sup>1</sup>            | 3. Mai 2006                             | EUR            |

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### High Yield Bond (Fortsetzung)

| <i>Name der Anteilklasse</i>                                     | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|--|---|----------------|
| Ausschüttende Klasse EUR A <sup>1</sup>                          | 24. Februar 2012                        | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I                                      | 9. November 2009                        | EUR            |
| Ausschüttende Klasse EUR I                                       | 18. Oktober 2012                        | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I2                                     | 5. Dezember 2012                        | EUR            |
| Ausschüttende Klasse EUR I2                                      | 5. Dezember 2012                        | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR M                                      | 29. Januar 2016                         | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR Z                                      | 5. November 2014                        | EUR            |
| Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich) <sup>1</sup>              | 7. Juli 2014                            | GBP            |
| Thesaurierende Klasse GBP A <sup>1</sup>                         | 27. April 2011                          | GBP            |
| Ausschüttende Klasse GBP A <sup>1</sup>                          | 24. Februar 2012                        | GBP            |
| Thesaurierende Klasse GBP I                                      | 27. Juli 2010                           | GBP            |
| Ausschüttende Klasse GBP I                                       | 8. November 2006                        | GBP            |
| Thesaurierende Klasse GBP I2                                     | 5. Dezember 2012                        | GBP            |
| Ausschüttende Klasse GBP I2                                      | 5. Dezember 2012                        | GBP            |
| Thesaurierende Klasse GBP Z                                      | 17. März 2016                           | GBP            |
| Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) <sup>1</sup>              | 14. September 2012                      | HKD            |
| Ausschüttende Klasse JPY A (Monatlich) (nicht währungsgesichert) | 20. August 2024                         | JPY            |
| Thesaurierende Klasse SEK A                                      | 16. Juni 2011                           | SEK            |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) <sup>1</sup>              | 30. März 2012                           | SGD            |
| Thesaurierende Klasse SGD A <sup>1</sup>                         | 9. März 2012                            | SGD            |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) <sup>1</sup>              | 2. Mai 2012                             | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD A (Wöchentlich) <sup>1</sup>            | 22. Januar 2013                         | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD A <sup>1</sup>                         | 11. Januar 2010                         | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD A <sup>1</sup>                          | 24. Februar 2012                        | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich)                           | 31. Oktober 2012                        | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD B                                      | 31. Oktober 2012                        | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD C                                      | 21. November 2012                       | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD C1                                     | 25. Oktober 2017                        | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD C1                                      | 7. September 2017                       | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)                           | 2. Juli 2014                            | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD E                                      | 2. Juli 2014                            | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)                           | 13. September 2012                      | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I                                      | 3. Mai 2006                             | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD I                                       | 16. November 2009                       | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD I2 (Monatlich)                          | 24. September 2015                      | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I2                                     | 5. Dezember 2012                        | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD I2                                      | 5. Dezember 2012                        | USD            |

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### High Yield Bond (Fortsetzung)

| <i>Name der Anteilklasse</i>             | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|--|---|----------------|
| Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich)  | 1. Juni 2016                            | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD M              | 18. Februar 2016                        | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD M               | 1. März 2018                            | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD P              | 9. Januar 2018                          | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)   | 31. Oktober 2012                        | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD T (Wöchentlich) | 11. Juni 2013                           | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD T              | 31. Oktober 2012                        | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD U (Monatlich)   | 2. Mai 2013                             | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD U              | 9. Oktober 2012                         | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD Z              | 2. Mai 2014                             | USD            |
| Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)   | 11. Juni 2013                           | ZAR            |
| Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)   | 2. Juli 2014                            | ZAR            |
| Thesaurierende Klasse ZAR E              | 2. Juli 2014                            | ZAR            |
| Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)   | 11. Juni 2013                           | ZAR            |
| Thesaurierende Klasse ZAR T              | 19. Dezember 2016                       | ZAR            |

<sup>1</sup>Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

### InnovAsia

Das Anlageziel des InnovAsia (ehemals: „InnovAsia 5G“) (das „Portfolio“) ist es, überwiegend in ein Portfolio von Aktienbeständen zu investieren, dessen Schwerpunkt auf Unternehmen liegt, die an innovativen Technologien (wie nachstehend definiert) beteiligt sind oder davon profitieren.

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert das Portfolio vorwiegend in Aktien, die an anerkannten Märkten weltweit notiert sind oder gehandelt werden (hierzu können auch Schwellenländer zählen) und von Unternehmen aller Marktkapitalisierungskategorien und Branchen mit innovativen Technologien oder Geschäftsmodellen emittiert werden, die:

- gemäß den Gesetzen eines asiatischen Landes gegründet oder organisiert sind oder ihren Hauptsitz in Asien haben;
- im Allgemeinen einen Großteil ihres zusätzlichen Wachstums aus (a) Waren, die im Großraum China hergestellt oder verkauft werden, (b) Investments, die im Großraum China getätigt werden, oder (c) Dienstleistungen, die in Asien erbracht werden, generieren, oder
- im Allgemeinen eine Mehrheit ihrer Vermögenswerte in Asien halten.

Das Portfolio kann in Unternehmen jeder Marktkapitalisierung investieren, muss sich aber typischerweise bei Unternehmen engagieren, die zum Zeitpunkt des Erwerbs über eine Marktkapitalisierung von mehr als 500 Millionen USD verfügen.

Zur Realisierung des Anlageziels auf Portfolioebene verfolgen die Sub-Investment-Manager den folgenden Anlageprozess (der nachstehend ausführlicher beschrieben wird), um ein Universum von Unternehmen zu identifizieren, die auf lange Sicht ein Engagement in bahnbrechenden Technologien, innovativen Geschäftsmodellen mit einer relativ niedrigen Durchdringungsrate in Asien oder in einer relativ frühen Wachstumsphase sowie strukturellen Trends und Themen wie 5G/Internet der Dinge (unter anderem Dateninfrastruktur, vernetzte Geräte oder fortschrittliche Halbleiter), digitaler Lebensstil (unter anderem Gesundheitswesen, Bildung oder Internet und Verbraucher) und industrielle Innovationen (unter anderem Robotik, saubere Technologien oder intelligente Logistik) („Innovative Technologien“) bieten:

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### InnovAsia (Fortsetzung)

- Qualitative Unternehmensanalysen – zur Identifizierung von Unternehmen, die eine Schlüsselposition bei der Einführung innovativer Technologien einnehmen, sowie von Unternehmen, die gut aufgestellt sind, um von neuen Geschäftsmodellen in Verbindung mit innovativen Technologien zu profitieren;
- Quantitative Filter – zur Identifizierung von Unternehmen, die von den Sub-Investment-Managern als unter Umständen zu illiquide oder von zu geringer Marktkapitalisierung erachtet werden;
- Strategische Bewertung und Analyse – zur eingehenden Untersuchung und Analyse von Unternehmen, einschließlich der Unternehmens-/Geschäftsmodelle, der Qualität der Geschäftsleitung, der Wettbewerbsfähigkeit und der Erfolgsbilanz, ermittelt auf Basis vorhandener Finanzdaten (z. B. Daten über Marktanteile); und
- Wertpapierauswahl und Portfoliokonstruktion – zur Auswahl von Unternehmen, die über die erforderlichen Fähigkeiten verfügen, um die Entwicklung innovativer Technologien zu fördern, und von denen die Sub-Investment-Manager der Meinung sind, dass sie über einen Zeitraum von drei bis fünf Jahren ein erhebliches Potenzial zur Steigerung ihres Kapitalwerts aufweisen, sowie zur Bestimmung von Kurszielen auf der Grundlage der aktuellen Marktpreise der Wertpapiere und vorangegangener Analysen, um Anhaltspunkte für Kauf- und Verkaufsentscheidungen zu erhalten.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i>                          | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|---|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse CHF I4                          | 14. Juli 2021                           | CHF            |
| Thesaurierende Klasse EUR A                           | 14. Juli 2021                           | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I4                          | 14. Juli 2021                           | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) | 18. Oktober 2021                        | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR X                           | 14. Juli 2021                           | EUR            |
| Thesaurierende Klasse SGD A                           | 14. Juli 2021                           | SGD            |
| Thesaurierende Klasse SGD I4                          | 14. Juli 2021                           | SGD            |
| Thesaurierende Klasse SGD X                           | 14. Juli 2021                           | SGD            |
| Thesaurierende Klasse USD A                           | 14. Juli 2021                           | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I                           | 14. Juli 2021                           | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I4                          | 14. Juli 2021                           | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD M                           | 5. November 2021                        | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD X                           | 14. Juli 2021                           | USD            |

### Japan Equity Engagement

Das Anlageziel des Japan Equity Engagement (das „Portfolio“) ist die Erwirtschaftung einer durchschnittlichen Zielrendite von 3 % über der des MSCI Japan Small Cap Net Index über einen Marktzyklus (für gewöhnlich 3 Jahre).

Um sein Anlageziel zu erreichen, wird das Portfolio vorrangig in Aktien von Unternehmen mit kleiner und mittlerer Marktkapitalisierung investieren, die ihren Hauptsitz entweder in Japan haben oder den überwiegenden Teil ihrer Geschäftstätigkeit in Japan ausüben und weltweit an anerkannten Märkten notiert sind oder gehandelt werden.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i>                           | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|--|---|----------------|
| Ausschüttende Klasse EUR I5                            | 10. Februar 2022                        | EUR            |
| Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert) | 6. Juli 2023                            | GBP            |
| Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)  | 11. November 2021                       | GBP            |
| Thesaurierende Klasse JPY A <sup>1</sup>               | 21. Mai 2024                            | JPY            |
| Thesaurierende Klasse JPY I                            | 12. Mai 2020                            | JPY            |
| Ausschüttende Klasse JPY I                             | 12. Mai 2020                            | JPY            |
| Thesaurierende Klasse JPY I5                           | 16. Februar 2021                        | JPY            |

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### Japan Equity Engagement (Fortsetzung)

| Name der Anteilklasse                                  | Auflegungsdatum der Anteilklasse | Währung |
|--|----------------------------------|---------|
| Thesaurierende Klasse JPY Z                            | 28. April 2021                   | JPY     |
| Thesaurierende Klasse USD A <sup>1</sup>               | 21. Mai 2024                     | USD     |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 8. Februar 2024                  | USD     |
| Thesaurierende Klasse USD I5 (nicht währungsgesichert) | 12. September 2024               | USD     |
| Thesaurierende Klasse USD X (nicht währungsgesichert)  | 3. Dezember 2024                 | USD     |

<sup>1</sup>Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

### Next Generation Connectivity

Das Anlageziel des Next Generation Connectivity (ehemals: „5G Connectivity“) (das „Portfolio“) ist die Erwirtschaftung einer durchschnittlichen Zielrendite von 3 - 5 % über dem MSCI All-Country World Index vor Gebühren über einen Marktzyklus (für gewöhnlich 3 Jahre), indem hauptsächlich in ein Portfolio aus globalen Aktienbeständen investiert wird, das sich auf Unternehmen fokussiert, die an der Entwicklung und Verbesserung der Konnektivität der nächsten Generation beteiligt sind oder davon profitieren.

Um sein Anlageziel zu erreichen, investiert das Portfolio vorwiegend in Aktien, die an anerkannten Märkten weltweit notiert sind oder gehandelt werden (hierzu können auch Schwellenländer zählen) und von Unternehmen aller Marktkapitalisierungskategorien und Wirtschaftssektoren emittiert werden. Das Portfolio kann in Unternehmen jeder Marktkapitalisierung investieren, muss sich aber typischerweise bei Unternehmen engagieren, die zum Zeitpunkt des Erwerbs über eine Marktkapitalisierung von mehr als 500 Millionen USD verfügen.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| Name der Anteilklasse                                 | Auflegungsdatum der Anteilklasse | Währung |
|---|----------------------------------|---------|
| Thesaurierende Klasse AUD A <sup>1</sup>              | 20. Mai 2020                     | AUD     |
| Thesaurierende Klasse AUD E                           | 16. Februar 2024                 | AUD     |
| Thesaurierende Klasse AUD I2                          | 13. September 2023               | AUD     |
| Thesaurierende Klasse CHF A                           | 1. August 2023                   | CHF     |
| Thesaurierende Klasse CHF I                           | 1. August 2023                   | CHF     |
| Thesaurierende Klasse CHF I2                          | 13. September 2023               | CHF     |
| Thesaurierende Klasse CNY A                           | 1. Februar 2021                  | CNY     |
| Thesaurierende Klasse CNY I2                          | 13. September 2023               | CNY     |
| Thesaurierende Klasse EUR A <sup>1</sup>              | 13. Mai 2020                     | EUR     |
| Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert) | 22. April 2020                   | EUR     |
| Thesaurierende Klasse EUR I                           | 30. Juni 2020                    | EUR     |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) | 12. Juni 2020                    | EUR     |
| Thesaurierende Klasse EUR I2                          | 13. September 2023               | EUR     |
| Thesaurierende Klasse EUR I5                          | 1. September 2020                | EUR     |
| Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) | 22. April 2020                   | EUR     |
| Thesaurierende Klasse GBP A <sup>1</sup>              | 15. Mai 2020                     | GBP     |
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | 2. November 2020                 | GBP     |
| Thesaurierende Klasse GBP I2                          | 13. September 2023               | GBP     |
| Thesaurierende Klasse HKD A <sup>1</sup>              | 13. Mai 2020                     | HKD     |

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### Next Generation Connectivity (Fortsetzung)

| <i>Name der Anteilklasse</i>             | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|--|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse HKD I2             | 13. September 2023                      | HKD            |
| Thesaurierende Klasse SGD A <sup>1</sup> | 14. Mai 2020                            | SGD            |
| Thesaurierende Klasse SGD I2             | 13. September 2023                      | SGD            |
| Thesaurierende Klasse USD A <sup>1</sup> | 4. Mai 2020                             | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD E              | 1. Februar 2023                         | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I              | 8. April 2020                           | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD I               | 8. April 2020                           | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I2             | 10. März 2021                           | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I3             | 6. November 2020                        | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I5             | 7. Mai 2020                             | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD M              | 2. Juni 2020                            | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD Z              | 19. März 2021                           | USD            |
| Thesaurierende Klasse ZAR A <sup>1</sup> | 14. Februar 2023                        | ZAR            |
| Thesaurierende Klasse ZAR E              | 10. Februar 2023                        | ZAR            |

<sup>1</sup>Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

### Next Generation Mobility

Das Anlageziel des Next Generation Mobility (das „Portfolio“) ist es, einen langfristigen Kapitalzuwachs durch die vorrangige Anlage in ein Portfolio globaler Beteiligungen zu erzielen, wobei der Schwerpunkt auf Unternehmen liegt, die an der Mobilität für die nächste Generation beteiligt sind oder davon profitieren.

Um sein Anlageziel zu erreichen, investiert das Portfolio vorwiegend in Aktien, die an anerkannten Märkten weltweit notiert sind oder gehandelt werden (hierzu können auch Schwellenländer zählen) und von Unternehmen aller Marktkapitalisierungskategorien und Wirtschaftssektoren emittiert werden. Das Portfolio kann in Unternehmen jeder Marktkapitalisierung investieren, muss sich aber typischerweise bei Unternehmen engagieren, die zum Zeitpunkt des Erwerbs über eine Marktkapitalisierung von mehr als 500 Millionen USD verfügen.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i>                          | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|---|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse EUR A <sup>1</sup>              | 7. September 2018                       | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I                           | 13. Januar 2021                         | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) | 24. Juni 2020                           | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) | 26. Oktober 2018                        | EUR            |
| Thesaurierende Klasse USD A <sup>1</sup>              | 11. September 2018                      | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD C1                          | 21. Mai 2019                            | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I                           | 21. August 2018                         | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD I                            | 21. August 2018                         | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD M                           | 21. Mai 2019                            | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD X                           | 23. Januar 2019                         | USD            |

<sup>1</sup>Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### Next Generation Space Economy

Das Anlageziel des Next Generation Space Economy (das „Portfolio“) ist es, einen langfristigen Kapitalzuwachs durch die vorrangige Anlage in ein Portfolio globaler Aktienpositionen zu erzielen, die an der Weltraumwirtschaft der nächsten Generation beteiligt sind oder davon profitieren.

Um sein Anlageziel zu erreichen, investiert das Portfolio vorwiegend in Aktien, die an anerkannten Märkten weltweit notiert sind oder gehandelt werden (hierzu können auch Schwellenländer zählen) und von Unternehmen aller Marktkapitalisierungskategorien und Wirtschaftssektoren emittiert werden. Das Portfolio kann in Unternehmen jeder Marktkapitalisierung investieren, muss sich aber typischerweise bei Unternehmen engagieren, die zum Zeitpunkt des Erwerbs über eine Marktkapitalisierung von mehr als 500 Millionen USD verfügen.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i>                           | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|--|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)  | 30. Oktober 2024                        | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert) | 10. Mai 2022                            | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)  | 10. Mai 2022                            | EUR            |
| Thesaurierende Klasse USD A <sup>1</sup>               | 30. Oktober 2024                        | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 10. Mai 2022                            | USD            |

<sup>1</sup>Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

### Short Duration Emerging Market Debt

Das Anlageziel des Short Duration Emerging Market Debt (das „Portfolio“) ist es, einen stabilen Ertrag und eine stabile Rendite zu erzielen, indem er in eine diversifizierte Auswahl an auf Hartwährungen lautenden Staats- und Unternehmensanleihen mit kurzer Duration investiert, die in Schwellenländern emittiert werden. Als Hartwährungen im Sinne des Portfolios werden folgende Währungen definiert: US-Dollar, Euro,ritisches Pfund, japanischer Yen und Schweizer Franken.

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert das Portfolio vorwiegend in Schuldtitel und Geldmarktinstrumente mit kurzer Duration, die von öffentlichen Emittenten oder Unternehmen emittiert werden, welche ihren Hauptsitz in Schwellenländern haben oder einen überwiegenden Teil ihrer Geschäftstätigkeit in Schwellenländern ausüben, und die auf Hartwährungen lauten. Anleger sollten auch beachten, dass Unternehmen, die direkt oder indirekt zu 100 % in staatlicher Hand sind, als öffentliche Emittenten betrachtet werden. Mit Ausnahme zulässiger Anlagen in Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten, die nicht börsennotiert sind, werden alle Wertpapiere, in die das Portfolio investiert, an anerkannten Märkten notiert oder gehandelt, und es wird kein besonderer Schwerpunkt auf bestimmte Branchen oder Regionen gesetzt.

Anlagen in Wertpapieren, die von Unternehmen mit Sitz in Schwellenländern sowie von Regierungen und staatlichen Stellen von Schwellenländern emittiert werden, können im Vergleich zu Anlagen in höher entwickelten Ländern zusätzlichen Risiken unterliegen.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i>                        | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|---|---|----------------|
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) <sup>1</sup> | 31. August 2016                         | AUD            |
| Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich) <sup>1</sup> | 6. November 2015                        | CAD            |
| Thesaurierende Klasse CHF A                         | 6. Juni 2014                            | CHF            |
| Ausschüttende Klasse CHF A                          | 6. Juni 2014                            | CHF            |
| Thesaurierende Klasse CHF I                         | 6. Juni 2014                            | CHF            |
| Ausschüttende Klasse CHF I                          | 13. Juni 2014                           | CHF            |
| Thesaurierende Klasse CHF I2                        | 20. Februar 2015                        | CHF            |
| Ausschüttende Klasse CHF I2                         | 18. April 2017                          | CHF            |

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

| <i>Name der Anteilklasse</i>                        | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|---|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse CHF I5                        | 31. März 2014                           | CHF            |
| Thesaurierende Klasse CHF P                         | 25. April 2017                          | CHF            |
| Thesaurierende Klasse EUR A <sup>1</sup>            | 13. Juni 2014                           | EUR            |
| Ausschüttende Klasse EUR A                          | 6. Juni 2014                            | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I                         | 6. Juni 2014                            | EUR            |
| Ausschüttende Klasse EUR I                          | 6. Juni 2014                            | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I2                        | 23. Juni 2014                           | EUR            |
| Ausschüttende Klasse EUR I2                         | 30. März 2017                           | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I5                        | 14. März 2014                           | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR M                         | 29. Januar 2016                         | EUR            |
| Ausschüttende Klasse EUR M                          | 29. Januar 2016                         | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR P                         | 23. Februar 2017                        | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR U                         | 6. Juni 2018                            | EUR            |
| Thesaurierende Klasse GBP A <sup>1</sup>            | 22. November 2016                       | GBP            |
| Thesaurierende Klasse GBP I                         | 16. Dezember 2016                       | GBP            |
| Ausschüttende Klasse GBP I                          | 20. Februar 2018                        | GBP            |
| Thesaurierende Klasse GBP I2                        | 30. September 2016                      | GBP            |
| Ausschüttende Klasse GBP I2                         | 19. Oktober 2017                        | GBP            |
| Ausschüttende Klasse GBP I5                         | 11. April 2014                          | GBP            |
| Thesaurierende Klasse GBP P                         | 13. August 2019                         | GBP            |
| Thesaurierende Klasse JPY I                         | 23. Februar 2015                        | JPY            |
| Ausschüttende Klasse JPY I                          | 22. September 2014                      | JPY            |
| Thesaurierende Klasse SEK A                         | 2. Februar 2018                         | SEK            |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) <sup>1</sup> | 31. Oktober 2014                        | SGD            |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) <sup>1</sup> | 31. Oktober 2014                        | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD A <sup>1</sup>            | 6. Dezember 2013                        | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD A                          | 6. Juni 2014                            | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD C1                        | 29. August 2017                         | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD C1                         | 29. August 2017                         | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I                         | 31. Oktober 2013                        | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD I                          | 2. Juni 2016                            | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I2                        | 12. September 2014                      | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD I2                         | 30. Oktober 2015                        | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I5                        | 19. März 2014                           | USD            |

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

| <i>Name der Anteilklasse</i> | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|------------------------------|---|----------------|
| Ausschüttende Klasse USD I5  | 9. Oktober 2014                         | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD M  | 24. August 2017                         | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD M   | 29. August 2017                         | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD P  | 10. August 2015                         | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD Z  | 1. April 2014                           | USD            |

<sup>1</sup>Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

### Short Duration Euro Bond

Das Anlageziel des Short Duration Euro Bond (ehemals: „Ultra Short Term Euro Bond“) (das „Portfolio“) ist es, über einen Zeitraum von einem Jahr und unabhängig vom Marktumfeld eine attraktive Outperformance gegenüber der Euro-Barrendite zu erzielen, indem in eine diversifizierte Mischung aus kurzfristigen, in Euro denominierten, fest- und variabel verzinslichen Schuldtiteln investiert wird.

Das Portfolio strebt danach, sein Anlageziel durch einen disziplinierten Anlageprozess zu erreichen, der in auf Euro lautende Anleihen über eine Vielzahl von Sektoren und Laufzeiten hinweg investiert und dabei eine Kombination aus Top-down- und Bottom-up-Strategien zur Identifizierung einer Vielzahl an Wertquellen einsetzt. Top-down-Strategien konzentrieren sich auf makroökonomische Aspekte sowie Länder- und Sektoranalysen. Bottom-up-Strategien bewerten die Eigenschaften einzelner Instrumente oder Emittenten.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i> | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|------------------------------|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse CHF P  | 30. Mai 2022                            | CHF            |
| Thesaurierende Klasse CHF U  | 17. Dezember 2019                       | CHF            |
| Thesaurierende Klasse EUR A  | 10. Juni 2021                           | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I  | 31. Oktober 2018                        | EUR            |
| Ausschüttende Klasse EUR I   | 31. Oktober 2018                        | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 | 27. Februar 2020                        | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 | 6. Februar 2019                         | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR M  | 29. Juli 2021                           | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR U  | 17. Dezember 2019                       | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR Z  | 20. Dezember 2018                       | EUR            |
| Thesaurierende Klasse USD I  | 15. September 2021                      | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD Z  | 24. Januar 2019                         | USD            |

### Short Duration High Yield Engagement

Der Short Duration High Yield Engagement (ehemals: „Short Duration High Yield SDG Engagement“) (das „Portfolio“) strebt als Anlageziel einen hohen laufenden Ertrag durch Anlage in hochverzinslichen Festzinsanlagen mit kurzer Duration an.

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert das Portfolio vorwiegend in Hochzinsanleihen mit kurzer Duration, die emittiert werden von:

- Unternehmen in den USA und außerhalb der USA, die ihren Hauptsitz in den USA haben oder einen überwiegenden Teil ihrer Geschäftstätigkeit in den USA ausüben; und
- Regierungen und staatlichen Stellen in den USA, die überwiegend auf US-Dollar lauten und an anerkannten Märkten notiert oder gehandelt werden. Es wird kein besonderer Schwerpunkt auf bestimmte Branchen gesetzt.

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### Short Duration High Yield Engagement (Fortsetzung)

Darüber hinaus kann das Portfolio, obwohl es seine Anlagen auf die USA und andere Mitgliedstaaten der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung („OECD“) konzentriert, auch in Wertpapiere von Unternehmen mit Sitz in Schwellenländern sowie in Wertpapiere von Regierungen von Schwellenländern investieren. Dies kann im Vergleich zu Anlagen in höher entwickelten Volkswirtschaften mit zusätzlichen Risiken verbunden sein.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i>                        | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|---|---|----------------|
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) <sup>1</sup> | 11. Juni 2013                           | AUD            |
| Thesaurierende Klasse CHF A                         | 9. März 2012                            | CHF            |
| Thesaurierende Klasse CHF I                         | 20. Dezember 2011                       | CHF            |
| Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)              | 1. August 2012                          | CNY            |
| Thesaurierende Klasse EUR A <sup>1</sup>            | 20. Dezember 2011                       | EUR            |
| Ausschüttende Klasse EUR A <sup>1</sup>             | 14. Februar 2014                        | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I                         | 20. Dezember 2011                       | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I2                        | 5. Dezember 2012                        | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR M                         | 29. Januar 2016                         | EUR            |
| Ausschüttende Klasse EUR M                          | 29. Januar 2016                         | EUR            |
| Thesaurierende Klasse GBP I                         | 17. Januar 2012                         | GBP            |
| Ausschüttende Klasse GBP I                          | 20. Dezember 2011                       | GBP            |
| Thesaurierende Klasse GBP I2                        | 5. Dezember 2012                        | GBP            |
| Ausschüttende Klasse GBP I2                         | 5. Dezember 2012                        | GBP            |
| Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) <sup>1</sup> | 21. September 2022                      | HKD            |
| Thesaurierende Klasse JPY I                         | 28. März 2012                           | JPY            |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) <sup>1</sup> | 17. Januar 2014                         | SGD            |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) <sup>1</sup> | 22. Januar 2014                         | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD A <sup>1</sup>            | 20. Dezember 2011                       | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD A <sup>1</sup>             | 30. November 2012                       | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD C1                        | 2. Oktober 2017                         | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I                         | 20. Dezember 2011                       | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD I                          | 9. Januar 2012                          | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I2                        | 5. Dezember 2012                        | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD I2                         | 5. Dezember 2012                        | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I4                        | 10. Mai 2023                            | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I5                        | 8. September 2022                       | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD M                         | 25. August 2017                         | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD M                          | 20. Dezember 2017                       | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD Z                         | 1. April 2014                           | USD            |

<sup>1</sup>Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### Strategic Income

Das Anlageziel des Strategic Income (das „Portfolio“) ist es, eine möglichst hohe Gesamrendite aus einem hohen laufenden Ertrag und langfristigem Kapitalzuwachs zu erzielen, indem er opportunistisch in einen diversifizierten Mix aus fest- und variabel verzinslichen Schuldtiteln unter unterschiedlichen Marktbedingungen investiert.

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert das Portfolio vorwiegend in Schuldtitel, die von US-Unternehmen oder von der US-Regierung und ihren staatlichen Stellen emittiert werden. Diese Wertpapiere werden an anerkannten Märkten notiert oder gehandelt und können von anerkannten Ratingagenturen mit Investment-Grade oder darunter bewertet werden oder kein Rating aufweisen.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i>                                     | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|--|---|----------------|
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) <sup>1</sup>              | 15. September 2017                      | AUD            |
| Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)                           | 2. April 2024                           | AUD            |
| Ausschüttende Klasse AUD Z (Monatlich)                           | 1. Juli 2019                            | AUD            |
| Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) <sup>1</sup>              | 31. Mai 2023                            | CNY            |
| Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) <sup>1</sup>              | 7. August 2017                          | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR A <sup>1</sup>                         | 14. November 2022                       | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I                                      | 22. Januar 2016                         | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR M                                      | 29. Januar 2016                         | EUR            |
| Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich) <sup>1</sup>              | 15. September 2017                      | GBP            |
| Ausschüttende Klasse GBP I (Monatlich)                           | 6. Dezember 2023                        | GBP            |
| Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) <sup>1</sup>              | 15. September 2017                      | HKD            |
| Ausschüttende Klasse JPY A (Monatlich) <sup>1</sup>              | 16. Februar 2024                        | JPY            |
| Ausschüttende Klasse JPY A (Monatlich) (nicht währungsgesichert) | 3. September 2024                       | JPY            |
| Ausschüttende Klasse JPY E (Monatlich) (nicht währungsgesichert) | 20. August 2024                         | JPY            |
| Thesaurierende Klasse JPY I                                      | 26. April 2013                          | JPY            |
| Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert)            | 26. April 2013                          | JPY            |
| Ausschüttende Klasse JPY I CG                                    | 10. August 2015                         | JPY            |
| Ausschüttende Klasse JPY I                                       | 25. Juni 2014                           | JPY            |
| Thesaurierende Klasse JPY Z                                      | 1. April 2022                           | JPY            |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) <sup>1</sup>              | 31. Oktober 2014                        | SGD            |
| Thesaurierende Klasse SGD A <sup>1</sup>                         | 15. September 2017                      | SGD            |
| Ausschüttende Klasse SGD I (Monatlich)                           | 4. Juni 2018                            | SGD            |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) <sup>1</sup>              | 31. Oktober 2014                        | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD A <sup>1</sup>                         | 11. Februar 2015                        | USD            |

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### Strategic Income (Fortsetzung)

| Name der Anteilklasse                               | Auflegungsdatum der Anteilklasse | Währung |
|---|----------------------------------|---------|
| Ausschüttende Klasse USD A                          | 10. August 2016                  | USD     |
| Thesaurierende Klasse USD C1                        | 25. August 2017                  | USD     |
| Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)              | 2. April 2024                    | USD     |
| Thesaurierende Klasse USD I                         | 26. April 2013                   | USD     |
| Ausschüttende Klasse USD I                          | 10. Dezember 2014                | USD     |
| Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich)             | 24. Juli 2024                    | USD     |
| Thesaurierende Klasse USD M                         | 18. Februar 2016                 | USD     |
| Ausschüttende Klasse USD M                          | 25. August 2017                  | USD     |
| Thesaurierende Klasse USD Z                         | 30. Juni 2014                    | USD     |
| Ausschüttende Klasse ZAR A (Monatlich) <sup>1</sup> | 11. April 2024                   | ZAR     |
| Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)              | 2. April 2024                    | ZAR     |

<sup>1</sup>Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

### Sustainable Asia High Yield

Anlageziel des Sustainable Asia High Yield (das „Portfolio“) ist es, über einen Marktzyklus (in der Regel 3 Jahre) den JP Morgan JESG JACI High Yield Index (Total Return, USD) vor Gebühren zu übertreffen, indem überwiegend in Hartwährungsanleihen mit einem Rating unterhalb von Investment Grade investiert wird, die in asiatischen Ländern begeben wurden und den Nachhaltigkeitskriterien gerecht werden.

Anleger sollten beachten, dass die Zielrendite weder über einen Marktzyklus noch über einen Zeitraum von 12 Monaten oder einen beliebigen Zeitraum garantiert ist und das Kapital des Portfolios einem Risiko unterliegt. Darüber hinaus werden Anleger darauf hingewiesen, dass es innerhalb eines Marktzyklus erhebliche Zeiträume geben kann, in denen die Wertentwicklung des Portfolios von der angestrebten Rendite abweicht, und dass das Portfolio bisweilen negative Renditen verzeichnen kann. Es kann keine Garantie gegeben werden, dass das Portfolio letztendlich sein Anlageziel erreicht.

Das Portfolio wird vorwiegend in Hartwährungsanleihen ohne Investment Grade und in Geldmarktinstrumente investieren, die von Regierungen oder staatlichen Stellen aus den Ländern Asiens oder von Unternehmen emittiert werden, die ihren Hauptsitz in dieser Region haben oder dort einen überwiegenden Teil ihrer Geschäftstätigkeit ausüben, und die dem Ziel des Portfolios der Förderung ökologischer und sozialer Merkmale Rechnung tragen. Als Hartwährungen im Sinne des Portfolios werden folgende Währungen definiert: US-Dollar, Euro, britisches Pfund, japanischer Yen und Schweizer Franken. Anleger sollten beachten, dass öffentliche Emittenten auch Unternehmen sein können, die direkt oder indirekt zu 100 % in staatlicher Hand sind.

Mit Ausnahme zulässiger Anlagen in Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten, die nicht börsennotiert sind, werden alle Wertpapiere, in die das Portfolio investiert, an anerkannten Märkten notiert oder gehandelt, und es wird kein besonderer Schwerpunkt auf bestimmte Branchen gesetzt.

Bei der Entscheidung über die Portfolioanlagen werden der Manager und Sub-Investment-Manager Emittenten bevorzugen, die:

- eine geringe CO<sub>2</sub>-Emissionsintensität aufweisen. Das Portfolio strebt eine Reduzierung der CO<sub>2</sub>-Emissionen von mindestens 30 % gegenüber dem breiteren Anlageuniversum asiatischer Hochzinsanleihen an, das durch den JPMorgan Asian Credit High Yield Index (der „Index“) repräsentiert wird; und
- bessere ESG-Praktiken (Umwelt, Soziales und Governance) unter Beweis stellen. Das Portfolio strebt, basierend auf den ESG-Bewertungen eines etablierten externen Anbieters, eine höhere ESG-Bewertung als das breitere Universum asiatischer Hochzinsanleihen an, das durch den Index repräsentiert wird.

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### Sustainable Asia High Yield (Fortsetzung)

Das Ziel einer geringeren CO<sub>2</sub>-Emissionsintensität soll dazu dienen, die langfristigen Ziele des Pariser Übereinkommens in Bezug auf die globale Erwärmung zu erreichen.

Darüber hinaus wird das Portfolio bedeutende Allokationen in festverzinsliche Wertpapiere mit Umwelt-, Sozial- und Nachhaltigkeitskennzeichnungen vornehmen und aufgrund dessen je nach Gelegenheiten am Markt ein höheres Engagement in solchen Wertpapieren als der Index aufweisen.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| Name der Anteilklasse                               | Auflegungsdatum der Anteilklasse | Währung |
|---|----------------------------------|---------|
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) <sup>1</sup> | 13. Dezember 2021                | USD     |
| Thesaurierende Klasse USD A <sup>1</sup>            | 13. Dezember 2021                | USD     |
| Thesaurierende Klasse USD I                         | 13. Dezember 2021                | USD     |
| Thesaurierende Klasse USD Z                         | 21. Januar 2022                  | USD     |
| Ausschüttende Klasse USD Z                          | 22. März 2022                    | USD     |

<sup>1</sup>Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

### Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency

Das Anlageziel des Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency (das „Portfolio“) ist es, über einen Marktzyklus (in der Regel 3 Jahre) die Benchmark (JPMorgan ESG EMBI Global Diversified Index [Total Return, USD]) vor Gebühren zu übertreffen, indem vorwiegend in auf Hartwährungen lautende Schuldtitel investiert wird, die in Schwellenländern begeben wurden und den nachhaltigen Anlagekriterien gerecht werden. (wie im Verkaufsprospekt definiert).

Um dieses Ziel zu erreichen, investiert das Portfolio vorwiegend in Schuldtitel und Geldmarktinstrumente, die von öffentlichen oder privaten Emittenten in Schwellenländern emittiert werden, die auf Hartwährungen lauten und mit dem Nachhaltigkeitsziel des Portfolios vereinbar sind. Als Hartwährungen im Sinne des Portfolios werden folgende Währungen definiert: US-Dollar, Euro, britisches Pfund, japanischer Yen und Schweizer Franken. Anleger sollten auch beachten, dass öffentliche Emittenten auch Unternehmen sein können, die direkt oder indirekt zu 100 % in staatlicher Hand sind.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| Name der Anteilklasse        | Auflegungsdatum der Anteilklasse | Währung |
|------------------------------|----------------------------------|---------|
| Thesaurierende Klasse EUR I3 | 26. September 2022               | EUR     |
| Thesaurierende Klasse EUR I4 | 13. April 2023                   | EUR     |
| Thesaurierende Klasse EUR X  | 19. Januar 2022                  | EUR     |
| Thesaurierende Klasse USD I  | 19. Januar 2022                  | USD     |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 27. Januar 2022                  | USD     |

### Tactical Macro

Das Anlageziel des Tactical Macro (das „Portfolio“) ist es, ungeachtet des Marktumfelds positive Erträge zu erzielen durch die Ermittlung von Missverhältnissen bei den Marktpreisen für ein breites Spektrum von Anlageklassen, Märkten und Regionen im Rahmen ausgeprägter Risikosteuerung.

Um dieses Ziel zu erreichen, werden wesentliche Aspekte des makroökonomischen Umfelds ermittelt, um auf der Grundlage der Analysen wesentlicher Aspekte des makroökonomischen Umfelds, die zur Auswahl von Anlagen herangezogen werden, ein Universum von Investmentthesen zu entwickeln.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| Name der Anteilklasse        | Auflegungsdatum der Anteilklasse | Währung |
|------------------------------|----------------------------------|---------|
| Thesaurierende Klasse EUR I5 | 22. Januar 2024                  | EUR     |
| Thesaurierende Klasse USD I  | 30. Juni 2023                    | USD     |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 30. Juni 2023                    | USD     |
| Thesaurierende Klasse USD Z  | 30. Juni 2023                    | USD     |

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### Uncorrelated Strategies

Das Anlageziel des Uncorrelated Strategies (das „Portfolio“) ist es, aus einem diversifizierten Portfolio unkorrelierter Anlagestrategien Kapitalzuwachs zu erzielen, wobei der Schwerpunkt auf der absoluten Rendite liegt.

Um sein Ziel zu erreichen, verteilt das Portfolio seine Vermögenswerte auf absolut diskretionäre Anlageberater, die verschiedene Anlagestrategien anwenden und weltweit ohne Schwerpunkt auf bestimmte Branchen investieren.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i> | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|------------------------------|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse CHF I  | 13. März 2018                           | CHF            |
| Thesaurierende Klasse EUR A  | 20. August 2018                         | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I  | 6. März 2018                            | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 | 6. Juli 2017                            | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR M  | 15. September 2017                      | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR P  | 5. Juli 2022                            | EUR            |
| Thesaurierende Klasse GBP I  | 30. Juni 2017                           | GBP            |
| Thesaurierende Klasse GBP I2 | 6. Juli 2017                            | GBP            |
| Ausschüttende Klasse GBP I2  | 30. August 2022                         | GBP            |
| Thesaurierende Klasse GBP I5 | 31. Mai 2017                            | GBP            |
| Thesaurierende Klasse GBP P  | 2. Oktober 2018                         | GBP            |
| Thesaurierende Klasse GBP Z  | 29. Juni 2017                           | GBP            |
| Thesaurierende Klasse JPY I  | 1. April 2022                           | JPY            |
| Thesaurierende Klasse SGD A  | 21. Dezember 2022                       | SGD            |
| Thesaurierende Klasse USD A  | 26. Januar 2018                         | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 6. März 2018                            | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I  | 31. Mai 2017                            | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 6. Juli 2017                            | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 31. Mai 2017                            | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD M  | 9. August 2017                          | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD P  | 12. Dezember 2018                       | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD Z  | 8. September 2017                       | USD            |

### US Equity

Das Anlageziel des US Equity (das „Portfolio“) ist es, langfristigen Kapitalzuwachs zu erzielen.

Um sein Ziel zu erreichen, investiert das Portfolio hauptsächlich in Long-Positionen in Dividendenpapiere und equity-linked (eigenkapitalbezogene) Wertpapiere, die an anerkannten Märkten in den USA notiert sind oder gehandelt werden. Das Portfolio kann auch, allerdings in geringerem Umfang, Long-Positionen in Aktien und eigenkapitalbezogenen Wertpapieren eingehen, die an anerkannten Märkten in Ländern notiert sind oder gehandelt werden, welche im MSCI All Country World Index vertreten sind (hierzu können auch Schwellenländer zählen).

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### US Equity (Fortsetzung)

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i>                           | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|--|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)  | 15. Juli 2024                           | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I5                           | 17. Juni 2024                           | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert) | 17. Juni 2024                           | EUR            |
| Ausschüttende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)  | 17. Juni 2024                           | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR X (nicht währungsgesichert)  | 5. März 2024                            | EUR            |
| Ausschüttende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)  | 17. Juni 2024                           | GBP            |
| Thesaurierende Klasse GBP X (nicht währungsgesichert)  | 5. März 2024                            | GBP            |
| Thesaurierende Klasse JPY I3                           | 1. März 2022                            | JPY            |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 27. März 2020                           | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 18. Dezember 2015                       | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD I                             | 18. Dezember 2015                       | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I5                           | 26. Februar 2024                        | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD I5                            | 17. Juni 2024                           | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD M                            | 9. Februar 2022                         | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD X                            | 5. März 2024                            | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD Z                            | 25. September 2024                      | USD            |

### US Equity Premium

Das Anlageziel des US Equity Premium (ehemals: „US Equity Index PutWrite“) (das „Portfolio“) ist die Erzielung von langfristigem Kapitalzuwachs und Erträgen.

Das Portfolio strebt sein Ziel vorwiegend mittels einer Strategie an, bei der besicherte Verkaufsoptionen auf globale Aktienindizes und börsengehandelte Fonds („ETFs“) verkauft werden, die ein Engagement an US-Aktienindizes wie dem S&P 500 und Russell 2000 bieten. Die Verkaufsoptionen werden an anerkannten Märkten gehandelt.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i>                           | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|--|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse EUR I                            | 13. Februar 2017                        | EUR            |
| Ausschüttende Klasse EUR I3                            | 3. Dezember 2021                        | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I4                           | 28. April 2017                          | EUR            |
| Ausschüttende Klasse EUR I4                            | 15. Dezember 2023                       | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR M                            | 13. Februar 2017                        | EUR            |
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)  | 2. März 2017                            | GBP            |
| Thesaurierende Klasse GBP I3                           | 11. Mai 2021                            | GBP            |
| Ausschüttende Klasse GBP I3                            | 3. Dezember 2021                        | GBP            |
| Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert)  | 21. Juni 2023                           | GBP            |
| Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) | 25. Oktober 2017                        | GBP            |
| Ausschüttende Klasse GBP I4                            | 29. November 2023                       | GBP            |
| Ausschüttende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)   | 25. August 2021                         | GBP            |

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### US Equity Premium (Fortsetzung)

| <i>Name der Anteilklasse</i>                          | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|---|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse GBP X (nicht währungsgesichert) | 26. Februar 2024                        | GBP            |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)                | 15. August 2017                         | SGD            |
| Thesaurierende Klasse USD A                           | 23. Januar 2017                         | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)                | 18. Mai 2017                            | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I                           | 30. Dezember 2016                       | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD I3                           | 3. Dezember 2021                        | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I4                          | 28. April 2017                          | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD M                           | 13. Februar 2017                        | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD Z                           | 10. Februar 2017                        | USD            |

### US Large Cap Value

Das Anlageziel des US Large Cap Value (das „Portfolio“) ist es, langfristigen Kapitalzuwachs zu erzielen.

Das Portfolio wird vorwiegend in Dividendenpapiere von Unternehmen mit großer Marktkapitalisierung (Large Caps) investieren, die ihren Hauptsitz in den USA haben oder den überwiegenden Teil ihrer Geschäftstätigkeit dort ausüben und an anerkannten Märkten in den USA notiert sind oder gehandelt werden. Die Anlagen des Portfolios in Unternehmen mit großer Marktkapitalisierung beschränken sich nicht auf bestimmte Sektoren oder Branchen.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i>                           | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|--|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse EUR A <sup>1</sup>               | 19. Oktober 2022                        | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)  | 21. Juni 2022                           | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I                            | 30. März 2022                           | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)  | 19. April 2022                          | EUR            |
| Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)  | 22. März 2022                           | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert) | 27. Januar 2022                         | EUR            |
| Thesaurierende Klasse GBP I                            | 22. November 2022                       | GBP            |
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)  | 22. November 2022                       | GBP            |
| Ausschüttende Klasse GBP I                             | 22. November 2022                       | GBP            |
| Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)   | 22. November 2022                       | GBP            |
| Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)  | 14. März 2022                           | GBP            |
| Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)  | 8. Juni 2022                            | GBP            |
| Ausschüttende Klasse GBP P                             | 21. Oktober 2022                        | GBP            |
| Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)  | 24. Mai 2022                            | GBP            |
| Ausschüttende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)   | 30. August 2022                         | GBP            |
| Thesaurierende Klasse USD A <sup>1</sup>               | 24. März 2022                           | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 20. Dezember 2021                       | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD I4                            | 21. März 2022                           | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I5                           | 11. Februar 2022                        | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD M                            | 25. März 2022                           | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD Y                            | 8. August 2023                          | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD Z                            | 23. Mai 2022                            | USD            |

<sup>1</sup>Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### US Long Short Equity

Das Anlageziel des US Long Short Equity (das „Portfolio“) ist es, langfristigen Kapitalzuwachs zu erzielen. Sekundäres Ziel ist der Kapitalerhalt.

Um dieses Ziel zu erreichen, wird das Portfolio Long- und synthetische Short-Positionen in Aktien und eigenkapitalbezogenen Wertpapieren, u. a. auch in börsennotierten Fonds („ETFs“), die an Aktienmärkten in den USA notiert sind oder gehandelt werden, eingehen. Das Portfolio kann auch, allerdings in geringerem Umfang, Long- und synthetische Short-Positionen in Aktien, eigenkapitalbezogenen Wertpapieren und ETFs eingehen, die an anerkannten Märkten in Ländern notiert sind oder gehandelt werden, welche im MSCI All Country World Index vertreten sind (hierzu können auch Schwellenländer zählen). Die Anlagen schließen generell Unternehmen aller Branchen mit einer Marktkapitalisierung von mindestens 250 Mio. USD zum Zeitpunkt der Erstanlage ein.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i>                           | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|--|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse EUR A                            | 6. Juli 2015                            | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I                            | 1. Dezember 2014                        | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I3                           | 13. Mai 2020                            | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert) | 20. Juni 2024                           | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR M                            | 4. Dezember 2015                        | EUR            |
| Ausschüttende Klasse GBP I3                            | 8. September 2020                       | GBP            |
| Thesaurierende Klasse SGD A1                           | 31. Oktober 2014                        | SGD            |
| Thesaurierende Klasse USD A (PF)                       | 10. Juni 2015                           | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 24. Februar 2015                        | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD A1                           | 3. April 2014                           | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD I (PF)                        | 13. März 2015                           | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 28. Februar 2014                        | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I3                           | 13. Mai 2020                            | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD M                            | 9. August 2017                          | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD U                            | 6. März 2015                            | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD Z                            | 15. Mai 2014                            | USD            |

### US Multi Cap Opportunities

Das Anlageziel des US Multi Cap Opportunities (das „Portfolio“) ist es, Kapitalzuwachs durch Auswahl von Anlagen auf Basis von systematischem, sequenziellem Research zu erzielen. Um dieses Ziel zu erreichen, wird Neuberger Berman Investment Advisers LLC (der „Sub-Investment-Manager“) durch systematisches, sequenzielles Research potenzielle Anlagen identifizieren. Die Auswahl der Anlagen ist das Ergebnis sowohl quantitativer als auch qualitativer Analysen im Bestreben, Unternehmen zu ermitteln, die das Potenzial für Wertsteigerungen haben. Dieses Potenzial kann auf vielerlei Weise realisiert werden, unter anderem durch: Generierung freier Cashflows, Produkt- oder Verfahrensverbesserungen, Margensteigerung und ein verbessertes Kapitalstrukturmanagement.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i>                          | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|---|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse AUD E                           | 2. Juli 2014                            | AUD            |
| Thesaurierende Klasse AUD T                           | 19. Dezember 2016                       | AUD            |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) | 12. Dezember 2024                       | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I3                          | 21. März 2013                           | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR M                           | 29. Januar 2016                         | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR1 A                          | 28. Juni 2012                           | EUR            |

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

| <i>Name der Anteilklasse</i>                          | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|---|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse EUR1 I                          | 28. Juni 2012                           | EUR            |
| Ausschüttende Klasse GBP I3                           | 20. Juni 2024                           | GBP            |
| Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert) | 6. November 2017                        | GBP            |
| Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) | 30. August 2024                         | GBP            |
| Thesaurierende Klasse SGD A <sup>1</sup>              | 16. Juli 2013                           | SGD            |
| Thesaurierende Klasse USD B                           | 22. November 2013                       | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD C1                          | 13. Oktober 2017                        | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD E                           | 2. Juli 2014                            | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I2                          | 24. Mai 2023                            | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I3                          | 29. April 2013                          | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD M                           | 18. Februar 2016                        | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD T                           | 22. November 2013                       | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD U                           | 22. Januar 2013                         | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD Z                           | 2. Mai 2014                             | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD1 A                          | 29. Juni 2012                           | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD1 I                          | 28. Juni 2012                           | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD1 I                           | 29. Juni 2012                           | USD            |
| Thesaurierende Klasse ZAR B                           | 13. Januar 2014                         | ZAR            |
| Thesaurierende Klasse ZAR E                           | 2. Juli 2014                            | ZAR            |
| Thesaurierende Klasse ZAR T                           | 13. Januar 2014                         | ZAR            |

<sup>1</sup>Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

### US Real Estate Securities

Das Anlageziel des US Real Estate Securities (das „Portfolio“) ist die Erzielung einer Gesamrendite (Total Return) insbesondere durch Kapitalzuwachs sowie aus laufenden Erträgen durch Anlagen in Immobilienwertpapieren. Um dieses Ziel zu erreichen, legt das Portfolio grundsätzlich in ein konzentriertes Portfolio von Wertpapieren (einschließlich Wandelanleihen) an, die von Immobilienaktiengesellschaften (Real Estate Investment Trusts („REITs“)) ausgegeben werden. Hierbei ist zu beachten, dass das Portfolio nicht direkt Immobilien erwirbt.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i>                        | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|---|---|----------------|
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) <sup>1</sup> | 8. August 2016                          | AUD            |
| Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich)              | 16. August 2016                         | AUD            |
| Thesaurierende Klasse AUD B                         | 19. August 2015                         | AUD            |
| Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)              | 16. August 2016                         | AUD            |
| Thesaurierende Klasse AUD E                         | 2. Juli 2014                            | AUD            |
| Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)              | 13. Oktober 2015                        | AUD            |
| Thesaurierende Klasse AUD T                         | 16. Juli 2013                           | AUD            |
| Thesaurierende Klasse CHF A                         | 11. Oktober 2012                        | CHF            |
| Thesaurierende Klasse EUR A <sup>1</sup>            | 1. Februar 2006                         | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I                         | 1. Februar 2006                         | EUR            |

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### US Real Estate Securities (Fortsetzung)

| <i>Name der Anteilklasse</i>                        | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|---|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse EUR M                         | 29. Januar 2016                         | EUR            |
| Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) <sup>1</sup> | 28. Juli 2016                           | HKD            |
| Thesaurierende Klasse SGD A <sup>1</sup>            | 28. Mai 2013                            | SGD            |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) <sup>1</sup> | 18. November 2015                       | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD A <sup>1</sup>            | 1. Februar 2006                         | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD A <sup>1</sup>             | 21. März 2012                           | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich)              | 15. August 2016                         | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD B                         | 16. Juli 2013                           | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD C1                        | 31. August 2017                         | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)              | 15. August 2016                         | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD E                         | 2. Juli 2014                            | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)              | 19. November 2019                       | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I                         | 1. Februar 2006                         | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD I                          | 14. Februar 2013                        | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I2                        | 5. Dezember 2012                        | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD M                         | 18. Februar 2016                        | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)              | 31. Dezember 2015                       | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD T                         | 16. Juli 2013                           | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD Z                         | 10. Februar 2015                        | USD            |
| Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)              | 16. August 2016                         | ZAR            |
| Thesaurierende Klasse ZAR B                         | 13. März 2015                           | ZAR            |
| Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)              | 16. August 2016                         | ZAR            |
| Thesaurierende Klasse ZAR E                         | 2. Juli 2014                            | ZAR            |
| Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)              | 11. Juni 2013                           | ZAR            |
| Thesaurierende Klasse ZAR T                         | 26. Juli 2013                           | ZAR            |

<sup>1</sup>Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

### US Small Cap

Das Anlageziel des **US Small Cap** (das „Portfolio“) ist das Erzielen von Kapitalzuwachs durch Auswahl von Anlagen mittels Analyse von Unternehmenskennzahlen und makroökonomischen Faktoren. Um dieses Ziel zu erreichen, wird das Portfolio vorwiegend in Dividendenpapiere von Unternehmen mit kleiner Marktkapitalisierung investieren, die ihren Hauptsitz in den USA haben oder den überwiegenden Teil ihrer Geschäftstätigkeit in den USA ausüben und an anerkannten Märkten notiert sind oder gehandelt werden.

Das Portfolio ist bestrebt, unterbewertete Unternehmen zu ermitteln, deren aktueller Marktanteil und Bilanzstatus stark sind und deren finanzielle Stärke größtenteils auf etablierten Geschäftsbereichen und nicht auf projiziertem Wachstum beruht.

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### US Small Cap (Fortsetzung)

Zu den Faktoren bei der Ermittlung dieser Unternehmen gehören:

- Überdurchschnittliche Erträge;
- eine etablierte Marktnische;
- Umstände, die neuen Wettbewerbern den Einstieg in den Markt erschweren;
- die Fähigkeit, ihr eigenes Wachstum zu finanzieren, und
- Solide zukünftige Geschäftsaussichten

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i>                                       | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|--|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse AUD B  | 25. Oktober 2019                        | AUD            |
| Thesaurierende Klasse AUD E  | 2. Juli 2014                            | AUD            |
| Thesaurierende Klasse AUD T  | 19. Dezember 2016                       | AUD            |
| Thesaurierende Klasse EUR A <sup>1</sup>                           | 28. Juni 2016                           | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert) <sup>1</sup> | 18. September 2020                      | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I  | 6. August 2013                          | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)              | 16. Oktober 2017                        | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert)             | 24. Januar 2019                         | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)             | 5. Mai 2022                             | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR M  | 4. Februar 2016                         | EUR            |
| Thesaurierende Klasse EUR Z  | 31. März 2016                           | EUR            |
| Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)              | 16. Oktober 2024                        | GBP            |
| Ausschüttende Klasse JPY I   | 29. Juli 2011                           | JPY            |
| Thesaurierende Klasse USD A <sup>1</sup>                           | 5. Juli 2011                            | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD A <sup>1</sup>                            | 28. November 2016                       | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD B  | 16. Juli 2013                           | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD E  | 2. Juli 2014                            | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I  | 1. Juli 2011                            | USD            |
| Ausschüttende Klasse USD I   | 10. Dezember 2013                       | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I3                                       | 30. Juli 2018                           | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD M  | 18. Februar 2016                        | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD T  | 16. Juli 2013                           | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD Z  | 30. August 2016                         | USD            |
| Thesaurierende Klasse ZAR E  | 8. August 2017                          | ZAR            |
| Thesaurierende Klasse ZAR T  | 19. Dezember 2016                       | ZAR            |

<sup>1</sup>Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

## Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

### US Small Cap Intrinsic Value

Das Anlageziel des US Small Cap Intrinsic Value (das „Portfolio“) ist es, langfristigen Kapitalzuwachs zu erzielen.

Um sein Ziel zu erreichen, wird das Portfolio vorwiegend in Dividendenpapiere von Unternehmen mit geringer Marktkapitalisierung (Small Caps) investieren, die ihren Hauptsitz in den USA haben oder den überwiegenden Teil ihrer Geschäftstätigkeit in den USA ausüben und an anerkannten Märkten in den USA notiert sind oder gehandelt werden. Die Anlagen des Portfolios in Unternehmen mit geringer Marktkapitalisierung beschränken sich nicht auf bestimmte Sektoren oder Branchen.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

| <i>Name der Anteilklasse</i>                           | <i>Auflegungsdatum der Anteilklasse</i> | <i>Währung</i> |
|--|---|----------------|
| Thesaurierende Klasse EUR I3                           | 5. Februar 2024                         | EUR            |
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)  | 9. März 2021                            | GBP            |
| Thesaurierende Klasse GBP I2 (nicht währungsgesichert) | 22. Oktober 2021                        | GBP            |
| Thesaurierende Klasse JPY I3 (nicht währungsgesichert) | 29. August 2023                         | JPY            |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 4. Februar 2016                         | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 30. April 2015                          | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I2                           | 16. März 2022                           | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD I3                           | 11. November 2024                       | USD            |
| Thesaurierende Klasse USD M                            | 27. Mai 2016                            | USD            |

## Bericht der Direktoren

Die Direktoren legen hiermit ihren Jahresbericht und den geprüften Jahresabschluss der Neuberger Berman Investment Funds plc (der „Fonds“) für das Geschäftsjahr zum Freitag, 31. Dezember 2024 sowie Vergleichszahlen für das Geschäftsjahr zum Donnerstag, 31. Dezember 2023 vor.

### Aufgaben der Direktoren

Die Direktoren sind verantwortlich für die Erstellung des Jahresberichts und des Jahresabschlusses gemäß geltendem irischen Recht und den in Irland allgemein anerkannten Bilanzierungsgrundsätzen, einschließlich der Financial Reporting Standards („FRS“) 102: „The financial reporting standard applicable in the UK and Republic of Ireland“, herausgegeben von Financial Reporting Council und veröffentlicht von den Chartered Accountants Ireland.

Gemäß irischem Recht dürfen die Direktoren den Abschluss nur genehmigen, wenn sie sich vergewissert haben, dass dieser ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild von den Aktiva, Passiva und von der Geschäftslage des Fonds am Ende des Geschäftsjahrs sowie von der Ertragslage des Fonds für das Geschäftsjahr vermittelt.

Bei der Erstellung dieses Abschlusses müssen die Direktoren:

- geeignete Bilanzierungsverfahren auswählen und diese konsequent anwenden;
- Beurteilungen und Schätzungen mit angemessener Sorgfalt und Vorsicht vornehmen;
- feststellen, ob der Abschluss gemäß den anwendbaren Bilanzierungsgrundsätzen aufgestellt wurde, und die angewandten Grundsätze nennen sowie wesentliche Abweichungen von diesen Grundsätzen offenlegen und in den Anmerkungen zum Jahresabschluss erläutern; und
- den Jahresabschluss nach dem Grundsatz der Fortführung der Geschäftstätigkeit des Fonds aufstellen, soweit dieser angenommenen Fortführung nichts entgegensteht.

Die Direktoren sind verantwortlich für eine angemessene Buchführung, die es in hinreichendem Maße ermöglicht:

- die Transaktionen des Fonds korrekt zu erfassen und zu erläutern;
- die Aktiva und Passiva sowie die Finanz- und Ertragslage des Fonds jederzeit mit angemessener Genauigkeit zu ermitteln; und
- sicherzustellen, dass der Jahresabschluss dem Financial Reporting Standard („FRS“) 102: „Der im Vereinigten Königreich und der Republik Irland anzuwendende Finanzberichterstattungsstandard“, den Vorschriften der Europäischen Gemeinschaften (Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren betreffend) von 2011, in der jeweils gültigen Fassung (die „OGAW-Vorschriften“), den im Companies Act von 2014 (in ihrer geltenden Fassung) und den Central Bank (Supervision and Enforcement) Act 2013 (Section 48(1)) (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2015 (die „OGAW-Vorschriften der Zentralbank“) entspricht, und diesen Jahresabschluss zu prüfen.

Die Direktoren sind auch für die Sicherung der Vermögenswerte des Fonds verantwortlich und somit auch für die Ergreifung angemessener Maßnahmen zur Vermeidung und Aufdeckung von Betrugsfällen und anderen Unregelmäßigkeiten.

Gemäß den OGAW-Vorschriften sind die Direktoren verpflichtet, die Vermögenswerte des Fonds bei einer Verwahrstelle in Verwahrung zu geben. In Erfüllung dieser Pflicht hat der Fonds die Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited (die „Verwahrstelle“) mit der Verwahrung der Vermögenswerte des Fonds beauftragt.

### Erklärung zu maßgeblichen Prüfungsinformationen

Die zum Datum dieses Berichts im Amt befindlichen Direktoren bestätigen, dass:

- soweit ihm/ihr bekannt, keine prüfungsrelevanten Informationen vorliegen, von denen der Wirtschaftsprüfer des Fonds keine Kenntnis hat; und
- er/sie alle Schritte ergriffen hat, die er/sie als Direktor ergreifen musste, um Kenntnisse von allen maßgeblichen Prüfinformationen zu erhalten und sicherzustellen, dass der Wirtschaftsprüfer des Fonds diese Informationen kennt.

### Entsprechenserklärung der Direktoren

Der Fonds verfolgt den Grundsatz, seine jeweiligen Verpflichtungen (wie im Companies Act von 2014 (in seiner geltenden Fassung) definiert) zu erfüllen. Wie gemäß Section 225(2) des Companies Act von 2014 (in seiner geltenden Fassung) gefordert, bestätigen die Direktoren, dass sie dafür Sorge tragen müssen, dass der Fonds seine jeweiligen Verpflichtungen erfüllt. Die Direktoren haben eine Entsprechenserklärung gemäß Definition in Section 225(3)(a) des Companies Act von 2014 (in seiner geltenden Fassung) sowie eine Compliance-Richtlinie aufgesetzt, die sich auf die Vorkehrungen und Strukturen bezieht, die vorhanden sind und nach Auffassung der Direktoren für die Sicherstellung konzipiert sind, dass der Fonds seine Verpflichtungen im Wesentlichen erfüllt. Bei der Erfüllung ihrer Aufgaben nach Section 225 vertrauten die Direktoren unter anderem auf von Dritten erbrachten Dienstleistungen, Beratungsleistungen und/oder Erklärungen, von denen die Direktoren überzeugt sind, dass sie über die erforderlichen Kenntnisse und Erfahrung verfügen, um sicherzustellen, dass der Fonds seine Verpflichtungen im Wesentlichen erfüllt.

## Bericht der Direktoren (Fortsetzung)

### Geschäftsbücher

Die Direktoren sind gemäß Section 281 des Companies Act von 2014 (in ihrer geltenden Fassung) für eine ordnungsgemäße Buchführung verantwortlich. Um dies zu erreichen, haben die Direktoren ein Dienstleistungsunternehmen, Brown Brothers Harriman Fund Administration Services (Ireland) Limited, zur Verwaltungsstelle ernannt (die „Verwaltungsstelle“). Die Bücher des Fonds werden am Sitz der Verwaltungsstelle, 30 Herbert Street, Dublin 2, geführt.

### Hauptgeschäftstätigkeit und Überblick über das Geschäft

Der Fonds ist ein Investmentfonds mit variablem Kapital, der am 11. Dezember 2000 als Aktiengesellschaft in Irland gegründet wurde. Der Fonds wurde von der Zentralbank als Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren gemäß den OGAW-Vorschriften genehmigt. Das Ziel des Fonds ist die gemeinsame Anlage von auf dem Kapitalmarkt aufgebrauchten Geldern in Wertpapieren und anderen liquiden finanziellen Vermögenswerten nach dem Grundsatz der Risikosteuerung gemäß den OGAW-Vorschriften.

Der Fonds ist als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Portfolios organisiert, in denen die Direktoren jeweils mit der vorherigen Genehmigung der Zentralbank verschiedene Serien von Anteilen auflegen können, die gesonderte Portfolios bilden. Die Vermögenswerte jedes Portfolios werden in Einklang mit den für das jeweilige Portfolio geltenden, im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ in diesem Jahresabschluss beschriebenen Anlagezielen angelegt. Jedes Portfolio trägt seine eigenen Verbindlichkeiten, und weder der Fonds noch die vom Fonds ernannten Dienstleistungsanbieter noch die Direktoren, Konkursverwalter, Prüfer oder Liquidatoren noch eine sonstige Person erhalten Zugriff auf die Vermögenswerte eines Portfolios zur Begleichung von Verbindlichkeiten eines anderen Portfolios.

Am 31. Dezember 2024 bestanden fünfzig Portfolios, die im Abschnitt Allgemeine Informationen dieses Jahresberichts aufgeführt sind.

### Ergebnisse für das Geschäftsjahr sowie Aktiva, Passiva und Geschäftslage zum 31. Dezember 2024

Ein detaillierter Jahresrückblick und ein Rückblick auf die Faktoren, die im abgelaufenen Jahr zur Performance beigetragen haben, sind in den Berichten des Investment-Managers enthalten. Details zu den Aktiva, Passiva und der Geschäftslage des Fonds und den Ergebnissen für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024 sind in der Bilanz und der Gewinn- und Verlustrechnung für jedes Portfolio enthalten.

### Direktoren

Die Namen und Nationalitäten der Personen, die zu irgendeinem Zeitpunkt im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024 als Direktoren fungierten, sind nachstehend aufgeführt:

|   |        |
|---|--------|
| Gráinne Alexander**                       | Irin   |
| Michelle Green*                           | Britin |
| Naomi Daly***                             | Irin   |
| Alex Duncan* (bis zum 26. November 2024)  | Brite  |
| Mary Brady* (ernannt zum 3. Februar 2025) | Irin   |

\*Nicht geschäftsführender Direktor

\*\*Unabhängiger, nicht geschäftsführender Direktor

\*\*\*Unabhängiger, nicht geschäftsführender Direktor und Vorsitzender

### Beteiligungen der Direktoren und des Secretary des Fonds

Zum 31. Dezember 2024 ist Michelle Green Direktorin des Fonds und ebenfalls Direktorin und Angestellte der Neuberger Berman Europe Limited („NBEL“), des Sub-Investment-Managers und der Vertriebsstelle des Fonds. Mary Brady wurde am 3. Februar 2025 zur Direktorin des Fonds ernannt. Gráinne Alexander und Mary Brady sind ebenfalls Direktorinnen von NBAML.

Weder die Direktoren noch der Secretary des Fonds noch deren Familienangehörige halten oder hielten am 31. Dezember 2024 oder während des Geschäftsjahres ein wirtschaftliches Eigentum am Fonds. (2023: null).

### Transaktionen unter Beteiligung von Direktoren

Im Berichtsjahr zum 31. Dezember 2024 gab es zu keinem Zeitpunkt Verträge oder Vereinbarungen von Bedeutung mit Bezug zum Geschäft des Fonds, an denen Direktoren oder der Secretary des Fonds im Sinne der Definition des Companies Act 2014 (in ihrer geltenden Fassung) beteiligt gewesen wären, mit Ausnahme der in Anmerkung 10 dieses Jahresabschlusses offengelegten.

### Verbundene Personen

In Übereinstimmung mit der OGAW-Vorschrift 43((1) der Zentralbank muss eine Transaktion, die vom Manager, von der Verwahrstelle, vom Anlageberater und/oder einem mit diesen Rechtsträgern verbundenem Unternehmen oder einer verbundenen Firmengruppe („verbundene Personen“) mit dem Fonds durchgeführt wird, zu normalen Marktbedingungen ausgehandelt werden. Diese Transaktionen müssen im besten Interesse der Anteilhaber des Fonds sein.

## Bericht der Direktoren (Fortsetzung)

### Transaktionen unter Beteiligung von Direktoren (Fortsetzung)

Die Direktoren des Fonds haben sich vergewissert, dass (i) (durch schriftliche Verfahrensanweisungen dokumentierte) Vorkehrungen getroffen wurden, mit denen sichergestellt wird, dass die oben beschriebenen Pflichten bei allen Transaktionen mit verbundenen Parteien erfüllt werden; und dass (ii) bei Transaktionen mit verbundenen Parteien, die im Berichtszeitraum getätigt wurden, diese Pflichten erfüllt wurden.

### Politische Spenden

Im zum 31. Dezember 2024 endenden Jahr wurden keine politischen Spenden geleistet (2023: null).

### Risikomanagementziele und -strategien

Jedes Portfolio ist gemäß den Anlagezielen und der Anlagepolitik für das Portfolio, die im Verkaufsprospekt im Detail beschrieben sind, investiert. Eine Anlage in den einzelnen Portfolios birgt gewisse Risiken, und insbesondere diejenigen, auf die in Anmerkung 12 der Anmerkungen zum Jahresabschluss Bezug genommen wird.

### Ausschüttungen und Einbehaltung

Die im Geschäftsjahr festgesetzten und ausgeschütteten Dividenden werden in der Gewinn- und Verlustrechnung als Finanzierungskosten ausgewiesen.

### Zukünftige Entwicklungen

Der Fonds wird sein im Bericht der Direktoren detailliert beschriebenes Anlageziel weiter verfolgen.

### Sonstige Sachverhalte

Im Verlauf von 2024 und 2025 unterlagen die Finanzmarktbedingungen, die sich auf den Fonds auswirkten, weiterhin erheblichen Fluktuationen der Marktvolatilität, insbesondere der Zinsen, der Wechselkurse, der Aktienkurse, der Rohstoffpreise, der Credit Spreads, der impliziten Volatilitäten und der Korrelationen zwischen Vermögenswerten. Wohlgermerkt zeichnete sich das Jahr 2024 durch eine beispiellose Zahl von Parlamentswahlen in Industrie- und Schwellenländern aus, was rund um diese Ereignisse und ihre Ergebnisse kurzfristig zusätzliche Volatilität ausgelöst haben könnte. Im bisherigen Jahresverlauf waren 2025 rasante Marktbewegungen in Bezug auf Aktienmärkte und Anleiherenditen zu verzeichnen, die auf die von der US-Regierung initiierten Handelskriege und Zölle zurückzuführen waren. Der Fonds überwacht die Marktbedingungen und potenzielle, damit verbundene Auswirkungen weiter aktiv. Die Politik der neuen US-Regierung in Bezug auf den Nahen Osten, die Ukraine/Russland und Zölle kann sich im weiteren Verlauf des Jahres 2025 weiter auf Rohstoffe, Aktienkurse und Marktvolatilität auswirken. Außerdem verfolgen wir auch aufmerksam Abweichungen bei der Geldpolitik zwischen den großen Währungsblöcken, da diese für die Anleihekurse und die Wechselkurse von Bedeutung sind. Das direkte Engagement des Fonds in Aktivitäten in Israel und in Russland/der Ukraine ist und bleibt unwesentlich.

### Prüfungsausschuss

Der Fonds hat einen Prüfungsausschuss gegründet. Gráinne Alexander, Naomi Daly und Mary Brady sind Direktorinnen des Fonds und gehören dem Prüfungsausschuss an. Bis zum 26. November 2024 gehörte Alex Duncan dem Prüfungsausschuss an. Zudem wurde am 17. August 2023 John M. McGovern, Angestellter der Neuberger Berman LLC, in den Prüfungsausschuss berufen.

### Wichtige Ereignisse während des Geschäftsjahres

Wesentliche Ereignisse während des Geschäftsjahres sind in Anmerkung 21 dieses Jahresabschlusses aufgeführt.

### Wesentliche Ereignisse seit dem Ende des Geschäftsjahres

Wesentliche Ereignisse seit dem Ende des Geschäftsjahres sind in Anmerkung 22 dieses Jahresabschlusses aufgeführt.

### Unabhängige Wirtschaftsprüfer

Die Direktoren haben die unabhängigen Wirtschaftsprüfer, Ernst & Young, Chartered Accountants, im Jahr 2000 zur Prüfung des Abschlusses für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2001 und darauf folgende Rechnungsperioden bestellt.

Die unabhängigen Wirtschaftsprüfer haben ihre Bereitschaft bekundet, auch weiterhin gemäß Section 383(2) des Companies Act von 2014 (in ihrer geltenden Fassung) im Amt zu bleiben.

### Corporate Governance

Der Fonds unterliegt den irischen Gesetzen in Gestalt des Companies Act von 2014 (in seiner geltenden Fassung) sowie den OGAW-Vorschriften. Der Fonds wendet neben den oben beschriebenen keine zusätzlichen Anforderungen an. Alle vom Fonds beauftragten Dienstleister unterliegen ihren eigenen Anforderungen an die Unternehmensführung (Corporate Governance).

## Bericht der Direktoren (Fortsetzung)

### Corporate Governance (Fortsetzung)

#### *Prozess der Finanzberichterstattung – Beschreibung der wichtigsten Merkmale*

Die Direktoren sind verantwortlich für die Einrichtung und Umsetzung geeigneter interner Kontroll- und Risikomanagementsysteme für den Fonds in Bezug auf den Prozess der Finanzberichterstattung. Solche Systeme dienen nicht dazu, das Risiko, dass der Fonds seine Finanzberichterstattungsziele nicht erreicht, zu eliminieren, sondern vielmehr dazu, dieses Risiko zu verwalten, und sie können nur eine angemessene, jedoch keine absolute Absicherung gegen wesentliche Falschdarstellungen oder Verluste bieten.

Die Direktoren haben Prozesse für die internen Kontroll- und Risikomanagementsysteme eingerichtet, um die effektive Überwachung des Prozesses der Finanzberichterstattung sicherzustellen. Hierfür wurde unter anderem die Verwaltungsstelle mit der Führung der Bücher der Gesellschaft unabhängig vom Manager und der Verwahrstelle beauftragt. Die Verwaltungsstelle ist gemäß den Bestimmungen des Verwaltungsvertrages verpflichtet, für den Fonds ordnungsgemäße Bücher und Aufzeichnungen zu führen. Hierzu nimmt die Verwaltungsstelle regelmäßige Abstimmungen ihrer Aufzeichnungen mit denen der Verwahrstelle vor. Die Verwaltungsstelle ist ferner vertraglich verpflichtet, einen den tatsächlichen Verhältnissen entsprechenden Jahresbericht und Jahresabschluss sowie einen Halbjahresbericht und einen ungeprüften verkürzten Halbjahresabschluss zur Prüfung und Genehmigung durch die Direktoren zu erstellen.

Die Direktoren evaluieren und erörtern nach Bedarf wesentliche Fragen der Rechnungslegung und Berichterstattung. Von Zeit zu Zeit prüfen und evaluieren die Direktoren auch die Rechnungslegungs- und Berichtsabläufe und überwachen und evaluieren die Leistung, Qualifikation und Unabhängigkeit der externen Wirtschaftsprüfer. Die Verwaltungsstelle hat die operative Verantwortung in Bezug auf ihre internen Kontrollen für den Prozess der Finanzberichterstattung und den Bericht der Verwaltungsstelle an die Direktoren.

#### *Risikobeurteilung*

Die Direktoren sind verantwortlich für die Beurteilung des Risikos von Unregelmäßigkeiten in der Finanzberichterstattung, die durch Betrug oder Irrtümer verursacht werden, und sie müssen sicherstellen, dass Prozesse vorhanden sind, mit denen interne und externe Faktoren, die möglicherweise Auswirkungen auf die Finanzberichterstattung haben können, frühzeitig identifiziert werden. Die Direktoren haben ferner Prozesse eingerichtet, mit denen Änderungen in den Rechnungslegungsbestimmungen identifiziert und Empfehlungen abgegeben werden, um sicherzustellen, dass diese Änderungen in den Abschlüssen des Fonds korrekt berücksichtigt werden.

Der Manager führt eingehende Überprüfungen der Jahresabschlüsse zwecks Sicherstellung durch, dass sämtliche Inhalte korrekt sind. Sollte eine Unstimmigkeit gefunden werden, würde der Manager dies den Direktoren auf der nächsten Sitzung der Direktoren melden, oder umgehend, wenn die Unstimmigkeit als wesentlich erachtet wird. Änderungen an Rechnungslegungsbestimmungen und -standards werden vom Manager und der Verwaltungsstelle der Gesellschaft überwacht, und alle Änderungen werden den Direktoren regelmäßig gemeldet.

Der Manager arbeitet mit der Verwaltungsstelle der Gesellschaft zusammen, damit sichergestellt wird, dass alle Änderungen an Rechnungslegungsbestimmungen und -standards rechtzeitig im Abschluss berücksichtigt werden. Der Manager steht auch in regelmäßigem Kontakt mit den Wirtschaftsprüfern der Gesellschaft.

#### *Kontrolltätigkeiten*

Die Verwaltungsstelle unterhält Kontrollstrukturen, um die Risiken der Finanzberichterstattung zu verwalten. Diese Kontrollstrukturen beinhalten eine geeignete Verteilung der Verantwortlichkeiten und spezifische Kontrolltätigkeiten, die dazu dienen, für jedes wesentliche Konto im Abschluss und die zugehörigen Anmerkungen im Jahresbericht des Fonds das Risiko wesentlicher Mängel in der Finanzberichterstattung aufzudecken bzw. solche zu verhindern. Beispiele für die von der Verwaltungsstelle ausgeübten Kontrolltätigkeiten sind analytische Prüfverfahren, Abstimmungen und automatische Kontrollen in IT-Systemen. Preise, die nicht von unabhängigen Quellen verfügbar sind, werden in der Regel vom Manager mit Hilfe von Methoden bewertet, welche die Direktoren nach Treu und Glauben dahingehend genehmigt haben, dass die aus ihnen resultierende Bewertung den Marktwert eines Wertpapiers widerspiegelt.

#### *Vielfalt*

Was die Vielfalt angeht, so hat der Fonds keine Mitarbeiter und die einzigen Personen, die direkt von ihm beschäftigt werden, sind die Direktoren und die bezeichneten Personen. Bei Vakanzen im Direktorium ist Ziel, sicherzustellen, dass das Direktorium diversifiziert ist und hinsichtlich Alter, Geschlecht, Rasse und Bildungs-/beruflichem Hintergrund eine angemessene Mischung aufweist. Gleichzeitig müssen alle Einzelpersonen die regulatorischen Anforderungen erfüllen und insgesamt eine Zusammensetzung mit den erforderlichen Erfahrungen und Kenntnissen aufweisen.

#### *Informationen und Kommunikation*

Die Politik des Fonds und die für die Finanzberichterstattung relevanten Anweisungen der Direktoren werden über geeignete Kanäle, wie z. B. E-Mail, Korrespondenz, Telefon und Meetings, aktualisiert und mitgeteilt, um sicherzustellen, dass alle Informationsanforderungen an die Finanzberichterstattung vollständig und korrekt erfüllt werden.

#### *Überwachung*

Die Direktoren erhalten regelmäßige Präsentationen und Prüfberichte von der Verwahrstelle, dem Manager und der Verwaltungsstelle. Die Direktoren wenden ferner einen jährlichen Prozess an, um sicherzustellen, dass geeignete Maßnahmen getroffen werden, damit die von den unabhängigen Wirtschaftsprüfern identifizierten Mängel und empfohlenen Maßnahmen berücksichtigt werden.

## Bericht der Direktoren (Fortsetzung)

### Corporate Governance (Fortsetzung)

#### *Kapitalstruktur*

Keine Person hat eine wesentliche direkte oder indirekte Beteiligung an Wertpapieren des Fonds. Keine Person hat irgendwelche Sonderkontrollrechte über das Anteilkapital des Fonds. Es bestehen keine Beschränkungen hinsichtlich der Stimmrechte. Bezüglich der Ernennung und Ablösung von Direktoren unterliegt der Fonds den Bestimmungen seiner Satzung, den irischen Gesetzen in Gestalt des Companies Act von 2014 (in der jeweils gültigen Fassung) sowie den OGAW-Vorschriften, wie auf Investmentfonds anwendbar. Die Satzung selbst kann durch Sonderbeschluss der Anteilhaber geändert werden.

#### *Befugnisse der Direktoren*

Die Direktoren sind verantwortlich für die Führung der Geschäfte des Fonds in Einklang mit der Satzung. Die Direktoren können bestimmte Funktionen an die Verwaltungsstelle und andere Parteien delegieren, vorbehaltlich der Überwachung und Anleitung durch die Direktoren. Die Direktoren haben dem Manager bestellt, um die Geschäfte der Gesellschaft auf Tagesbasis zu verwalten, und sie haben für diesen Zweck bestimmte Aufgaben und Befugnisse auf den Manager übertragen. Die Direktoren werden vom Manager regelmäßige Berichte erhalten, in denen unter anderem die Prüfung der Wertentwicklung der Gesellschaft und der Portfolios durch den Manager und eine Analyse der jeweiligen Anlageportfolios bereitgestellt werden. Darüber hinaus stellt der Manager alle sonstigen Informationen zur Verfügung, die den Direktoren von Zeit zu Zeit in angemessener Weise für die Zwecke solcher Sitzungen bereitzustellen sind. Die Direktoren haben die Verwahrstelle zur sicheren Verwahrung der Vermögenswerte der Gesellschaft ernannt. Dementsprechend ist keiner der Direktoren ein geschäftsführender Direktor.

Die Satzung sieht vor, dass die Direktoren alle Befugnisse der Gesellschaft ausüben können, Gelder aufzunehmen und die Gesellschaft, deren Eigentum oder Teile desselben zu beleihen oder zu belasten, und alle diese Befugnisse an den Manager delegieren können.

#### *Versammlungen der Anteilhaber*

Die Jahreshauptversammlung des Fonds wird in Irland abgehalten, normalerweise im Juni oder zu einem anderen Zeitpunkt, den die Direktoren festlegen können. Die Einberufungsmitteilung zur Jahreshauptversammlung, auf der der geprüfte Jahresabschluss des Fonds (zusammen mit dem Bericht der Direktoren und dem Bericht der Wirtschaftsprüfer des Fonds) vorgelegt wird, wird den Anteilhabern an ihre registrierte Adresse spätestens 21 Kalendertage vor dem für die Versammlung festgelegten Termin zugesandt. Weitere Hauptversammlungen können von Zeit zu Zeit durch die Direktoren in der nach irischem Recht vorgesehenen Weise einberufen werden.

Jeder Anteil verleiht dem Inhaber das Recht, an den Versammlungen des Fonds und des durch diese Anteile repräsentierten Portfolios teilzunehmen und dort seine Stimme abzugeben. Alle Abstimmungen erfolgen durch Abstimmung mit Stimmzetteln durch die persönlich oder durch Stimmrechtsvertreter auf der jeweiligen Anteilhaberversammlung anwesenden Anteilhaber oder durch einstimmigen schriftlichen Beschluss der Anteilhaber. Keine Anteilklasse verleiht ihrem Inhaber Vorzugs- oder Bezugsrechte oder irgendwelche Rechte auf Beteiligung an Gewinnen anderer Anteilklassen oder auf Stimmrechte, die sich ausschließlich auf andere Anteilklassen betreffende Angelegenheiten beziehen.

Jeglicher Beschluss zur Änderung der Klassenrechte der Anteile erfordert die Zustimmung von drei Vierteln der Anteilhaber, welche bei einer Hauptversammlung der Klasse vertreten bzw. anwesend sind bzw. ihre Stimme abgeben. Die beschlussfähige Mehrheit für eine zur Prüfung einer Änderung der Rechte einer Anteilklasse anberaumten Hauptversammlung besteht aus zwei oder mehr persönlich oder durch Stimmrechtsvertreter anwesende Personen, die ausgegebene Anteile dieser Klasse halten. Falls auf einer Versammlung keine beschlussfähige Mehrheit vorhanden ist und die Versammlung vertagt wird, beträgt die beschlussfähige Mehrheit für die vertagte Versammlung einen Anteilhaber, der persönlich oder durch einen Stimmrechtsvertreter anwesend ist.

Jeder Anteil mit Ausnahme der Zeichneranteile berechtigt den Anteilhaber zu einer gleichen (vorbehaltlich etwaiger Unterschiede in den für die unterschiedlichen Anteilklassen geltenden Gebühren und Kosten), verhältnismäßigen Beteiligung an den Gewinnen und dem Nettovermögen des Portfolios, in Bezug auf den diese Anteile ausgegeben wurden. Ausgenommen hiervon sind Gewinne, die bereits festgestellt wurden, bevor die betreffende Person Anteilhaber wurde.

Zeichneranteile berechtigen ihre Inhaber zur Teilnahme und Abstimmung auf allen Hauptversammlungen des Fonds, berechtigen die Inhaber jedoch nicht, am Gewinn oder am Nettovermögen des Fonds zu partizipieren, mit Ausnahme einer Kapitalrückzahlung im Falle einer Liquidation.

#### *Zusammensetzung und Tätigkeit der Direktoren und ihrer Ausschüsse*

Nach dem Rücktritt von Alex Duncan am 26. November 2024 bis zur Ernennung von Mary Brady am 3. Februar 2025 gab es drei Direktoren, bei denen es sich durchweg um nicht geschäftsführende Direktoren handelte. Michelle Green ist Direktorin und Angestellte der NBEL, des Sub-Investment-Managers und der Vertriebsstelle des Fonds. Gráinne Alexander und Mary Brady sind Direktorinnen von NBAMIL, dem Manager des Fonds. Die Satzung sieht keine Ablösung der Direktoren durch Rotation vor. Die Direktoren können jedoch von den Anteilhabern durch einfachen Mehrheitsbeschluss gemäß dem im Irish Companies Act von 2014 (in ihrer geltenden Fassung) festgelegten Verfahren abberufen werden. Die Direktoren kommen mindestens einmal pro Quartal zusammen. Abgesehen vom Prüfungsausschuss gibt es keine dauerhaft autorisierten Unterausschüsse der Direktoren.

Die Direktoren haben sich vergewissert, dass die Direktoren über ausreichend Zeit verfügen, um ihren Pflichten nachzukommen und den Direktoren ihre sonstigen Verpflichtungen schriftlich mitzuteilen, einschließlich Direktorenposten bei anderen Organismen für gemeinsame Anlagen und außerhalb von Fonds.

## Bericht der Direktoren (Fortsetzung)

### Corporate Governance (Fortsetzung)

*Unternehmensführungskodex (Corporate Governance Code) der Irish Funds*

Die Irish Funds („IF“) hat einen Unternehmensführungskodex (Corporate Governance Code, „IF Code“) herausgegeben, den irische zugelassene Organismen für gemeinsame Anlagen auf freiwilliger Basis übernehmen können. Es ist zu beachten, dass der IF Code bestehende Praktiken der Unternehmensführung widerspiegelt, die irischen zugelassenen Organismen für gemeinsame Anlagen auferlegt wurden, wie vorstehend angemerkt. Wird der IF Code auf freiwilliger Basis übernommen, kann darauf in den Offenlegungen im Bericht der Direktoren gemäß den Bestimmungen des Irish Companies Acts von 2014 (in der jeweils geltenden Fassung) verwiesen werden.

Mit Wirkung vom 1. Januar 2013 haben die Direktoren auf freiwilliger Basis den von der Irish Funds veröffentlichten Corporate Governance Code for Irish Domiciled Collective Investment Schemes als Unternehmensführungskodex des Fonds übernommen.

Im Namen der Direktoren

**Direktor:**  
**Naomi Daly**

**Direktor:**  
**Gráinne Alexander**

---

Datum: 16. April 2025

---

Datum: 16. April 2025

## Bericht der Verwahrstelle an die Anteilhaber

In unserer Eigenschaft als Verwahrstelle des Fonds haben wir das Geschäftsverhalten der Neuberger Berman Investment Funds plc (der „Fonds“) in dem am 31. Dezember 2024 geendeten Geschäftsjahr überprüft.

Dieser Bericht, einschließlich des Prüfvermerks, wurde ausschließlich für die Anteilhaber des Fonds als Gremium gemäß Teil 5 der Vorschriften der Europäischen Gemeinschaften (Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren betreffend) von 2011 in der jeweils gültigen Fassung (die „OGAW-Vorschriften“) und für keinen anderen Zweck erstellt. Mit diesem Prüfvermerk akzeptieren oder übernehmen wir keine Verantwortung für irgendeinen anderen Zweck oder gegenüber irgendeiner Person, der dieser Bericht vorgelegt wird.

### Aufgaben der Verwahrstelle

Unsere Aufgaben und Verantwortlichkeiten sind in Teil 5 der OGAW-Vorschriften umrissen. Eine dieser Aufgaben ist es, uns einen Überblick über die Geschäftstätigkeit des Fonds in jedem jährlichen Bilanzierungszeitraum zu verschaffen und den Anteilhabern darüber Bericht zu erstatten.

Unser Bericht muss angeben, ob nach unserer Meinung der Fonds in diesem Berichtszeitraum in Übereinstimmung mit den Bestimmungen der Gründungsurkunde und Satzung des Fonds sowie der OGAW-Vorschriften verwaltet wurde. Die Einhaltung dieser Bestimmungen obliegt dem Fonds. Sollte der Fonds diese nicht eingehalten haben, müssen wir als Verwahrstelle angeben, warum dies der Fall ist und die Maßnahmen erläutern, die wir zur Behebung der Situation ergriffen haben.

### Grundlage des Prüfvermerks der Verwahrstelle

Die Verwahrstelle führt die Prüfungen durch, die sie nach ihrem vernünftigen Ermessen für notwendig hält, um ihre wie in Teil 5 der OGAW-Vorschriften beschriebenen Pflichten erfüllen zu können und um sicherzustellen, dass der Fonds in jeder wesentlichen Hinsicht (i) gemäß den Beschränkungen seiner Anlage- und Kreditbefugnisse geführt wurde, die ihm durch die Bestimmungen seiner Gründungsdokumente und den entsprechenden Vorschriften auferlegt wurden, und (ii) auch ansonsten gemäß den Gründungsdokumenten des Fonds und den entsprechenden Vorschriften geführt wurde.

#### Prüfvermerk

Unserer Meinung nach ist der Fonds in diesem Geschäftsjahr in jeder wesentlichen Hinsicht:

- (i) gemäß den Beschränkungen, die die Gründungsurkunde, die Satzung, die OGAW-Vorschriften und die Central Bank (Supervision and Enforcement) Act 2013 (Section 48(1)) (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2019 (die „OGAW-Vorschriften der Zentralbank“) den Anlage- und Kreditbefugnissen des Fonds auferlegen, und
- (ii) auch sonst in Übereinstimmung mit den Bestimmungen der Gründungsurkunde und Satzung, der OGAW-Vorschriften und der OGAW-Vorschriften der Zentralbank verwaltet worden.

Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited  
30 Herbert Street  
Dublin 2  
Irland

Datum: 16. April 2025

# Bericht des unabhängigen Wirtschaftsprüfers an die Gesellschafter der Neuberger Berman Investment Funds Plc

## Bericht über die Prüfung des Jahresabschlusses

### Prüfvermerk

Wir haben den Jahresabschluss der Neuberger Berman Investment Funds Plc (der „Fonds“) für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr geprüft, der aus den Bilanzen, den Gewinn- und Verlustrechnungen, den Aufstellungen über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens und den Anmerkungen zum Jahresabschluss besteht, einschließlich der in Anmerkung 1 beschriebenen Grundsätze. Der bei der Aufstellung angewandte Rahmen für die Finanzberichterstattung umfasst irisches Recht und FRS 102, den im Vereinigten Königreich und der Republik Irland anzuwendenden Rechnungslegungsstandard, herausgegeben im Vereinigten Königreich vom Financial Reporting Council.

Unserer Meinung nach:

- vermittelt der Jahresabschluss ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild von den Aktiva und Passiva und von der Geschäftslage der Gesellschaft zum 31. Dezember 2024 und ihren Gewinnen für das dann beendete Geschäftsjahr;
- wurde dieser Jahresabschluss ordnungsgemäß im Einklang mit FRS 102: „The Financial Reporting Standard applicable in the UK and Republic of Ireland“ erstellt; und
- wurde dieser Jahresabschluss ordnungsgemäß in Einklang mit den Vorschriften des Companies Act von 2014, den Vorschriften der Europäischen Gemeinschaften (Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren betreffend) von 2011 und den Central Bank (Supervision and Enforcement Act) 2013 (Section 48(1)) (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations von 2019 erstellt.

### Grundlage für das Testat

Unsere Prüfung erfolgte gemäß den internationalen Prüfungsstandards (International Standards on Auditing (Ireland) (ISAs (Ireland))) und geltendem Recht. Unsere Aufgaben gemäß diesen Standards sind im Abschnitt Aufgaben des Wirtschaftsprüfers im Hinblick auf die Abschlussprüfung unseres Berichts ausführlicher beschrieben. Wir sind in Einklang mit den berufsethischen Anforderungen, die für unsere Abschlussprüfung in Irland maßgeblich sind, einschließlich des von der Irish Auditing and Accounting Supervisory Authority (IAASA) herausgegebenen Ethical Standard, von der Gesellschaft unabhängig und haben unsere sonstigen berufsethischen Obliegenheiten in Übereinstimmung mit diesen Anforderungen erfüllt.

Nach unserer Auffassung sind die erhaltenen Prüfungsnachweise als Grundlage für die Erteilung unseres Testats ausreichend und angemessen.

### Feststellungen zur Unternehmensfortführung

Im Rahmen der Abschlussprüfung haben wir festgestellt, dass die Bilanzierung auf der Grundlage der Unternehmensfortführung bei der Aufstellung des Abschlusses durch die Direktoren angemessen ist.

Auf der Grundlage unserer Prüfungshandlungen haben wir keine wesentlichen Unsicherheiten in Bezug auf Ereignisse oder Bedingungen festgestellt, die einzeln oder zusammen erhebliche Zweifel an der Fähigkeit der Gesellschaft wecken können, für einen Zeitraum von mindestens zwölf Monaten ab dem Datum der Freigabe des Jahresabschlusses die Unternehmensfortführung sicherzustellen.

Unsere Aufgaben und die Aufgaben der Direktoren im Zusammenhang mit der Unternehmensfortführung sind in den einschlägigen Abschnitten dieses Berichts beschrieben. Weil sich aber nicht alle künftigen Ereignisse oder Bedingungen vorhersagen lassen, ist diese Erklärung keine Garantie dafür, dass die Gesellschaft auch künftig zur Unternehmensfortführung in der Lage ist.

### Sonstige Informationen

Die Direktoren sind zuständig für die sonstigen Informationen. Zu den sonstigen Informationen gehören die neben dem im Jahresabschluss und unserem Bericht des Wirtschaftsprüfers im Jahresbericht enthaltenen Informationen. Unser Testat zum Jahresabschluss erstreckt sich nicht auf die sonstigen Informationen, und, soweit in unserem Bericht nicht ausdrücklich anders angegeben, geben wir diesbezüglich keinerlei Urteil mit Prüfungssicherheit ab.

## Bericht der unabhängigen Wirtschaftsprüfer an die Gesellschafter der Neuberger Berman Investment Funds Plc (Fortsetzung)

### Sonstige Informationen (Fortsetzung)

Es ist unsere Aufgabe, die sonstigen Informationen zu lesen und dabei abzuwägen, ob die sonstigen Informationen in wesentlichem Widerspruch zum Jahresabschluss oder unseren im Prüfungsverlauf erlangten Kenntnissen stehen oder anderweitig eine wesentliche Falschdarstellung zu enthalten scheinen. Stellen wir solche wesentlichen Widersprüche oder augenscheinlichen wesentlichen Falschdarstellungen fest, müssen wir ermitteln, ob es sich um eine wesentliche Falschdarstellung im Abschluss oder um eine wesentliche Falschdarstellung in den sonstigen Informationen handelt. Wenn wir auf der Grundlage unserer durchgeführten Arbeiten zu dem Schluss gelangen, dass diese sonstigen Informationen eine wesentliche Falschdarstellung enthalten, müssen wir diesen Sachverhalt melden.

Wir haben diesbezüglich keine Angaben zu machen.

### Vom Companies Act von 2014 vorgeschriebene Stellungnahmen zu sonstigen Sachverhalten

Ausschließlich auf der Grundlage der im Prüfungsverlauf durchgeführten Arbeiten geben wir an, dass unserer Auffassung nach:

- die im Bericht der Direktoren für den zum Ende des Geschäftsjahres erstellten Jahresabschluss enthaltenen Angaben mit dem Jahresabschluss übereinstimmen; und
- der Bericht der Direktoren gemäß den geltenden rechtlichen Verpflichtungen erstellt wurde.

Wir haben sämtliche Informationen und Erklärungen erhalten, die wir nach unserem besten Wissen und Gewissen für die Zwecke unserer Prüfung als notwendig erachten.

Die Geschäftsbücher des Fonds ließen unserer Auffassung nach jederzeit eine ordnungsgemäße Prüfung des Abschlusses zu und der Abschluss stimmt mit den Geschäftsbüchern überein.

### Angelegenheiten, über die wir im Ausnahmefall berichten müssen

Auf der Grundlage unserer im Verlauf der Prüfung erlangten Kenntnis und des Verständnisses des Fonds und seines Umfelds haben wir im Bericht der Direktoren keine wesentlichen Falschdarstellungen festgestellt.

Der Companies Act von 2014 schreibt vor, dass wir Ihnen mitteilen müssen, wenn unserer Auffassung nach von Section 305 bis 312 des Companies Act vorgeschriebene Informationen, die sich auf Angaben der Vergütung und Transaktionen von Direktoren beziehen, vom Fonds nicht erteilt wurden. Wir haben diesbezüglich keine Angaben zu machen.

### Jeweilige Aufgaben

#### Aufgaben der Direktoren im Hinblick auf den Jahresabschluss

Wie in der Beschreibung der Aufgaben der Direktoren auf Seite 35 ausführlicher erläutert, sind die Direktoren zuständig für die Aufstellung des Abschlusses gemäß dem geltenden Rahmen für die Finanzberichterstattung, der ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild vermittelt, und die von ihnen als notwendig erachteten internen Kontrollen, um eine Aufstellung des Jahresabschlusses ohne wesentliche Falschdarstellungen aufgrund von Betrug oder Irrtum zu ermöglichen.

Bei der Aufstellung des Abschlusses sind die Direktoren zuständig für die Beurteilung der Fähigkeit des Fonds zur Unternehmensfortführung und gegebenenfalls für die Angabe von Sachverhalten im Zusammenhang mit der Unternehmensfortführung und der Bilanzierung auf der Grundlage der Unternehmensfortführung, sofern das Management nicht entweder beabsichtigt, den Fonds zu liquidieren beziehungsweise den Betrieb einzustellen oder keine realistische Alternative dazu hat.

#### Aufgaben des Wirtschaftsprüfers im Hinblick auf die Abschlussprüfung

Unser Ziel ist, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob der Abschluss frei von wesentlichen Falschdarstellungen ist, gleich ob aufgrund von Betrug oder Irrtum, und einen Bericht des Wirtschaftsprüfers herauszugeben, der unser Testat enthält. Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Maß an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine gemäß ISAs (Irland) durchgeführte Abschlussprüfung bestehende wesentliche Falschdarstellungen in jedem Fall aufdeckt. Falschdarstellungen können aufgrund von Betrug oder Irrtum entstehen und gelten als wesentlich, wenn nach vernünftigem Ermessen davon auszugehen ist, dass sie einzeln oder in ihrer Gesamtheit die auf der Grundlage dieses Abschlusses getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Adressaten beeinflussen.

Ausführlicher beschrieben sind unsere Aufgaben im Hinblick auf die Abschlussprüfung auf der IAASA-Website unter:

[http://www.iaasa.ie/getmedia/b2389013-1cf6-458b-9b8f-a98202dc9c3a/Description\\_of\\_auditors\\_responsibilities\\_for\\_audit.pdf](http://www.iaasa.ie/getmedia/b2389013-1cf6-458b-9b8f-a98202dc9c3a/Description_of_auditors_responsibilities_for_audit.pdf).

Diese Beschreibung ist Bestandteil unseres Berichts des Wirtschaftsprüfers.

## Bericht der unabhängigen Wirtschaftsprüfer an die Gesellschafter der Neuberger Berman Investment Funds Plc (Fortsetzung)

### Jeweilige Aufgaben (Fortsetzung)

#### Der Zweck unserer Prüfungshandlungen und die Personen, gegenüber denen wir in der Verantwortung stehen

Unser Bericht wurde ausschließlich für die Gesellschafter des Fonds als Gremium gemäß Section 391 des Companies Act von 2014 erstellt. Wir haben unsere Abschlussprüfung so durchgeführt, dass wir den Gesellschaftern des Fonds diejenigen Sachverhalte mitteilen können, die ihnen in einem Wirtschaftsprüferbericht mitgeteilt werden müssen, nicht aber zu einem anderen Zweck. Soweit gesetzlich zulässig, akzeptieren bzw. übernehmen wir die Verantwortung für unsere Prüfung, diesen Bericht bzw. für die zum Ausdruck gebrachten Meinungen lediglich gegenüber dem Fonds und den Gesellschaftern des Fonds als Gremium.

Lisa Kealy  
für und im Auftrag von  
Ernst & Young Chartered Accountants and Statutory Audit Firm

Dublin

Datum: 23. April 2025

# Bericht der unabhängigen Wirtschaftsprüfer an die Direktoren der Neuberger Berman Investment Funds Plc

Die Direktoren  
Neuberger Berman Investment Funds plc

## Prüfvermerk

Wir haben den Jahresabschluss der Neuberger Berman Investment Funds Plc (der „Fonds“) geprüft, der aus der Bilanz einschließlich der Aufstellung des Wertpapierbestands zum 31. Dezember 2024, der zugehörigen Gewinn- und Verlustrechnung und Aufstellung über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens für das dann beendete Geschäftsjahr und den zugehörigen Anmerkungen besteht (zusammen als „Jahresabschluss“ bezeichnet).

Nach unserer Meinung stellt der Jahresabschluss in allen wesentlichen Aspekten die Bilanz des Fonds zum 31. Dezember 2024 und ihre Betriebsergebnisse sowie die Veränderungen ihres Nettovermögens gemäß den Bilanzierungsgrundsätzen, einschließlich FRS 102: „The financial reporting standard applicable in the UK and Republic of Ireland“ (in Irland allgemein anerkannte Bilanzierungsgrundsätze – irische GAAP), angemessen dar.

## Grundlage für das Testat

Wir haben den Jahresabschluss nach den allgemein in den USA anerkannten Prüfungsgrundsätzen (GAAS) geprüft. Unsere Aufgaben gemäß diesen Standards sind im Abschnitt „Aufgaben des Wirtschaftsprüfers im Hinblick auf die Abschlussprüfung“ unseres Berichts ausführlicher beschrieben. Wir sind verpflichtet, von dem Fonds unabhängig zu sein und unseren sonstigen ethischen Verpflichtungen gemäß den einschlägigen ethischen Anforderungen in Zusammenhang mit unserer Prüfung nachzukommen. Nach unserer Auffassung sind die erhaltenen Prüfungsnachweise als Grundlage für die Erteilung unseres Testats ausreichend und angemessen.

## Aufgaben des Managements im Hinblick auf den Jahresabschluss

Das Management ist verantwortlich für die Erstellung und angemessene Darstellung des Rechnungsabschlusses in Einklang mit den Bilanzierungsgrundsätzen, einschließlich FRS 102: „The financial reporting standard applicable in the UK and Republic of Ireland“ (in Irland allgemein anerkannte Bilanzierungsgrundsätze – irische GAAP), sowie die Entwicklung, Implementierung und Aufrechterhaltung interner Kontrollen, die für die Erstellung und angemessene Darstellung des Rechnungsabschlusses ohne wesentliche Falschdarstellungen aufgrund von Betrug oder Irrtum maßgeblich sind.

Bei der Erstellung des Jahresabschlusses obliegt es dem Management, zu beurteilen, ob Bedingungen oder Ereignisse vorliegen, die in ihrer Gesamtheit erhebliche Zweifel an der Fähigkeit des Fonds zur Unternehmensfortführung innerhalb eines Jahres nach dem Datum, an dem der Jahresabschluss zur Veröffentlichung verfügbar ist, aufkommen lassen.

## Aufgaben des Wirtschaftsprüfers im Hinblick auf die Abschlussprüfung

Unser Ziel ist es, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob der Abschluss frei von wesentlichen Falschdarstellungen ist, gleich ob aufgrund von Betrug oder Irrtum, und einen Bericht des Wirtschaftsprüfers herauszugeben, der unser Testat enthält. Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Maß an Sicherheit, aber keine absolute Sicherheit und somit keine Garantie dafür, dass eine gemäß GAAS durchgeführte Abschlussprüfung bestehende wesentliche Falschdarstellungen in jedem Fall aufdeckt. Das Risiko, dass eine wesentliche Falschdarstellung aufgrund von Betrug nicht aufgedeckt wird, ist höher als das Risiko der Aufdeckung einer wesentlichen Falschdarstellung aufgrund von Irrtum, da Betrug unter Umständen mit Absprachen, Fälschungen, absichtlichen Auslassungen, Fehldarstellungen oder der Umgehung interner Kontrollen einhergeht. Falschdarstellungen gelten als wesentlich, wenn in erheblichem Maße davon auszugehen ist, dass sie einzeln oder insgesamt das Urteil eines vernünftigen Nutzers bei Heranziehen des Jahresabschlusses beeinflussen würden.

Bei der Durchführung einer Prüfung in Übereinstimmung mit den GAAS gehen wir wie folgt vor:

- Exercise professional judgment and maintain professional skepticism throughout the audit. Wir treffen ein professionelles Urteil und wahren während der gesamten Prüfung eine professionelle Skepsis.
- Exercise professional judgment and maintain professional skepticism throughout the audit. Wir identifizieren und beurteilen die Risiken wesentlicher Falschdarstellungen im Jahresabschluss, sei es aufgrund von Betrug oder Irrtum, und planen und führen unsere Prüfungshandlungen dergestalt aus, damit diesen Risiken Rechnung getragen wird. Derlei Prüfungshandlungen erstrecken sich auf Stichproben der Nachweise für die Beträge und Angaben im Jahresabschluss.
- Wir erlangen ein Verständnis der prüfungsrelevanten internen Kontrollen, um die unter den gegebenen Umständen angemessenen Prüfungshandlungen festzulegen, nicht jedoch, um ein Testat über die Wirksamkeit des internen Kontrollsystems des Fonds abzugeben. Daher wird kein diesbezügliches Urteil abgegeben.
- Exercise professional judgment and maintain professional skepticism throughout the audit. Wir beurteilen die Angemessenheit der Bilanzierungsgrundsätze und der wesentlichen, seitens des Managements gemachten Schätzungen sowie die allgemeine Darstellung des Abschlusses.
- Exercise professional judgment and maintain professional skepticism throughout the audit. Wir schlussfolgern ob nach unserem Ermessen Bedingungen oder Ereignisse vorliegen, die in ihrer Gesamtheit erhebliche Zweifel an der Fähigkeit eines jeden Fonds zur Unternehmensfortführung während eines angemessenen Zeitraums aufkommen lassen.

Wir sind verpflichtet, den Governance-Verantwortlichen unter anderem den geplanten Umfang und den Zeitplan der Prüfung, wesentliche Feststellungen im Rahmen der Prüfung und bestimmte identifizierte Sachverhalte bezogen auf die interne Kontrolle mitzuteilen.

## Bericht der unabhängigen Wirtschaftsprüfer an die Direktoren der Neuberger Berman Investment Funds Plc (Fortsetzung)

### **Sonstige Informationen**

Das Management ist zuständig für die sonstigen Informationen. Zu den sonstigen Informationen gehören die im Jahresabschluss enthaltenen Informationen, aber nicht die Abschlüsse und der Bericht unseres Wirtschaftsprüfers hierüber. Unser Prüfungsurteil zu den Jahresabschlüssen erstreckt sich nicht auf die sonstigen Informationen, und wir geben hierzu keinerlei Prüfungsurteil oder irgendeine Form der Zusicherung ab.

Im Zusammenhang mit unserer Prüfung des Jahresabschlusses ist es unsere Aufgabe, die sonstigen Informationen zu lesen und abzuwägen, ob zwischen den sonstigen Informationen und dem Jahresabschluss ein wesentlicher Widerspruch besteht oder die sonstigen Informationen anderweitig eine wesentliche Falschdarstellung zu enthalten scheinen. Wenn wir auf der Grundlage der durchgeführten Arbeiten zu dem Schluss kommen, dass eine nicht richtiggestellte wesentliche Falschdarstellung der sonstigen Informationen vorliegt, sind wir verpflichtet, diese in unserem Bericht darzulegen.

Ernst & Young  
Dublin, Irland  
23. April 2025

## Asia Responsible Transition Bond – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2024 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 5,49 %. Der als Benchmark dienende JP Morgan Asia Credit Index (Total Return, USD) (der „Index“) verbuchte im selben Zeitraum 5,72 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Im Jahr 2024 lieferten asiatische Kreditanleihen erneut eine robuste positive Performance, die durch ein günstiges makroökonomisches Umfeld angetrieben wurde. Der Beginn des Lockerungszyklus der US-Notenbank, das robuste globale Wachstum und die starken Fundamentaldaten an den asiatischen Märkten, in Kombination mit der Unterstützung durch technische Faktoren, führten im Laufe des Jahres zu einer deutlichen Verengung der Kreditspreads. Mehrere Special Situations, beispielsweise die erfolgreiche Umstrukturierung der von der Regierung von Sri Lanka und von Vedanta begebenen Anleihen, trugen ebenfalls zu den Gesamtrenditen des Portfolios bei.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Aufgrund des stabilen Makro-Umfelds in Indien resultierte unsere Übergewichtung des Landes zu einer Outperformance der Allokation, die durch die starke Wertentwicklung von Vedanta-Anleihen noch verstärkt wurde.
  - Sri Lanka machte gute Fortschritte bei den Umstrukturierungsbemühungen, was sich positiv auf unsere Übergewichtung der Anleihen dieses Landes auswirkte.
  - Unsere Einzeltitelauswahl unter staatlichen und quasistaatlichen Emittenten Indonesiens und unsere übergewichteten Positionen in Anleihen von Medco Energi trugen positiv zu den relativen Renditen bei.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Outperformance pakistanischer Anleihen schmälerte die relative Performance, da wir bei diesen Papieren zu Beginn des Jahres untergewichtet waren.
  - Unsere übergewichtete Allokation von Anleihen von New World Development trug aufgrund von Liquiditätssorgen und Änderungen in der Unternehmensleitung ebenfalls negativ zur Performance bei.
  - Unsere Untergewichtung von Glücksspielunternehmen in Macau, die aufgrund der verantwortungsvollen und übergangsspezifischen Richtlinien des Fonds ausgeschlossen sind.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Indien bleibt auch weiterhin die größte übergewichtete Position des Portfolios in Bezug auf die Gewichtung einzelner Länder. In Indien ist das Portfolio weiterhin in den Bereichen Finanzen und Versorgungsunternehmen (erneuerbare Energien) übergewichtet.
- Das Portfolio hat sein Engagement im Verlauf des Berichtszeitraums u. a. in China, Hongkong und Pakistan schrittweise erhöht.
- Das Portfolio blieb auf den Philippinen aufgrund von hohen Bewertungen und in China aufgrund von strukturellen Wachstumsorgen untergewichtet.

Anleihen aus den asiatischen Schwellenländern sind weiterhin eine überzeugende Anlagegelegenheit, die durch die sich verbessernde Kreditqualität am gesamten Markt sowie durch den Rückenwind begrenzter Nettoemissionen und höherer Gesamtrenditen untermauert wird. Mit Blick auf das Jahr 2025 bleiben wir angesichts des schwachen Wachstums in China und der wahrscheinlich auf kurze Sicht zunehmenden geopolitischen/handelsbezogenen Unsicherheiten taktisch vorsichtig. Wir sind allerdings der Meinung, dass asiatische Unternehmen gut positioniert sind, um die kurzfristige Volatilität zu überstehen, und würden versuchen, die sich bietenden Gelegenheiten zu nutzen.

## China A-Share Equity – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2024 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse CNY I 3,81 %. Der als Benchmark dienende MSCI China A Onshore Index (Total Return Net, CNY) (der „Index“) verzeichnete im selben Zeitraum 14,85 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Der Markt für chinesische A-Aktien war volatil, mit sprunghaften Rückgängen und Erholungen von Anfang des Jahres bis September. Die Anleger begrüßten die umfassenden und koordinierten geldpolitischen Kurswechsel Ende September für mehrere Wochen, doch kehrte die Volatilität im vierten Quartal erneut an den Markt zurück.
- In den ersten drei Quartalen wuchs das BIP Chinas um 4,8 % und blieb damit hinter den Erwartungen zurück. Aufgrund der geldpolitischen Interventionen im September wurde jedoch erwartet, dass das angestrebte BIP von rund 5 % für das Gesamtjahr erreicht werden.
- Die Prognose des Verbraucherpreisindex deutete weiterhin nach unten, was auf eine geringe Kapazitätsauslastung und einen anhaltenden Deflationsdruck zurückzuführen ist. Die Nachfrage nach Immobilien ist deutlich zurückgegangen und das Konsumwachstum hat sich verlangsamt. Das makroökonomische Umfeld wurde durch externe Faktoren wie die US-Wahl weiter kompliziert. Die erneute Angst vor einem möglichen Zollkrieg trug zur Unsicherheit und zu den Herausforderungen für die chinesische Wirtschaft bei.
- Finanzwerte sowie die Sektoren Nicht-Basiskonsumgüter und Versorger schnitten 2024 überdurchschnittlich gut ab, während die Sektoren Gesundheitswesen, Basiskonsumgüter und Immobilien zurückblieben.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Aktienauswahl unter Industriewerten trug am meisten zu den relativen Renditen bei.
  - Eine Übergewichtung des Sektors Nicht-Basiskonsumgüter, insbesondere die Branchen Auto und Haushaltsgeräte, trug ebenfalls zur Wertentwicklung bei.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Das Portfolio verzeichnete in der zweiten Jahreshälfte eine Underperformance, da Sektoren wie KI, Halbleiter und Software unterrepräsentiert waren.
  - Eine Untergewichtung von Small Caps, die sich im vierten Quartal besser entwickelten.
  - Die Einzeltitelauswahl in den Bereichen IT, Finanzen und Werkstoffe sowie eine Übergewichtung von Basiskonsumgütern hatten ebenfalls einen negativen Effekt.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Wir strebten ein inländisches Wachstum über qualitativ hochwertige Unternehmen über das gesamte Marktkapitalisierungsspektrum hinweg an, darunter Quality Compounds – qualitativ hochwertige Unternehmen mit hoher Eigenkapitalrendite (ROE), die über einen stetigen Cashflow verfügen, sich durch eine solide Unternehmensführung auszeichnen und hauptsächlich in den Sektoren Konsumgüter und Gesundheitswesen tätig sind.
- Zudem konzentrierten wir uns auf Nutznießer des säkularen Wachstums (Secular Growth Beneficiaries). Dabei handelt es sich um Unternehmen, die von einem längerfristigen säkularen Inlandswachstum profitieren können, das durch die Regierungspolitik und Branchentrends unterstützt wird wie z. B. hochwertige erneuerbare Energien, Unterhaltungselektronik, KI und Robotik.

China scheint einen strukturellen, auf Wachstum ausgerichteten Wirtschaftswandel eingeleitet zu haben, der von der Inlandsnachfrage, von wertschöpfungsorientierten Exporten und fortschrittlichen Technologien getragen wird. Wir haben in dieser Übergangsphase einen doppelten Schwerpunkt. Zum einen sehen wir Chancen bei erstklassigen Unternehmen mit stabilen Cashflows und attraktiven Dividenden, insbesondere im Konsumgüter-, Rohstoff- und Finanzsektor. Zum anderen bieten sich Gelegenheiten bei qualitativ hochwertigen, wachstumsstarken Unternehmen, die von staatlicher Unterstützung profitieren, insbesondere in den Lieferketten für Elektrofahrzeuge und KI sowie in den Bereichen Unterhaltungselektronik und Biopharmazie.

## China Bond – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2024 betrug die Gesamrendite für Anteile der Ausschüttenden Klasse CNY I 3,68 %. Der als Benchmark dienende FTSE Chinese Government and Policy Bank Bond 0-1 Year Select Index (Total Return, CNY) (der „Index“) verbuchte im selben Zeitraum 2,15 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Der Nationale Volkskongress (NVK) hat das Wachstumsziel für 2024 unverändert bei „rund 5 %“ belassen. Die politischen Entscheidungsträger gaben jedoch nur wenige deutliche Signale. Die Daten zum Wohnungsmarkt blieben schwach und der Konsum verlangsamte sich weiter. Infolgedessen zeigten sich die politischen Entscheidungsträger zunehmend darum bemüht, proaktivere Makro-Strategien zur Unterstützung des Wachstumskurses der Wirtschaft umzusetzen, u. a. durch eine aggressivere Fiskal- und Geldpolitik.
- Angesichts des makroökonomischen Hintergrunds sind die Zinsen in China aufgrund von strukturellen Wachstumssorgen deutlich gestiegen. Trotz der starken Kursschwankungen engten sich die Kreditspreads nicht so stark ein, was zu ihrer Normalisierung führte.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Onshore-Unternehmensanleihen lieferten positive Beiträge, da Zinsen und Kreditspreads querbeet kräftig anstiegen.
  - Offshore-Unternehmensanleihen leisteten aufgrund des attraktiven Renditegefälles und der Spread-Verengung Positivbeiträge.
- Negativbeitrag zur relativen Rendite:
  - Unsere Onshore-Wandelanleihen sorgten aufgrund der schlechten Anlegerstimmung und der schwachen Performance an den Aktienmärkten für das größte Minus.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Im Laufe des Geschäftsjahres haben wir sowohl am vorderen als auch am hinteren Ende der Kurve die Duration erhöht, hauptsächlich bei Onshore-Zinsen.
- Während einer Phase mit sich ausweitenden Kreditspreads in der zweiten Jahreshälfte erhöhten wir unsere Allokation von Onshore-Kreditanleihen.
- Wir reduzierten unsere Positionen in Onshore-Wandelanleihen im Laufe des Jahres, da wir die makroökonomischen Aussichten weiterhin pessimistisch einstufen.
- Abgesehen von den knappen Onshore-Kreditspreads blieb das Zinsgefälle zwischen CNY und USD erheblich, woraus sich ein attraktives relatives Wertangebot chinesischer USD-Unternehmensanleihen ergab.

Traditionelle Antriebskräfte der Wirtschaft wie beispielsweise der Immobiliensektor sahen sich weiter mit Herausforderungen konfrontiert, und die, unserer Meinung nach, zunehmenden geopolitischen Spannungen erschweren das schleppende Wachstum zusätzlich. In naher Zukunft wird wahrscheinlich Asien und insbesondere China die Hauptlast der Handelszölle tragen, die von der neuen Trump-Regierung möglicherweise eingeführt werden könnten. In Verbindung mit Pekings Widerwillen, die Wirtschaft entscheidend anzukurbeln, könnte es zu einer zunehmenden Unsicherheit in Bezug auf Chinas Wachstumsprofil kommen.

## China Equity – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2024 betrug die Gesamterrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD 18,77 %. Der als Benchmark dienende MSCI China All Shares Index (Total Return Net, USD) (der „Index“) verzeichnete im selben Zeitraum 16,38 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamterrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die Aktienkurse in der Region Großchina blieben sowohl auf den Onshore- als auch auf den Offshore-Märkten volatil. Gegen Anfang 2024 kam es zu einer starken Korrektur, gefolgt von einer raschen Erholung, nachdem eine Reihe unterstützender Maßnahmen zur Stabilisierung des Immobilienmarktes und zur Stärkung des Anlegervertrauens eingeführt wurden.
- Die chinesischen Aktienmärkte erlebten Ende Mai dann erneut eine Korrektur, da Hochfrequenzdaten darauf hindeuteten, dass die wirtschaftliche Erholung nur schleppend vorankam. Die Wende in der politischen Haltung auf der obersten Führungsebene gegen Ende September führte jedoch zu einer starken Erholung, da die politischen Entscheidungsträger ihre Bemühungen um geld- und fiskalpolitische Anreize verstärkten.
- Während der Optimismus Mitte Oktober schnell nachließ, da die Anleger auf weitere Einzelheiten zu den Konjunkturmaßnahmen warteten, beendeten die Aktienmärkte in der Region Großchina das Jahr nach einer dreijährigen Korrektur mit positiven Gewinnen.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Vor allem die Sektoren Nicht-Basiskonsumgüter (Einzeltitelauswahl in den Bereichen Hotels, Restaurants und Freizeit sowie Gebrauchsgüter), Gesundheitswesen (Einzeltitelauswahl in der Biotechnologie) Kommunikationsdienste (Einzeltitelauswahl im Bereich interaktive Medien & Dienstleistungen) trugen zur Performance im Vergleich zum Index bei.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die größten Nachteile für die Performance im Vergleich zum Index ergaben sich durch Finanzwerte (deutliche Untergewichtung), Grundstoffe (deutliche Übergewichtung und die Titelauswahl in der Chemiebranche) und Industrie (Titelauswahl in der Luftfracht- & Logistikbranche).

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Portfolioengagement in Industriewerten stieg von 12,42 % auf 18,09 %, gefolgt von Finanzwerten, bei denen das Engagement von 6,80 % auf 12,38 % erhöht wurde.
- Das Portfolioengagement in Werkstoffen ging von 15,72 % auf 8,64 % zurück, gefolgt von Basiskonsumgütern, deren Gewichtung von 7,59 % auf 1,94 % fiel.

Unserer Ansicht nach wird das chinesische Wirtschaftswachstum weiterhin durch innenpolitische Anreize unterstützt werden. Die seit Ende September verfolgte Lockerungspolitik stellt eine grundlegende Änderung der Haltung der obersten Führungsspitze gegenüber den inländischen Wirtschaftsbedingungen dar. Dazu gehört auch die Akzeptanz der Herausforderungen, mit denen sich die chinesische Wirtschaft konfrontiert sieht, und von umfassenden Maßnahmen, wie diese in Zukunft am besten bewältigt werden können. Die jüngste zentrale wirtschaftliche Arbeitskonferenz (Central Economic Work Conference) Chinas deutete auf eine schrittweise größere Unterstützung des Konsums, eine schnellere Lösung der Problematik in Hinsicht auf den Wohnungsbestand und mehr Anstrengungen zur Förderung von Finanzreformen auf zentraler und lokaler Ebene hin. Zu diesem Zweck werden weitere Einzelheiten zu den Anreizen und eine deutlichere fiskalische Unterstützung voraussichtlich auf den jährlichen parlamentarischen „Zwei Sitzungen“ im März 2025 bekannt gegeben. Auf diesen Zusammenkünften geben die politischen Entscheidungsträger in der Regel mehr Einzelheiten zu den wirtschaftlichen Zielen und den Wachstumsaussichten bekannt. Die Aktienmärkte können zwar angesichts möglicher Zollerhöhungen und Sanktionsrisiken für China unter der neuen US-Regierung weiterhin volatil bleiben, doch denken wir, dass prozyklische Unterstützungsmaßnahmen die kurzfristigen Risiken für die Wirtschaft mildern können, sobald die Maßnahmen in Kraft treten. Dies wiederum sollte es den Unternehmen in unserem Portfolio ermöglichen, verbesserte Gewinnaussichten zu erzielen.

## Climate Innovation – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2024 betrug die Gesamterrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 4,12 %. Der als Benchmark dienende MSCI All Country World Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der Index) verbuchte im selben Zeitraum ein Plus von 17,49 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamterrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividenden erträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Im Jahr 2024 kam es am US-Sektor für saubere Energie zu einer Mischung aus Makro-Signalen, regulatorischen Veränderungen, geopolitischen Herausforderungen und sektorspezifischen Entwicklungen. Das Jahr begann mit einer positiven Dynamik, die durch politische Unterstützung wie die Aufhebung der Zölle auf Importe von Aluminium-Extrusion durch die Kommission für internationalen Handel der Vereinigten Staaten angeheizt wurde, was große Projekten in der Versorgung zugutekam. Die starken Gewinne einer Reihe von Unternehmen unterstrichen die Widerstandsfähigkeit des Sektors und seine Verpflichtung, die finanziellen Ziele zu erreichen.
- Technologische Fortschritte spielten dabei eine entscheidende Rolle, wobei Innovationen im Bereich der sauberen Technologien, wie z. B. Flüssigkeitskühlung und virtuelle Kraftwerke, den Optimismus des Marktes antrieben. Trotz der Herausforderungen durch mögliche politische Veränderungen in China und regulatorische Hürden für kleine modulare Reaktorkomplexe blieb der Sektor auf Wachstumskurs. Regulatorische Änderungen spielten ebenfalls eine wichtige Rolle: neue Emissionsstandards und Anreize für grüne Investitionen, neben einem Gesetzentwurf des US-Senats zur Straffung der Genehmigungsverfahren für Kernreaktoren und die Einführung von Steuergutschriften für Wasserstoff deuteten auf ein unterstützendes politisches Umfeld hin.
- Gegen Ende des Jahres zeichnete sich politische Unsicherheit ab, als der designierte US-Präsident Donald Trump seine Absicht bekundete, das Gesetz zur Reduzierung der Inflation (Inflation Reduction Act) aufzuheben, was möglicherweise Auswirkungen auf die Anreize für saubere Energie haben könnte. Wir denken, dass eine vollständige Aufhebung zwar unwahrscheinlich ist, es könnte aber zu Änderungen kommen, wie z. B. der schrittweise Abbau von Steuergutschriften für erneuerbare Energien oder die Senkung des Kreditbetrags. Langfristige Investitionen in erneuerbare Energien werden jedoch aller Voraussicht nach weiterhin zur Deckung der Stromnachfrage und zur Erreichung der CO<sub>2</sub>-Reduktionsziele beitragen.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Einzeltitelauswahl im Sektor Industrie.
  - Die Untergewichtung von Basiskonsumgütern, Energie und Gesundheitswesen gegenüber dem Index.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Einzeltitelauswahl im IT-Sektor.
  - Die Übergewichtung der Sektoren Industrie und Werkstoffe gegenüber dem Index.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- In Unternehmen in verschiedenen Branchen, darunter erneuerbare Energien, Industrie und Schwerindustrie, wurden Positionen aufgestockt und neu eingeführt. Der Fokus lag zum einen auf Unternehmen, die technologische Innovationen liefern, und zum anderen auf Unternehmen, von denen wir glaubten, dass sie von der Bodenbildung im Zyklus der Industrie-/Autobranche profitieren würden, mit dem Ziel, an einem breit angelegten Wachstum zu partizipieren, das regulatorisch unterstützt wird.
- Positionen in Unternehmen, bei denen das relative Risiko-Ertrags-Verhältnis als ungünstig erachtet wurde oder bei denen marktspezifische oder sektorale Probleme fortbestanden, wurden aufgelöst.

Wir betrachten dies weiterhin als einen kritischen Wegbereiter der globalen Dekarbonisierung, wobei das Zusammenspiel von politischen Maßnahmen, gesellschaftlichen Vorstellungen und technologischen Möglichkeiten wesentliche Investitionsmöglichkeiten anspricht. In vielen Branchen entscheiden erfolgreiche Technologien und kommerzielle Differenzierung, welche Unternehmen florieren und welche auf der Strecke bleiben werden. Dieses Portfolio zielt darauf ab, in die weltweit führenden Unternehmen im Bereich der Dekarbonisierung zu investieren, und zwar entlang der gesamten technologischen Reifekurve.

## CLO Income – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2024 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 17,40 %. Der ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (der Index) rentierte im selben Zeitraum 5,47 %. (Die Performance für alle Anteilsklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die Spreads für qualitativ hochwertige Collateralised Loan Obligations (CLO) mit BB-Rating begannen das Jahr 2024 im Kontext des SOFR-Satzes (Secured Overnight Financing Rate) auf +675 Basispunkten (Bp), da der Markt sich auf ein Wirtschaftsszenario mit einer „sanften Landung“ zubewegte.
- Aufgrund der geringeren Spreads von CLO-Schuldtiteln sanken die CLO-Haftungskosten, sodass das Volumen von CLO-Neuemissionen zu Beginn des Jahres zunahm. Das Tempo der Neuemissionen begrenzte zunächst die schrittweise Verengung der Spreads bis Februar, doch blieben die Spreads von CLO-BB-Schuldtiteln im Bereich von SOFR 650 Bp im Allgemeinen stabil.
- Im Verlauf des Juli, als die US-amerikanischen Wirtschaftsdaten auf eine geringere Wahrscheinlichkeit für kurzfristige Zinssenkungen durch die US-Notenbank (Fed) hindeuteten, konzentrierten sich die auf Festanlagen spezialisierten Anleger zunehmend auf variabel verzinsliche Produkte, darunter auch CLO-Schuldtitel, was zu einer zusätzlichen Verengung der Spreads führte, da die erhebliche Nachfrage das Rekordtempo der Brutto-CLO-Emissionen mehr als ausglich. Zum Juli waren die Spreads für CLO-BB-Schuldtitel in den Bereich von SOFR 540 Bp gefallen.
- Anfang August weiteten sich die Spreads von CLO-Schuldtiteln aus, nachdem der Bericht über die Beschäftigtenzahlen außerhalb der Landwirtschaft in den Vereinigten Staaten unerwartet schwach ausgefallen war, was zunehmende wirtschaftliche Bedenken auslöste und den Fokus auf das Tempo der Zinssenkungen durch die Fed lenkte. CLO-BBs sanken im Fahrwasser des schwächeren Berichts zunächst um etwa zwei Punkte, näherten sich aber bis September schnell wieder dem Niveau an, das sie gegen Ende Juli hatten.
- Anschließend verengten sich die Spreads von CLO-Schuldtiteln bis zum Jahresende, was durch die Wahlen in den Vereinigten Staaten noch verschärft wurde, denn es wurde von der neuen Regierung die Einführung von Maßnahmen erwartet, die das inländische Wachstum beschleunigen könnten. In der Folge wandten sich die Investoren variabel verzinslichen Produkten wie CLO-Schuldtiteln zu. Bis zum Jahresende verengten sich die Spreads von CLO-BB-Papieren auf den Bereich von SOFR 480 Bp.
- Im Jahr 2024 belief sich das Neuemissionsvolumen von USD-CLO auf 164 Mrd. USD – ein Jahresrekord. CLO-Neuemissionen wurden durch die erhebliche Verengung der Spreads von CLO-Schuldtiteln im Jahresverlauf unterstützt.
- Die nennwertgewichtete Ausfallquote für die vorhergehenden zwölf Monate für den Morningstar LSTA US Leveraged Loan Index lag zum Jahresende bei 0,91 % und damit 62 Bp unter dem Vorjahreswert.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Einzeltitelauswahl auf dem Markt für die auf USD lautende Mezzanine-Tranche des CLO-Marktes.
  - Allokation in auf Euro lautende CLOs mit B-Rating.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Allokation auf den USD-Hochzinsmarkt.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Die Nettomittelzuflüsse im Laufe des Jahres wurden in einer Mischung aus CLO BBBs, BBs und Bs in USD und EUR auf den Primär- und Sekundärmärkten investiert.
- Das Engagement des Portfolios ist mit 46 % der CLO-Bestände in USD CLOs und 54 % in EUR CLOs ausgewogen.

In Bezug auf den relativen Wert im Vergleich zu hochverzinslichen Papieren lagen die Spreads von CLO-BB-Papieren im Jahr 2024 nahe dem langfristigen historischen Durchschnitt im Vergleich zu hochverzinslichen OAS mit einer Spread-Basis von etwa 340 Bp.

## Commodities – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2024 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 6,30 %. Im selben Zeitraum betrug die Rendite des Bloomberg Commodity Index (der Index) 5,38 %. (Die Performance für alle Anteilsklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- US-Aktien legten 2024 zu, unterstützt durch das starke Wachstum von Large-Cap-Technologiewerten. Die entscheidende US-Präsidentschaftswahl beflügelte die Aktien bis zum Jahresende. Die Anleger sind optimistisch, dass Trumps Politik das Wachstum ankurbeln wird.
- Die US-Notenbank (Fed) senkte die Zinssätze im Laufe des Jahres um 75 Basispunkte (Bp), doch hat sie die Anzahl der für 2025 erwarteten Zinssenkungen aufgrund der anhaltend hohen Inflation reduziert.
- Der Bloomberg US Aggregate Bond Index stieg um 1,25 % und der Index um 5,38 %.
- Edelmetalle, weiche Rohstoffe und Nutztiere erholten sich, während Energie, Industriemetalle und Agrarrohstoffe nahezu stagnierten.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Übergewichtung von Kakao, wo Preissteigerungen verzeichnet wurden. Kakao ist ein knapper Rohstoff, da jahrelang nicht ausreichend in Bäume investiert wurde, was mit Produktionsausfällen durch das Wetter und Krankheiten einherging. Die Nachfrage blieb allerdings trotz Preissprüngen stark.
  - Die Untergewichtung von Erdgas trug positiv zur Wertentwicklung bei, da die Preise fielen. Dieser Rückgang ist auf eine hochgefahrte Produktion aufgrund der zuvor hohen Preise und normale Wetterbedingungen ohne signifikante Hitzewellen oder Hurrikane zurückzuführen.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Untergewichtung von Kaffee war ein negativer Performancefaktor, da die Preise stiegen. Sie legten aufgrund schlechter Erntebedingungen in Brasilien und Vietnam zu, und zwar auf den höchsten Stand seit 1977. Die Verknappung des günstigeren Robusta-Kaffees hat sich auf die von uns gehandelte Arabica-Sorte ausgeweitet.
  - Die Untergewichtung von Silber bei steigenden Preisen. Unsere Strategie investiert aufgrund der Illiquidität und Volatilität von Silber, die nicht mit unseren Zielen übereinstimmen, nur geringfügig in Silber. Aufgrund seiner Stabilität, geopolitischen Sensibilität und Liquidität bevorzugen wir zur Vermögenserhaltung Investitionen in Gold.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

Im Jahr 2024 navigierte die Rohstoffstrategie durch ein Umfeld, das von mehreren neuen Risiken geprägt war, die Herausforderungen mit sich brachten aber auch Chancen auf den Rohstoffmärkten boten:

- Sektorallokation: Wir hatten Kaffee untergewichtet und das Engagement verringert, während der Kaffeepreis auf den höchsten Stand seit 1977 kletterte. Das Risiko wurde auf Kakao (außerhalb der Benchmark) umgeschichtet, was den größten Beitrag zu den Renditen leisten sollte. Sojaöl wurde von uns übergewichtet und das Engagement erhöht, während Sojamehl und Platinoide (PGM) aufgrund von Trend- und Bewertungsfaktoren die Performance schmälerten. Darüber hinaus waren wir im Rinder-Segment und im Energiesektor übergewichtet (getrieben von den Faktoren Trend, Carry und Bewertung) und in Erdgas, Sojabohnen und Weizen untergewichtet, was sich als vorteilhaft herausstellen sollte.
- Die Kurvenpositionierung: Wetten auf Positionierungen mit längeren Laufzeiten in der Landwirtschaft waren vorteilhaft. Die Positionen bei Gas- und Heizöl waren für die meisten Wertabzüge verantwortlich.
- Häufige Neugewichtungen führten zu einem leichten Wertverlust, da sich die Umverteilung des Risikos zu Platinoiden als nachteilig erwies.

In einer Ära Trump 2.0 und inmitten makroökonomischer Veränderungen werden Rohstoffe voraussichtlich profitieren. Nicht ausreichende Investitionen haben die Lieferketten anfällig gemacht, wie sich in den reduzierten Ölreserven und der Knappheit beim Abbau von grünem Metall und der Ölraffination manifestierte. Die steigende weltweite Nachfrage, der Energiebedarf durch KI und die geopolitische Unsicherheit stärken Rohstoffe als ein strategisches Absicherungsinstrument. Die Inflation erhöht die Attraktivität von Rohstoffen und macht sie zu einer proaktiven Strategie für die Diversifizierung, die erhebliche Renditequellen erschließt und den zukünftigen Erfolg im Jahr 2025 und darüber hinaus fördert.

## Corporate Hybrid Bond – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2024 betrug die Gesamterrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse EUR I 9,03 %. Der als Benchmark dienende ICE BofA Global Hybrid Non-Financial 5 % Constrained Custom Index (Total Return, Hedged, Euro) (der Index) verbuchte im selben Zeitraum ein Plus von 10,29 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamterrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die Marktbewegungen im Jahr 2024 wurden in erster Linie durch weiterhin über den Erwartungen liegende Wirtschaftsdaten (insbesondere in den Vereinigten Staaten), uneinheitliche Inflationszahlen, wobei die Vereinigten Staaten und Großbritannien nicht mit dem Fortschritt in Europa mithalten können, neue Regierungen in Großbritannien und den Vereinigten Staaten und anhaltende geopolitische Spannungen zwischen Russland und der Ukraine sowie in Gaza bestimmt.
- Risikoanlagen entwickelten sich 2024 an den Märkten für festverzinsliche Wertpapiere stark, wobei europäische Hochzinsanleihen am besten abschnitten, während globale Investment-Grade-Anleihen und Anleihen aus Schwellenmärkten (EM) ebenfalls positive Renditen verbuchten.
- Die Hybridmärkte entwickelten sich im Laufe des Jahres stark: sie übertrafen die Investment-Grade-Märkte und erzielten ähnliche Renditen wie europäische Hochzinsanleihen.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Wertpapierauswahl trug mit 54 Basispunkten (Bp) am meisten zu den relativen Renditen bei. Heimstadn Bostad war in diesem Zusammenhang sowohl bei den absoluten (205 Bp) als auch bei den relativen Renditen (216 Bp) der Top-Performer. Telekommunikationsunternehmen wie British Telecom und Vodafone sowie Energieunternehmen wie Enbridge und APA Infrastructure (ein relativ neuer Emittent, den wir auf dem Primärmarkt erworben haben) leisteten aus Sicht der Wertpapierauswahl alle einen wesentlichen Beitrag zur Performance.
  - Unser Schwerpunkt lag langfristig weiterhin auf der Bottom-up-Titelauswahl von Krediten, ein Ansatz, der die Performance zusätzlich verbessert.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Der größte Negativfaktor für die relativen Renditen war mit -79 Bp die Sektorallokation. Dabei war fast unsere gesamte Underperformance auf unsere Untergewichtung im Immobiliensektor (-87 Bp) zurückzuführen. Auf Sektorebene blieben wir angesichts in unseren Augen schwierigen Fundamentaldaten im Immobiliensektor vorsichtig. Während der Markt auf Makro-Signale reagierte und angesichts der jüngsten Zinssenkungen Immobilienanleihen kaufte, haben wir unseren Fokus weiterhin auf eine mehr umfassende Betrachtung des Kreditmarktes konzentriert.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Im Laufe des Jahres haben wir bei der Strategie das Risiko gesenkt, da wir einen größeren relativen Wert in defensiven Emittenten und Emissionen gesehen haben (hauptsächlich durch kürzere Call-Instrumente).
- Wir behielten Übergewichtungen von Versorgern und bei Telekommunikation aufrecht und reduzierten unsere Short-Positionen im Energiesektor. Wir bleiben in diesem Bereich jedoch weiterhin selektiv.
- Der Primärmarkt kletterte auf Rekordhöhen und übertraf die Werte von 2023 erheblich, was wir im Laufe des Jahres häufig nutzten, um entweder a) neue Emissionen in das Portfolio und/oder den Hybridmarkt aufzunehmen oder b) bestehende Emittenten aus dem Primärmarkt zu günstigen Preisen im Portfolio aufzustocken.

Für das Jahr 2025 erwarten wir, dass die Kreditmärkte trotz sinkender Wachstumsaussichten in den Vereinigten Staaten und Europa relativ intakt bleiben werden, was sich in den engen Spreads zum Jahresende widerspiegelt. In diesem Zusammenhang sollten die Emittenten von Investment-Grade-Hybridanleihen in unserem Anlageuniversum besonders gut positioniert sein, unterstützt durch (a) ihre hohe Kreditqualität und (b) ihren vorrangig defensiven, nicht zyklischen Charakter (wobei Versorgungs- und Telekommunikationsunternehmen beispielsweise etwa 60 % des Universums ausmachen). Darüber hinaus wollen wir uns zum einen weiterhin auf die Auswahl der besten Kredite konzentrieren, die für das aktuelle Marktumfeld gut positioniert sind, und zum anderen von den Emissionen am Primärmarkt profitieren, während wir das Portfolio innerhalb eines soliden Risikomanagementrahmens verwalten.

## Developed Market FMP – 2027 – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2024 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD 15,10 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Als sich die Inflation der Zielmarke der US-Notenbank (Fed) von 2 % annäherte, wurde der Zinserhöhungszyklus bis September unterbrochen, als die Fed die Zinsen um 50 Basispunkte (Bp) senkte. Im November und Dezember senkte die Fed die Zinsen dann um jeweils 25 Bp. Andere große Zentralbanken senkten die Leitzinsen 2024 ebenfalls, da sich das Wachstum verlangsamte und die Inflation zurückging.
- Im Laufe des Jahres und insbesondere im vierten Quartal kam es vereinzelt zu Zins- und Marktvolatilität. Als die Fed im Dezember eine aggressive Zinssenkung vornahm und der zukünftige politische Kurswechsel der neuen Trump-Regierung für Unsicherheit sorgte, preiste der Markt zunehmend abgeschwächte zukünftige Zinssenkungen ein und die Renditen auf Papiere der US-Regierung stiegen im letzten Monat des Jahres über die gesamte Kurve hinweg an. Im Gesamtjahr stiegen auch die Renditen auf 10-jährige Staatsanleihen der Industrieländer auf breiter Front an.
- Die Kreditspreads verengten sich im Berichtszeitraum in allen Segmenten, was auf eine besser als erwartete Wirtschaftsleistung, stabile Fundamentaldaten und eine stetige Nachfrage nach Krediten zurückzuführen ist. Die Kreditspreads von US-Anleihen mit Investment Grade, US-Hochzinsanleihen und variabel verzinsliche US-Darlehen engten sich um 19 Bp, 47 Bp bzw. 66 Bp ein. Die globalen aggregierten Spreads von Unternehmensanleihen engten sich ebenfalls um 26 Bp ein.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur Rendite:
  - Die Engagements des Portfolios in Investment-Grade- und Hochzins-Unternehmensanleihen lieferten eine breit angelegte Performance.
- Negativbeiträge zur Rendite:
  - Aus Sicht des Anleihe-sektors gab es keine wesentlichen Negativbeiträge.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Portfolio war in verschiedenen Unternehmensbranchen, Ratingkategorien und Industrieländern investiert.
- Am Ende des Berichtszeitraums war das Portfolio zu ungefähr 80 % mit Investment Grade bewertet und zu 20 % in Positionen ohne Investment Grade investiert.

Wir denken, da sich die Inflationstendenzen verbessern und die Zinssenkungen der Zentralbanken im Jahr 2025 entweder pausieren oder moderater ausfallen werden, dass die Entwicklung des Wirtschaftswachstums zu einer immer wichtigeren Triebkraft für die Renditen festverzinslicher Wertpapiere werden könnte. Wir erwarten, dass sich die Zerteilung der Kreditmärkte zugunsten von Qualität fortsetzen könnte. Insgesamt glauben wir, dass 2025 eine lohnende Zeit für solche globale Anleiheinvestoren sein könnte, die sich beim Aufbau ihrer Portfolios auf Fundamentaldaten und Selektivität konzentrieren.

## EMD Corporate – Social and Environmental Transition – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2024 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 8,50 %. Der als Benchmark dienende JP Morgan JESG CEMBI Broad Diversified Index (Total Return, USD) (der „Index“) verbuchte im selben Zeitraum 7,79 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividenderträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Im Jahr 2024 waren die Inflation und die Geldpolitik der Vereinigten Staaten die wichtigsten Faktoren am Anleihemarkt. Die Rendite 10-jähriger US-Anleihen stieg von 3,9 % auf 4,6 % zum Jahresende mit erheblichen Schwankungen in der Zwischenzeit.
- Auch geopolitische Ereignisse hatten Auswirkungen auf den Markt, insbesondere im April, als die Spannungen im Nahen Osten eskalierten. Im Oktober kam es bedingt durch Bedenken hinsichtlich der Inflation und der Finanzpolitik inmitten einer möglichen republikanischen Welle zu Marktstress, doch folgte nach der Wahl dann eine Markterholung, die in der Erwartung einer Deregulierung und wachstumsfreundlicher Maßnahmen gründete. Die Märkte straukelten im Dezember, als die US-Notenbank trotz der Zinssenkungen eine aggressivere Haltung einnahm und während der US-Exzeptionalismus den US-Dollar auf den stärksten Jahresschlusskurs seit 2001 brachte.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die wichtigsten Ergebnisse wurden durch das übergewichtete Engagement und die Positionierung in Argentinien sowie durch die Einzeltitelauswahl in Chile, Indien und Mexiko erzielt.
  - Aus Sektorsicht die Wertpapierauswahl in den Bereichen Technologie, Medien, Telekommunikation (TMT), Finanzen und Industrie.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Nach Ländern war die Einzeltitelauswahl in China und Kolumbien der größte Negativfaktor für die Wertentwicklung.
  - Nach Sektoren die Positionierungen in den Bereichen Immobilien, Transport Öl und Konsumgüter.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Wir haben unsere Gewichtung von Industrieunternehmen von untergewichtet auf übergewichtet geändert. Wir haben die Untergewichtung von TMT-Werten und Infrastruktur reduziert und den Immobiliensektor von untergewichtet zu neutral aufgestockt. Die Untergewichtung von Finanzwerten haben wir weiter ausgebaut.
- Zu den wichtigsten Änderungen aus Ländersicht gehörte die Aufstockung des Engagements in Argentinien, Brasilien und Indien, während wir gleichzeitig unsere Untergewichtung in Südafrika reduziert haben. Wir haben unser Übergewicht in den Vereinigten Arabischen Emiraten reduziert. Wir sind zu einer untergewichteten Position in China und Thailand übergegangen und haben die Untergewichtung von Südkorea weiter erhöht.

Wir glauben, dass die Anlageklasse der Schuldtitel aus Schwellenmärkten (EM) von einem stetigen globalen Wachstum, einer Lockerung der Geldpolitik und stärkeren Wachstumsaussichten für Schwellenländer profitieren wird. Die politischen Kurswechsel der US-Regierung bergen allerdings die Gefahr durch Handelsprotektionismus und schaffen Unsicherheit in Bezug auf die US-Zinsen. Trotz dieser Herausforderungen verbessern sich die Fundamentaldaten für Kredite aus Schwellenländern. Die Rating-Upgrades für Unternehmen und Staaten liegen (netto) auf einem höchsten Niveau seit zehn Jahren, und die Ausfallrate von Unternehmensanleihen aus Schwellenländern sank von 3,3 % auf 2,7 %. Während die Bewertungen in Teilen der Anlageklasse, insbesondere von verschiedenen Krediten mit Investment Grade, relativ teuer geworden sind, sehen wir weiterhin Gelegenheiten für Spread-Verengungen im Hochzinssegment.

## Emerging Market Debt – Hard Currency – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2024 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 13,13 %. Der als Benchmark dienende JP Morgan EMBI Global Diversified Index (Total Return, USD) (der Index) verbuchte im selben Zeitraum 6,54 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Im Jahr 2024 waren die Inflation und die Geldpolitik der Vereinigten Staaten die wichtigsten Faktoren am Anleihemarkt. Die Rendite 10-jähriger US-Anleihen stieg von 3,9 % auf 4,6 % zum Jahresende mit erheblichen Schwankungen in der Zwischenzeit.
- Auch geopolitische Ereignisse hatten Auswirkungen auf den Markt, insbesondere im April, als die Spannungen im Nahen Osten eskalierten. Im Oktober kam es bedingt durch Bedenken hinsichtlich der Inflation und der Finanzpolitik inmitten einer möglichen republikanischen Welle zu Marktstress, doch folgte nach der Wahl dann eine Markterholung, die in der Erwartung einer Deregulierung und wachstumsfreundlicher Maßnahmen gründete. Die Märkte strauchelten im Dezember, als die US-Notenbank trotz der Zinssenkungen eine aggressivere Haltung einnahm und während der US-Exzeptionalismus den US-Dollar auf den stärksten Jahresschlusskurs seit 2001 brachte.
- In diesem Jahr wurden die Umschuldungsprozesse für Sambia, die Ukraine, Ghana und Sri Lanka abgeschlossen, was auf eine gewisse Normalisierung nach der Welle mit Zahlungsausfällen in den Jahren 2020 bis 2023 hindeutet.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Länderallokation zeichnet sich durch die Übergewichtung von Märkten mit höheren Renditen, insbesondere Argentinien, Sri Lanka, Ecuador und El Salvador, aus.
  - Die Einzeltitelwahl über auf Euro lautende Anleihen aus der Elfenbeinküste und Peru.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Der Ausschluss von Pakistan, unterstützt durch die Politik des Internationalen Währungsfonds.
  - Die übergewichtete Allokation von Kolumbien, das sich mit politischen und fiskalischen Herausforderungen konfrontiert sah.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Portfolio behielt eine Tendenz zu Hochzinstiteln gegenüber Krediten mit Investment Grade (IG) ebenso bei wie das Engagement in notleidenden Anleihen in Sambia, der Ukraine, Ghana und Sri Lanka, die in der zweiten Jahreshälfte umstrukturiert wurden.
- Im Anschluss an eine starke Performance der Anlageklasse konzentrierten sich der jüngste Handel auf die Reduzierung des Risikos. Wir haben unser Engagement in Indonesien, Panama und Usbekistan heruntergefahren und Übergewichtungen in Angola, Argentinien und Ägypten reduziert. Darüber hinaus haben wir unsere Positionen in Rumänien aufgrund der Risiken bei der Versorgung und durch den Haushaltset vor den Wahlen reduziert.
- Unser Engagement in Costa Rica, El Salvador, der Elfenbeinküste, Nigeria und der Türkei wurde aufgrund positiver Reformaussichten, Haushaltskonsolidierung und Rating-Upgrades erhöht.
- Die Allokation zu auf EUR lautende Anleihen und Unternehmensanleihen betrug am Ende des Berichtszeitraums 15,4 % beziehungsweise 11,1 %.

Die Anlageklasse der Schuldtitel aus Schwellenmärkten (EM) sollte von einem stetigen globalen Wachstum, einer Lockerung der Geldpolitik und stärkeren Wachstumsaussichten für Schwellenländer profitieren. Die politischen Kurswechsel der US-Regierung bergen allerdings die Gefahr durch Handelsprotektionismus und schaffen Unsicherheit in Bezug auf die US-Zinsen. Trotz dieser Herausforderungen verbessern sich die Fundamentaldaten für Kredite aus Schwellenländern. Die Rating-Upgrades für Unternehmens- und Staatsanleihen liegen auf dem höchsten Niveau seit zehn Jahren. Während die Bewertungen für als IG- und mit BB bewertete Komponenten teuer erscheinen, bieten Segmente mit B-Rating und niedrigeren Ratings unserer Auffassung nach immer noch Wert. Chancen für eine Verengung der Spreads bestehen bei bestimmten Emittenten und Anleihen von außerhalb der Benchmark, insbesondere im BB-Segment.

## Emerging Market Debt – Local Currency – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2024 betrug die Gesamterrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I -3,36 %. Der als Benchmark dienende JP Morgan GBI Emerging Markets Global Diversified Index (Total Return, Unhedged, USD) (der „Index“) rentierte im selben Zeitraum -2,38 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamterrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Im Jahr 2024 war die weltweite Konjunktur robust, und die US-Notenbank, die Europäische Zentralbank und andere große Zentralbanken leiteten Zinssenkungszyklen ein. Die globalen Anleiherenditen gerieten erneut unter Aufwärtsdruck, da der Markt die Risiken im Zusammenhang mit der Inflationsentwicklung und der Finanzpolitik bewertete.
- Die Schwellenmärkte (EM) sahen sich mit Gegenwind konfrontiert, und zwar durch einen starken US-Dollar und – infolge des Wahlergebnisses in den Vereinigten Staaten – eine größere Unsicherheit in Bezug auf die US-Handelspolitik.
- Südafrika war im Berichtszeitraum das Indexland mit der besten Performance, gefolgt von der Dominikanischen Republik. Brasilien und Mexiko rangierten am Ende des gegenüberliegenden Spektrums mit der schlechtesten Performance.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Übergewichtung der türkischen Lira und die Übergewichtung am langen Ende der Kurve in Südafrika.
  - Außerhalb der Benchmark liegende Beteiligungen in Ägypten und Argentinien.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Übergewichtung von Währungen und Zinssätzen in Brasilien und Mexiko.
  - Die Untergewichtung im thailändischen Baht und die Übergewichtung in der tschechischen Krone.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Risiko im Zusammenhang mit Schwellenländerwährungen sehen wir mit mehr Vorsicht, weshalb wir das Engagement in asiatischen Währungen reduziert haben, insbesondere aufgrund der Erwartung größerer geopolitischer Risiken und eines langsameren Wachstums in der Region. Im Zuge der Hinwendung zu einer mehr orthodoxen Geldpolitik haben wir unser Engagement in der türkischen Lira erhöht. Gleiches gilt auf Frontier-Währungen lautende Anlagegelegenheiten.
- Wir haben das ganze Jahr über eine übergewichtete Duration beibehalten und die Duration in asiatischen Ländern wie China und Indien erhöht. In Lateinamerika, auf der anderen Seite, haben wir die Duration reduziert, da wir hier auf kurze Sicht nur begrenzte Möglichkeiten für eine Lockerung der Geldpolitik sehen.

Die Anlageklasse der Schwellenländeranleihen sollte von einem langsameren (wenn auch nicht rezessivem) globalen Wachstum, einer gelockerten Geldpolitik und einer deutlichen Wachstumsbelebung in den Schwellenländern im Vergleich zu den Industrieländern profitieren. In China sollten neue politische Stimuli die Risiken einer harten Landung beseitigen, auch wenn wir keine größere Erholung des Wachstums erwarten. Der Regierungswechsel in den Vereinigten Staaten birgt Risiken im Zusammenhang mit Handelsprotektionismus, insbesondere für einige der offeneren Volkswirtschaften in Asien und Osteuropa. Außerdem bringt er eine größere Unsicherheit in Bezug auf die künftige Entwicklung der US-Zinssätze mit sich, was unter Umständen Auswirkungen auf die lokalen Zinssätze und Währungen der Schwellenländer haben könnte. Die Inflation in den Schwellenländern wird in diesem Jahr voraussichtlich im Durchschnitt weiter sinken, was den meisten Zentralbanken Spielraum für weitere Lockerungen der Geldpolitik bieten dürfte. Derzeit bestehen regionale Unterschiede, da einige Länder in Lateinamerika Schwierigkeiten haben, die Inflation zu mindern. Die Bewertungen der Realrenditen sehen auf den Märkten mit lokalen Zinssätzen im Durchschnitt attraktiv aus, und wir behalten die übergewichtete lokale Duration bei. Wir rechnen auf kurze Sicht mit einer höheren Volatilität für Schwellenländerwährungen, während weitere Details über die US-amerikanische Handels- und Fiskalpolitik unter der zweiten Trump-Regierung bekannt werden. Mittelfristig sollten Schwellenländerwährungen jedoch durch robuste makroökonomische Fundamentaldaten der Schwellenländer gestützt werden. Gleichzeitig sehen die Bewertungen nach dem Rückgang in den letzten Monaten ebenfalls attraktiver aus.

## Emerging Market Debt Blend – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2024 betrug die Gesamtertragsrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 2,89 %. Der als Benchmark dienende Index, eine gewichtete Mischung aus 50 % JP Morgan GBI Emerging Markets Global Diversified Index (Total Return, nicht abgesichert, USD), 25 % JP Morgan EMBI Global Diversified Index (Total Return, USD) und 25 % JP Morgan CEMBI Diversified Index (Total Return, USD) (der „Index“) verbuchte im selben Zeitraum 2,21 %. (Die Performance für alle Anteilsklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtertragsrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Im Jahr 2024 war die weltweite Konjunktur robust und die großen Zentralbanken leiteten Zinssenkungszyklen ein. Die globalen Anleiherenditen gerieten im Laufe des Jahres erneut unter Aufwärtsdruck, da der Markt die Risiken im Zusammenhang mit der Inflationsentwicklung und der Finanzpolitik bewertete. Schwellenmärkte (EM) hatten mit Gegenwind durch einen starken US-Dollar zu kämpfen.
- Auch geopolitische Ereignisse hatten Auswirkungen auf den Markt, insbesondere im April, als die Spannungen im Nahen Osten eskalierten.
- In diesem Jahr wurden die Umschuldungsprozesse für Sambia, die Ukraine, Ghana und Sri Lanka abgeschlossen, was auf eine gewisse Normalisierung nach der Welle mit Zahlungsausfällen in den Jahren 2020 bis 2023 hindeutet.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Hartwährungsländer, die von Übergewichtungen in höher rentierlichen Märkten wie Argentinien, Sri Lanka, Ecuador und El Salvador angetrieben werden. Die Einzeltitelauswahl bei auf Euro lautende Anleihen.
  - Die Bottom-up-Positionierung in lokaler Währung, einschließlich der Übergewichtung der türkischen Lira, der Übergewichtung am langen Ende der Kurve in Südafrika und des Engagements außerhalb der Benchmark in Ägypten.
  - Die Bottom-up-Positionierung in Unternehmen aus den Sektoren Technologie, Medien und Telekommunikation, Öl und Gas sowie Finanzen.
  - Die taktische Positionierung bei der Zinsduration in Industrieländern, Short-Positionen in EM-Devisen und Euro-Positionen.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Übergewichtung der Landeswährung gegenüber der Hartwährung, da es an den Märkten für Hartwährung während des Berichtszeitraums zu einer Outperformance kam.
  - Die Bottom-up-Positionierung in lokaler Währung bei Währungs- und Zinsübergewichtungen in Brasilien und Mexiko, die Untergewichtung des thailändischen Baht und Übergewichtung der Duration in der Tschechischen Republik.
  - Die Bottom-up-Positionierung in Unternehmen aus dem Immobilien- und dem Transportsektor.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Die taktische Verlagerung des relativen Engagements von übergewichteten lokalen Währungen für den größten Teil des Jahres (finanziert durch eine Untergewichtung von Hartwährungen) zu einer Untergewichtung sowohl von Hartwährungen als auch von lokalen Währungen zum Jahresende.
- Bei Hartwährungen behielten wir eine Ausrichtung auf Hochzinsschulden gegenüber Staatsanleihen mit Investment Grade bei. Bei Unternehmensanleihen erhöhten wir die Gewichtungen von Versorgern und von Rohstoffen, während wir Finanzwerte reduzierten.
- Die Duration in Lokalwährungen war während des gesamten Jahres übergewichtet. In Bezug auf das Wechselkursrisiko in den Schwellenländern gingen wir im Laufe des Jahres vorsichtiger vor.

Die Anlageklasse der Schwellenländeranleihen sollte von einem langsameren (wenn auch nicht rezessivem) globalen Wachstum, einer gelockerten Geldpolitik und einer deutlichen Wachstumsbelebung in den Schwellenländern im Vergleich zu den Industrieländern profitieren. In China sollten neue politische Stimuli die Risiken einer harten Landung beseitigen, auch wenn wir keine größere Erholung des Wachstums erwarten. Der Regierungswechsel in den Vereinigten Staaten birgt Risiken im Zusammenhang mit Handelsprotektionismus, insbesondere für einige der offeneren Volkswirtschaften in Asien und Osteuropa. Außerdem bringt er eine größere Unsicherheit in Bezug auf die künftige Entwicklung der US-Zinssätze mit sich, was unter Umständen Auswirkungen auf die lokalen Zinssätze und Währungen der Schwellenländer haben könnte. Auch die Inflation in den Schwellenländern wird in diesem Jahr voraussichtlich im Durchschnitt weiter sinken, was den meisten Zentralbanken Spielraum für weitere Lockerungen ihrer Geldpolitik bieten dürfte. Auch die Fundamentaldaten für Kredite aus Schwellenmärkten verbessern sich, wobei die Rating-Upgrades für Unternehmens- und Staatsanleihen auf einem Zehnjahreshoch liegen.

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2024 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I -0,36 %. Im selben Zeitraum verbuchte die zusammengesetzte Benchmark – ein Drittel der JP Morgan GBI Emerging Markets Global Diversified Investment Grade 15% Cap Index (Total Return, nicht abgesichert, USD) und zwei Drittel der JP Morgan EMBI Global Diversified Investment Grade Index (Total Return, USD) (der „Index“) – ein Plus von -0,24 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Im Jahr 2024 war die weltweite Konjunktur robust und die großen Zentralbanken leiteten Zinssenkungszyklen ein. Die globalen Anleiherenditen gerieten im Laufe des Jahres erneut unter Aufwärtsdruck, da der Markt die Risiken im Zusammenhang mit der Inflationsentwicklung und der Finanzpolitik bewertete. Schwellenmärkte (EM) hatten mit Gegenwind durch einen starken US-Dollar zu kämpfen.
- Auch geopolitische Ereignisse hatten Auswirkungen auf den Markt, insbesondere im April, als die Spannungen im Nahen Osten eskalierten.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Bottom-up-Positionierung bei staatlichen Emissionen in Hartwährung einschließlich supranationaler Emittenten, die Einzeltitelauswahl in den Philippinen und Kasachstan sowie in auf Euro lautenden Anleihen.
  - Die Bottom-up-Positionierung in lokalen Marktwährungen wie dem polnischen Zloty, dem rumänischen Leu und dem malaysischen Ringgit.
  - Die taktische Positionierung bei der Zinsduration in Industrieländern, Short-Positionen in EM-Devisen und Euro-Positionen.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Bottom-up-Positionierung in lokalen Währungen, insbesondere durch die Übergewichtung von Devisen und der Duration in Mexiko, der Untergewichtung der Duration in China sowie der Übergewichtung der Duration in Tschechien und Indonesien.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Die taktische Verlagerung des relativen Engagements von übergewichteten lokalen Währungen für den größten Teil des Jahres (finanziert durch eine Untergewichtung von Hartwährungen) zu einer Untergewichtung sowohl von Hartwährungen als auch von lokalen Währungen zum Jahresende.
- Der Handel mit Hartwährungen konzentrierte sich auf die Reduzierung des Risikos, ein erhöhtes Engagement im Nahen Osten und eine reduzierte Gewichtung von Rumänien, Kasachstan, Panama und Indonesien.
- Die Duration in Lokalwährungen war während des gesamten Jahres übergewichtet. In Bezug auf das Wechselkursrisiko in den Schwellenländern gingen wir im Laufe des Jahres vorsichtiger vor.

Die Anlageklasse der Schwellenländeranleihen sollte von einem langsameren (wenn auch nicht rezessivem) globalen Wachstum, einer gelockerten Geldpolitik und einer deutlichen Wachstumsbelebung in den Schwellenländern im Vergleich zu den Industrieländern profitieren. In China sollten neue politische Stimuli die Risiken einer harten Landung beseitigen, auch wenn wir keine größere Erholung des Wachstums erwarten. Der Regierungswechsel in den Vereinigten Staaten birgt Risiken im Zusammenhang mit Handelsprotektionismus, insbesondere für einige der offeneren Volkswirtschaften in Asien und Osteuropa. Außerdem bringt er eine größere Unsicherheit in Bezug auf die künftige Entwicklung der US-Zinssätze mit sich, was unter Umständen Auswirkungen auf die lokalen Zinssätze und Währungen der Schwellenländer haben könnte. Auch die Inflation in den Schwellenländern wird in diesem Jahr voraussichtlich im Durchschnitt weiter sinken, was den meisten Zentralbanken Spielraum für weitere Lockerungen ihrer Geldpolitik bieten dürfte. Auch die Fundamentaldaten für Kredite aus Schwellenmärkten verbessern sich, wobei die Rating-Upgrades für Unternehmens- und Staatsanleihen auf einem Zehnjahreshoch liegen.

## Emerging Markets Equity – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2024 betrug die Gesamtertragsrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 19,51 %. Der als Benchmark dienende MSCI Emerging Markets Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der Index) verzeichnete im selben Zeitraum ein Plus von 7,50 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtertragsrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die Aktienbenchmarks der Schwellenländer (EM) verzeichneten positive Ergebnisse, doch lagen sie am Ende des Jahres hinter den Industrieländern (repräsentiert durch den MSCI World Index).
- Schwellenländeraktien waren volatil, was in erster Linie auf externe Gründe zurückzuführen war, darunter Verzögerungen bei den Zinssenkungen in den Vereinigten Staaten und die dortige Wahl mit der angedrohten Wiedereinführung von Zöllen auf importierte Waren. Ein weiterer Grund war, dass die Anleger auf eine unterstützende Regierungspolitik in China warteten, deren Details aber zum Jahresende noch nicht feststanden.
- Aus Sektorsicht machte die Begeisterung für Ausgaben im Bereich der künstlichen Intelligenz die Informationstechnologie zum besten Sektor im Index, wobei Halbleiter und verwandte Branchen in diesem Segment besonders stark waren. Der Werkstoffsektor gab in diesem Jahr am meisten nach.

Das mit der Informationstechnologie verbundene Taiwan war in diesem Jahr der Markt mit der besten Performance im Index, und die im September erfolgten Ankündigungen von Konjunkturmaßnahmen in China kurbelten den größten Markt für Indexkomponenten an. Ägypten verzeichnete im Berichtszeitraum den größten Rückgang, knapp hinter Brasilien, was an Bedenken hinsichtlich der Ausgabenpolitik der Regierung lag.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Einzeltitelauswahl trug am meisten zur Outperformance des Portfolios bei, und die Sektorallokation war ebenfalls positiv. Die IT-Bestände waren der bedeutendste Faktor, gefolgt von Nicht-Basiskonsumgütern und Industrieunternehmen.
  - Nach Ländern haben die Bestände in Indien, Taiwan und Brasilien den größten Wertzuwachs generiert.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Nach Sektoren: Die Einzeltitelauswahl in den Bereichen Finanzen, Basiskonsumgüter und Versorger.
  - Geografisch gesehen kam der größte Gegenwind für das Portfolio aus China, doch konnte durch die Aktienausswahl und eine Untergewichtung ein Mehrwert generiert werden. Eine nicht im Index enthaltene argentinische Beteiligung, ein globaler IT-Dienstleister, führte ebenfalls zu Wertabzügen.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Angesichts potenzieller Risiken durch die Unsicherheit in der Politik der US-amerikanischen und chinesischen Regierung hat das Portfolio eine Ausrichtung auf idiosynkratische globale Wachstumsbereiche. Zum Beispiel ist unser Sektor mit der größten Übergewichtung der Industriesektor. Das Team vertritt die Ansicht, dass sich bei Unternehmen für elektrische Geräte, die Stromnetze und Rechenzentren in Schwellenländern beliefern, Chancen bieten. Finanzwerte sind unser größter untergewichteter Sektor, da es hier an einem einheitlich starken wirtschaftlichen Impuls mangelt.
- Das Portfolio ist in China untergewichtet, wobei allgemein zollbelastete chinesische Exporteure zugunsten von Unternehmen gemieden werden, deren Wachstum von der Inlandsnachfrage angetrieben wird. Indien ist unsere größte Übergewichtung, da wir hier zahlreiche attraktive aktienspezifische Gelegenheiten im gesamten Marktkapitalisierungsspektrum sehen.

Mit Blick auf die Zukunft ist das Team der Auffassung, dass das Portfolio gut aufgestellt ist, um sich im aktuellen Marktumfeld zurechtzufinden. Es versucht Bereiche zu vermeiden, die anfällig für Schlagzeilenrisiken sind, und bevorzugt Nischen mit Wachstumspotenzial.

## Euro Bond – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2024 betrug die Gesamterrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse EUR I 5,75 %. Der Bloomberg Euro Aggregate Index (Total Return, Hedged, EUR) (der „Index“) rentierte im selben Zeitraum 2,73 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamterrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die Marktbewegungen im Jahr 2024 wurden in erster Linie durch über den Erwartungen liegende Wirtschaftsdaten (insbesondere in den Vereinigten Staaten), uneinheitliche Inflationstrends, wobei die Vereinigten Staaten und Großbritannien nicht mit dem Fortschritt in Europa mithalten können, neue Regierungen in Großbritannien und den Vereinigten Staaten und anhaltende geopolitische Spannungen zwischen Russland und der Ukraine sowie in Gaza bestimmt.
- Risikoanlagen entwickelten sich 2024 an den Märkten für festverzinsliche Wertpapiere stark, wobei europäische Hochzinsanleihen am besten abschnitten, während globale Investment-Grade-Anleihen und Anleihen aus Schwellenmärkten (EM) ebenfalls positive Renditen verbuchten.
- Europäische Investment-Grade-Kredite, die Märkte für Staatsanleihen und besicherte Instrumente, die zusammen den Großteil des Anlageuniversums für die Strategie ausmachen, verzeichneten ebenfalls positive Renditen.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Kreditauswahl war der entscheidende Faktor für die starken relativen Renditen im Jahresverlauf, insbesondere durch unser Engagement in REITs und im breiteren Finanzwertbereich, während unsere Übergewichtung in diesen beiden Segmenten (und im Kreditbereich generell) die Auswirkungen dieser Auswahlentscheidungen weiter verstärkte, da sich die Spreads verengten und die Fundamentaldaten der Portfoliositionen im Laufe des Jahres deutlich besser ausfielen.
  - Die Duration und die Kurvenpositionierung trugen im Laufe des Jahres ebenfalls zu den relativen Renditen bei, da wir im dritten Quartal nach dem Rückgang der Zinssätze die Gewinne aus unserer Short-Position mitgenommen haben.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Einzeltitelauswahl (über verschiedene Anlageklassen hinweg), die Sektorallokation, die Duration und die Kurvenpositionierung hatten alle einen positiven Effekt auf den Fonds, ohne dass es im Laufe des Jahres zu größeren nennenswerten Wertminderungen kam.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Im Laufe des Jahres beteiligten wir uns weiterhin an Transaktionen am Primärmarkt und nutzten Fehlbewertungen sowohl auf Kredit- als auch auf Zinsebene, was in beiden Fällen erheblich zu den positiven Renditen für das Jahres beitrug.
- Unsere Kreditpositionen waren eine beständige Antriebskraft für die Renditen, und wir haben gegen Ende des Jahres bei einigen davon die Gewinne mitgenommen.
- Aus Perspektive der Duration trug unsere Short-Positionierung zu den Renditen bei. Wir lösten sie am Ende des dritten Quartals nach dem Rückgang an den Zinsmärkten auf. In dieser Hinsicht blieben wir im Laufe des Jahres aktiv.

Unserer Ansicht nach wird das Jahr 2025 wahrscheinlich so beginnen, wie das Jahr 2024 endete. Die Zinssätze könnten volatil sein, da sich die globale Inflation als hartnäckig erweisen wird und die Entscheidungen der Zentralbanken datenabhängig sein werden. Ferner wird erwartet, dass Risikobereitschaft hoch sein dürfte und die Gesamtnachfrage nach Anleihen durch das überdurchschnittliche Niveau der auf dem Markt verfügbaren „All-in-Renditen“ (risikofreie Zinssätze + Spreads) gestützt wird. Da sich die Spreads auf historischen Tiefständen befinden, rechnen wir für 2025 mit einer Zunahme der Volatilität und der Streuung, da sich das neue, höhere Zinsumfeld wahrscheinlich negativ (und vor allem unterschiedlich) auf die Bilanzen der Emittenten auswirken wird. Aufgrund dieser Ansichten glauben wir, dass es im Jahr 2025 wichtiger denn je sein wird, sich auf fundamental starke Emittenten/Sektoren/Länder zu konzentrieren und Emittenten mit schwachen Finanzprofilen (z. B. höhere Verschuldung, weniger nachhaltige Cashflows usw.) zu meiden. Die aktuellen Spreads sind nicht weit genug, um uns für das eingegangene Risiko zu entschädigen.

## Euro Bond Absolute Return – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2024 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse EUR I 8,17 %. Der ICE BofA 0-1 Year AAA Euro Government Index (Total Return, EUR) (der Index) verzeichnete im selben Zeitraum 3,50 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividenden erträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die Marktbewegungen im Jahr 2024 wurden in erster Linie durch über den Erwartungen liegende Wirtschaftsdaten (insbesondere in den Vereinigten Staaten), uneinheitliche Inflationstrends, wobei die Vereinigten Staaten und Großbritannien nicht mit dem Fortschritt in Europa mithalten können, neue Regierungen in Großbritannien und den Vereinigten Staaten und anhaltende geopolitische Spannungen zwischen Russland und der Ukraine sowie in Gaza bestimmt.
- Risikoanlagen entwickelten sich 2024 an den Märkten für festverzinsliche Wertpapiere stark, wobei europäische Hochzinsanleihen am besten abschnitten, während globale Investment-Grade-Anleihen und Anleihen aus Schwellenmärkten (EM) ebenfalls positive Renditen verbuchten.
- Europäische Investment-Grade-Kredite, die Märkte für Staatsanleihen und besicherte Instrumente, die zusammen den Großteil des Anlageuniversums für die Strategie ausmachen, verzeichneten ebenfalls positive Renditen.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die positive Rendite im Laufe des Jahres wurde durch eine Kombination aus Erträgen (350 Basispunkte, Bp), Spread-Bewegungen (320 Bp) und Kurvenbewegungen (70 Bp) erzielt.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Der größte Teil der Wertabzüge von der Performance ergab sich aus Durationsbewegungen. Dies wurde jedoch durch unsere aktive Positionierung, in erster Linie in der ersten Hälfte des Jahres 2024, bis zu einem gewissen Grad abgemildert.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Im Laufe des Jahres beteiligten wir uns weiterhin an Transaktionen am Primärmarkt und nutzten Fehlbewertungen sowohl auf Kredit- als auch auf Zinsebene, was in beiden Fällen erheblich zu den positiven Renditen für das Jahres beitrug.
- Unsere Kreditpositionen waren eine beständige Antriebskraft für die Renditen, und wir haben gegen Ende des Jahres bei einigen davon die Gewinne mitgenommen.
- Aus Perspektive der Duration konnte unsere Short-Positionierung einige negativen Renditen umkehren. Wir lösten die Position am Ende des dritten Quartals nach dem Rückgang an den Zinsmärkten auf. In dieser Hinsicht blieben wir im Laufe des Jahres aktiv.

Unserer Ansicht nach wird das Jahr 2025 wahrscheinlich so beginnen, wie das Jahr 2024 endete. Die Zinssätze könnten volatil sein, da sich die globale Inflation als hartnäckig erweisen wird und die Entscheidungen der Zentralbanken datenabhängig sein werden. Ferner wird erwartet, dass Risikobereitschaft hoch sein dürfte und die Gesamtnachfrage nach Anleihen durch das überdurchschnittliche Niveau der auf dem Markt verfügbaren „All-in-Renditen“ (risikofreie Zinssätze + Spreads) gestützt wird. Da sich die Spreads auf historischen Tiefständen befinden, rechnen wir für 2025 mit einer Zunahme der Volatilität und der Streuung, da sich das neue, höhere Zinsumfeld wahrscheinlich negativ (und vor allem unterschiedlich) auf die Bilanzen der Emittenten auswirken wird. Aufgrund dieser Ansichten glauben wir, dass es im Jahr 2025 wichtiger denn je sein wird, sich auf fundamental starke Emittenten/Sektoren/Länder zu konzentrieren und Emittenten mit schwachen Finanzprofilen (z. B. höhere Verschuldung, weniger nachhaltige Cashflows usw.) zu meiden. Die aktuellen Spreads sind nicht weit genug, um uns für das eingegangene Risiko zu entschädigen.

## European High Yield Bond – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2024 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse EUR I 9,35 %. Im selben Zeitraum verzeichnete der als Benchmark dienende ICE BofA European Currency Non-Financial High Yield 3% Constrained Index (Total Return, EUR) (der Index), 8,57 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Der europäische Markt für Hochzinsanleihen schloss das Jahr 2024 mit soliden Renditen ab, die durch ein robustes Wirtschaftswachstum und eine sich abschwächende Inflation angetrieben wurden. Die Kreditspreads verengten sich im Berichtszeitraum in allen Segmenten, was auf eine besser als erwartete Wirtschaftsleistung, stabile Fundamentaldaten und eine stetige Nachfrage nach Krediten zurückzuführen ist.
- Die aggregierten Fundamentaldaten von Hochzinsemitenten in Bezug auf das Wachstum des Gewinns vor Zinsen, Steuern und Abschreibungen (EBITDA), der freie Cashflow, die Zinsdeckung und der Verschuldungsgrad, hielten sich in recht günstigen Bereichen, und die Ertragssaison fiel im Großen und Ganzen besser aus als befürchtet.
- Zwar ist die Ausfallquote von ihren Tiefstständen im Jahr 2022 gestiegen, doch erwarten wir, dass die Ausfallquoten in 2025 in einem Bereich knapp um den langfristigen Durchschnitt bleiben werden. Dieser Ausblick stützt sich auf unsere Bottom-up-Beurteilung von Emittenten und wird getragen von dem qualitativ höherwertigen Ratingsmix im europäischen Hochzinssegment (ca. 66 % der Emittenten mit Kreditratings von BB), von weniger aggressiven Neuemissionen, weniger kurzfristigen Fälligkeiten sowie einem Energiesektor, der deutlich solider ist als in den letzten Zyklen.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur Rendite:
  - Aus Sektorsperspektive trugen die Positionierungen in den Bereichen Technologie & Elektronik, Einzelhandel sowie in der Grundstoffindustrie am meisten zur Performance bei.
  - Aus der Perspektive der Ratings trugen die Positionierungen bei Emittenten mit einem Rating von BB, BBB und darüber CCC und darunter sowie B am meisten zur Wertentwicklung bei.
- Negativbeiträge zur Rendite:
  - Aus Sektorsperspektive waren die Positionierungen in den Bereichen Energie, Medien und Konsumgüter am nachteiligsten für die Performance.
  - Aus Sicht der Ratings zeichneten die Auswahl von Wertpapieren ohne Rating und eine leichte Übergewichtung von Emittenten mit CCC-Rating und darunter für die meisten Wertabzüge verantwortlich.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Im Rahmen unserer Hochzinsstrategien haben wir selektiv in qualitativ höherwertige B- und BB-Anleihen umgeschichtet, wo die Preise im Verhältnis zu den zugrunde liegenden Fundamentaldaten attraktiv blieben und die Ausfallerwartungen niedrig waren.
- Bei den CCC-Positionierungen hatten wir eine differenzierte Sicht auf die einzelnen Kredite, die auf unseren hausinternen Ratings und den Einschätzungen der Analysten zu den einzelnen Krediten beruhte. Zudem konzentrierten wir uns auf Umschichtungen innerhalb von Branchen und Risikokategorien des Marktes, um die Widerstandsfähigkeit gegenüber Preismacht- und Lohnkostentrends zu maximieren, sofern diese fortbestehen. Außerdem haben wir das Verschuldungsprofil des Portfolios, wo dies ohne Verluste möglich war, heruntergefahren.
- Unser Plan war es, das Portfolio in erster Linie auf BB- und höherwertige B-Kreditrisiken zu konzentrieren (auf Basis unseren internen Kreditratings) und Sektoren überzugewichten, die wir im aktuellen Umfeld als widerstandsfähig einschätzen.

Wir sind der Meinung, dass die Bewertungen europäischer Hochzinsanleihen eine mehr als angemessene Entschädigung für die mehr oder weniger durchschnittlichen Ausfallerwartungen darstellen, die Anleihen weiterhin dauerhafte Erträge bieten und im Vergleich zu anderen festverzinslichen Alternativen attraktiv sind. Makroökonomische Daten, die politische Unsicherheit über Zölle, geopolitische Bedenken und die allgemeine Dynamik des Kreditzyklus können den Markt für Hochzinsanleihen zwar täglich beeinflussen, doch konzentrieren sich unsere Analysten und Portfoliomanager weiterhin auf die spezifischen Fundamentaldaten einzelner Emittenten, wobei die Analysten die Basis- und Abwärtsszenarien bewerten. Wir sind der Meinung, dass wir mit unserem fundamentalen Bottom-up-Kreditresearch – mit Konzentration auf die Auswahl von Wertpapieren, die Vermeidung von Bonitätsherabstufungen und die ausschließliche Aufnahme der „besten Ideen“ in die Portfolios – gut aufgestellt sind, um von eventueller Volatilität zu profitieren.

## European Sustainable Equity – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2024 betrug die Gesamtertragsrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse EUR I 5,26 %. Der als Benchmark dienende MSCI Europe Index (Total Return, abzüglich Steuern, EUR) (der Index) verzeichnete im selben Zeitraum 8,59 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtertragsrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Das Jahr 2024 begann mit starken globalen Aktienmärkten, angetrieben durch ein robustes US-Wirtschaftswachstum und positive globale Daten, wobei die Outperformance von Japan erwähnenswert ist.
- Die Inflations Sorgen hielten bis ins zweite Quartal an, was die Erwartungen an weitere Zinssenkungen durch die Zentralbanken senkte, doch konnten Aktien aus Industrieländern positive Renditen erzielen.
- Im dritten Quartal zeigten sich die Aktienmärkte stabil, da die Inflation – unterstützt durch Maßnahmen der Zentralbanken und chinesische Konjunkturmaßnahmen, wovon Asien ohne Japan profitierte – zurückging.
- Der Ausgang der US-Präsidentenwahlen im letzten Quartal belastete europäische Aktien aufgrund der Sorge vor drohenden Handelszöllen durch die neue Trump-Regierung.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Das Ergebnis der Sektorallokation war positiv, was auf die Underperformance der untergewichteten Positionen in den Bereichen Versorgungsunternehmen, Werkstoffe, Immobilien und insbesondere Energie zurückzuführen war.
  - Auf Aktienebene trugen unsere Beteiligungen an 3i Group, Euronext, London Stock Exchange (Finanzwerte), Schneider Electric (Industrie) und Netcompany (Informationstechnologie) am meisten zur Performance bei.
  - Die Aktienauswahl unter Finanzwerten und Kommunikationsdienstleistern resultierte ebenfalls in einem positiven Ergebnis.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Underperformance lässt sich vollständig durch die Einzeltitelauswahl erklären, wobei unsere Beteiligungen im Gesundheitswesen, in der Industrie und Verbrauchsgüter einen negativen Wertbeitrag leisteten.
  - Unsere Beteiligungen an der CVS Group, Tecan (Gesundheitswesen), L'Oréal (Basiskonsumgüter), Kering (Nicht-Basiskonsumgüter), Alfen (Industrie) und SolarEdge (Informationstechnologie) waren die größten Negativfaktoren.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Wir haben mehrere Beteiligungen aufgelöst, deren Wettbewerbsposition unter Druck geriet. Im Verbrauchersektor haben wir Kering und HelloFresh verkauft und im Sektor für saubere Energie haben wir uns von SolarEdge und Alfen getrennt.
- Die Erlöse aus diesen Verkäufen wurden in mehrere neue Portfoliobeteiligungen reinvestiert, die den etablierten Akteuren Marktanteile abnehmen, da ihre Technologiekompetenz ihre Wettbewerbsposition stärkt: Spotify (Kommunikationsdienste) und Sage Group (Informationstechnologie).
- Schließlich haben wir das Portfolioengagement in einigen neuen Unternehmen mit vorhersehbarem und wiederholtem Umsatzwachstum erhöht: Compass (Nicht-Basiskonsumgüter), Haleon (Basiskonsumgüter) und Diploma (Industrie).

Unser Ausblick auf den Aktienmarkt deutet auf ein Potenzial, das über die größten Unternehmen im Index hinausgeht. Bei einem erwarteten überdurchschnittlichen Wachstum in den Vereinigten Staaten und einer kontrollierten Inflation könnte den Anlegern eine auf der Ertragsentwicklung beruhende Performance und eine Ausweitung der Marktführerschaft zugutekommen. Wir glauben, dass unser Portfolio gut positioniert ist, um davon zu profitieren, da es sich aus einem diversifizierten Pool qualitativ hochwertiger und widerstandsfähiger Unternehmen zusammensetzt, die einen Fokus auf Nachhaltigkeit haben und dieser ihren Wettbewerbsvorteil stärken.

## Event Driven – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2024 betrug die Gesamterrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD 18,15 %. (Die Performance für alle Anteilsklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamterrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die Transaktionsaktivität hat sich 2024 deutlich von den Tiefstständen im Jahr 2023 erholt. Wir sind jedoch noch weit von den Höchstständen des Marktes oder selbst den Volumina von Fusionen und Akquisitionen (M&A) in der Mitte des Zyklus entfernt. Es könnte noch viel mehr kommen, da es nach wie vor einen erheblichen Nachholbedarf gibt. Wir waren zwar der Meinung, dass die US-Wahlen sich unabhängig vom Wahlausgang als ein Katalysator für M&A erweisen würden, doch ist die Agenda der Trump-Regierung/des von den Republikanern kontrollierten Kongresses angesichts ihrer wirtschaftsfreundlichen/deregulierenden Haltung positiv für Geschäftsabschlüsse und die Risikobereitschaft von Unternehmen. Nach der Wahl und bis in den Januar hinein hat sich das Transaktionsaufkommen belebt.
- Wie wir bereits zu Beginn des Jahres im Zusammenhang mit der Catalyst-Strategie diskutiert haben, ist das Potenzial für Anlagegelegenheiten weiterhin attraktiv, da Unternehmen in einem unsicheren Makro-Umfeld eine Vielzahl von Wegen in Betracht ziehen, um ihren Eigenkapitalwert zu steigern. Zusätzlich zu den positiven Rahmenbedingungen für die Ideenfindung ermöglicht es unser striktes Festhalten an Absicherungen sowohl in Bezug auf das Markt-Beta als auch das Stil-Engagement dem Team, Investitionen so zu strukturieren, dass sie aus diesen Situationen Wert schöpfen, ohne dabei von der Marktrichtung oder dem Marktniveau abhängig zu sein. Wir erwarten, dass dies angesichts der Erwartung einer erhöhten Volatilität zu Beginn des Jahres 2025 weiterhin für die Strategie von Bedeutung sein wird.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur absoluten Rendite:
  - Obwohl beide Strategien im Jahr 2024 einen positiven Wertbeitrag generierten, wurde die Performance hauptsächlich von der Strategie Market Neutral Catalyst getragen.
  - Die fünf Spitzenreiter mit Blick auf die Performance waren FTAI Aviation (Catalyst), 3M Company (Catalyst), Apollo Global Management (Catalyst), Fiserv (Catalyst) und Williams (Catalyst)
- Negativbeiträge zur absoluten Rendite:
  - Die fünf Schlusslichter waren Lamb Weston (Catalyst), Hess (Risk Arbitrage) BioMarin Pharmaceutical (Catalyst), Vestis (Catalyst) und Liberty Media (Catalyst)

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Engagement in der Strategie Merger Arbitrage nahm im Laufe des Jahres mit zunehmendem Transaktionsaufkommen stetig zu. Obwohl die Spread-Niveaus im Laufe des Jahres attraktiv waren, kam es in diesem Bereich zu Volatilität, einschließlich durch einige gescheiterte Transaktionen (an denen wir nicht beteiligt waren), und bestimmte Transaktionen, die sich länger hingezogen haben, wodurch der Gesamtbeitrag der Strategie im Laufe des Jahres begrenzt wurde.
- Bei der Strategie Market Neutral Catalyst haben wir von einer Reihe von Ideen in verschiedenen Sektoren profitiert, da sich die von uns identifizierten Investmentthesen realisiert haben. Wir haben bei einigen Namen die Gewinne mitgenommen und, wie bereits erwähnt, identifizieren wir weiterhin neue Anlagegelegenheiten. In einem starken Aktienmarkt mit Aufwärtstrend war unsere Absicherung im Laufe des Jahres im Allgemeinen effektiv, denn wir konnten über sie auf relativer Basis starke Gewinne erzielen.

Wir glauben, dass die Aussichten für Event-Driven-Strategien bis ins Jahr 2025 attraktiv sind. Eine Trump-Regierung sollte sich auf die M&A- und Kapitalmarktaktivitäten positiv auswirken, da die Politik seiner Regierung in unseren Augen tendenziell unternehmensfreundlicher ist und die Unternehmenstätigkeiten weiter fördern sollte. Wir erwarten eine gewisse Volatilität an den Märkten, da die Trump-Agenda nicht einfach die vor uns liegenden makroökonomischen und geopolitischen Probleme „lösen“ kann. In Hinsicht auf die Geld- und Fiskalpolitik gibt es viele Querströmungen und Unsicherheiten. Zinsänderungen, Währungsschwankungen, eine unsichere Zollpolitik und ein undurchsichtiges Umfeld in vielen Branchen sollten zu mehr Volatilität in den Sektoren führen und auch individuelle Namen betreffen. Zumindest ist das unsere Hoffnung. Wir denken, dass wir über die Kreativität und die Ressourcen verfügen, um in einem Umfeld mit höherer Volatilität und größerer Unsicherheit erfolgreich zu sein. Wir hoffen daher, dass dies zu einer bedeutenden Differenzierung zwischen Long- und Short-Positionen führt, die wir in zukünftigen Quartalen zu unserem Vorteil nutzen können.

## Global Bond – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2024 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I -1,36 %. Der als Benchmark dienende Bloomberg Global Aggregate Index (Total Return, Unhedged, USD) (der Index) verbuchte im selben Zeitraum -1,69 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Als sich die Inflation der Zielmarke der US-Notenbank (Fed) von 2 % annäherte, wurde der Zinserhöhungszyklus bis September unterbrochen, als die Fed die Zinsen um 50 Basispunkte (Bp) senkte. Im November und Dezember senkte die Fed die Zinsen dann um jeweils 25 Bp. Andere große Zentralbanken senkten die Leitzinsen 2024 ebenfalls, da sich das Wachstum verlangsamte und die Inflation zurückging.
- Im Laufe des Jahres und insbesondere im vierten Quartal kam es vereinzelt zu Zins- und Marktvolatilität. Als die Fed im Dezember eine aggressive Zinssenkung vornahm und der zukünftige politische Kurswechsel der neuen Trump-Regierung für Unsicherheit sorgte, preiste der Markt zunehmend abgeschwächte zukünftige Zinssenkungen ein, und die Renditen auf Papiere der US-Regierung stiegen im letzten Monat des Jahres über die gesamte Kurve hinweg an. Im Gesamtjahr stiegen auch die Renditen auf 10-jährige Staatsanleihen der Industrieländer auf breiter Front an.
- Die Kreditspreads verengten sich im Berichtszeitraum in allen Segmenten, was auf eine besser als erwartete Wirtschaftsleistung, stabile Fundamentaldaten und eine stetige Nachfrage nach Krediten zurückzuführen ist. Die Kreditspreads von US-Anleihen mit Investment Grade, US-Hochzinsanleihen und variabel verzinsliche US-Darlehen engten sich um 19 Bp, 47 Bp bzw. 66 Bp ein. Die globalen aggregierten Spreads von Unternehmensanleihen engten sich ebenfalls um 26 Bp ein.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Einzeltitelauswahl und Übergewichtung von globalen verbrieften Krediten, insbesondere von quasistaatlichen hypothekenbesicherten Wertpapieren (MBS), forderungsbesicherten Wertpapieren, gewerblichen MBS und die Übergewichtung von Kreditrisikotransfers und nicht-staatliche MBS
  - Die Titelauswahl und Übergewichtung von globalen Investment-Grade-Anleihen und die Übergewichtung bei US-Zinssätzen
  - Hauptwährungen: Untergewichtung des chinesischen Yuan, Übergewichtung des Schweizer Franken und Untergewichtung der schwedischen Krone
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Untergewichtung von Zinsen in China
  - Die Untergewichtung des japanischen Yen
  - Die Allokation zu globalen nominalen Staatsanleihen (die durch die Einzeltitelauswahl mehr als ausgeglichen wurde) und das Engagement in Derivate auf Credit Default Swaps von Schwellenländeranleihen

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Im Berichtszeitraum haben wir vor allem das Engagement in globalen Staatsanleihen (ohne US-Anleihen) und in Kredite mit Investment Grade erhöht und das Engagement in Schwellenländeranleihen, nicht-staatlichen MBS, verbrieften Krediten und US-Staatsanleihen reduziert.
- Wir haben die Duration des Portfolios um etwa 0,15 Jahre verringert.

Wir denken, da sich die Inflationstendenzen verbessern und die Zinssenkungen der Zentralbanken im Jahr 2025 entweder pausieren oder moderater ausfallen werden, dass die Entwicklung des Wirtschaftswachstums zu einer immer wichtigeren Triebkraft für die Renditen festverzinslicher Wertpapiere werden könnte. Wir erwarten, dass sich die Zuteilung der Kreditmärkte zugunsten von Qualität fortsetzen könnte. Insgesamt glauben wir, dass 2025 eine lohnende Zeit für solche globale Anleiheinvestoren sein könnte, die sich beim Aufbau ihrer Portfolios auf Fundamentaldaten und Selektivität konzentrieren.

## Global Diversified Income FMP – 2024\* – Bericht des Investment-Managers

Für den Zeitraum vom 1. Januar 2024 bis zur Schließung des Portfolios am 28. Juni 2024 betrug die Gesamrendite für die Thesaurierende Klasse USD I 2,79 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die kurzfristigen Zinssätze in den Industrieländern stiegen im Berichtszeitraum an, was zum Teil auf die nur langsamen Fortschritte im Kampf gegen die Inflation und eine verzögerte geldpolitische Lockerung durch die meisten großen Zentralbanken zurückzuführen war.
- Die Kreditspreads von globalen Titeln mit und ohne Investment Grade („IG“) verengten sich im Berichtszeitraum, woraus solide Nachfrage für diese Anlagen sprach.
- Die Performance der Märkte für festverzinsliche Wertpapiere war im Berichtszeitraum gemischt, wobei zinsensitive Wertpapiere vor dem Hintergrund steigender Zinsen allgemein eine Underperformance verbuchten.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Positivbeiträge zur absoluten Rendite:
  - Das Engagement in IG-Unternehmensanleihen aus Industrieländern.
  - Das Engagement in Unternehmensanleihen aus Schwellenmärkten.
  - Das Engagement in Hochzinsanleihen aus Industrieländern
- Negativbeiträge zur absoluten Rendite:
  - Aus Sektorspektive gab es keine wesentlichen Negativbeiträge.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Der Lebenszyklus des Portfolios endete am 28. Juni 2024.
- Vor dem Ende des Lebenszyklus des Portfolios war es in eine diversifizierte Mischung aus IG-Anleihen und Hochzins-Unternehmensanleihen aus Industrieländern und Unternehmensanleihen aus Schwellenländern investiert.

Mit Blick auf die Zukunft gehen wir davon aus, dass sich das globale Wachstum verlangsamen wird, denn die Auswirkungen der höheren Preise und der restriktiven Geldpolitik der Zentralbanken sind für Verbraucher und Unternehmen weiterhin spürbar. Für den Kreditmarkt lässt sich feststellen, dass die Spreads durchaus eng waren und das Risiko für den Unternehmensmarkt voll eingepreist war. Die längerfristig höheren Zinssätze haben bei einigen überlasteten Emittenten und Sektoren zu Spannungen geführt, was aktiven Managern die Möglichkeit gegeben hat, Mehrwert zu schaffen.

\* Das Portfolio wurde am 28. Juni 2024 aufgelöst.

## Global Equity Megatrends – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2024 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD 123,51 %. Der als Benchmark dienende MSCI World Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der Index) verzeichnete im selben Zeitraum 18,67 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Für Aktieninvestoren war das vergangene Jahr konstruktiv. Die potenziellen Auswirkungen von KI auf Wachstum und Produktivität haben die Lebensgeister in einem relativ stabilen Investitionsumfeld aufgefrischt.
- Da sich in der Ukraine wenig änderte, terroristische Organisationen im Nahen Osten ein wenig geschwächt wurden und das „Feuerwerk“ gegen Jahresende in Syrien schnell nachließ, hatten militärische Spannungen nur begrenzte Auswirkungen auf die globale Psychologie der Anleger. Die Beziehungen zwischen China und den Vereinigten Staaten waren auch in den letzten Tagen der Biden-Regierung weiterhin von wirtschaftlichen Scharmützeln geprägt, doch blieb der geopolitische Dialog weitgehend unverändert. In vielerlei Hinsicht wurden die Märkte 2024 durch die Beibehaltung des Status quo unterstützt.
- Die globalen Aktienmärkte entwickelten sich in diesem Kontext gut. Wichtig ist, dass die Renditen im Jahr 2024 auf mehrere Jahre mit einer soliden Performance folgten, wodurch der MSCI World Index in den letzten fünf Jahren auf eine jährliche Rendite von über 11 % kommt.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Solide Anlagerenditen im Jahr 2024 waren das Ergebnis einer profitablen Beteiligung an einer Vielzahl von Portfoliounternehmen in verschiedenen Megatrends.
  - Vistra (Energieinfrastruktur), Zeta Global (Smart Systems) und Criteo (Smart Systems).
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - ModivCare (Gesundheit & Wohlbefinden), Pets at Home (Humanisierung von Haustieren) und Scholastic (Bildung).

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Im vergangenen Jahr hat das Team zwei neue Investitionen getätigt, Chart Industries (Energieinfrastruktur) und Cisco Systems (Personalisierung von Medien).
- Das Team finanzierte diese Investitionen hauptsächlich durch neue Investorengelder und durch die Reduzierung der Gewichtung von Vistra (bewertungsbedingt).

Geduldige Investoren sollten auch in den kommenden Jahren Gelegenheiten identifizieren, um gute Renditen zu erzielen. Es ist Geduld gefragt, wobei das Investieren mit Überzeugung der Schlüssel ist. Der Fokus auf das Risikomanagement treibt die Überzeugung des Investmentteams an, selektiv in (i) Unternehmen mit sichtbaren, vorhersehbaren Wachstumsaussichten zu investieren – weil jeder dieser Faktoren von starken Megatrends unterstützt wird – und (ii) in Unternehmen mit einem Führungsteam zu investieren, mit dem das Investmentteam gerne zusammenarbeitet, und (iii) in Unternehmen zu investieren, die zu attraktiven mehrjährigen Bewertungen gehandelt werden.

## Global Flexible Credit Income – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2024 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD 18,43 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Als sich die Inflation der Zielmarke der US-Notenbank (Fed) von 2 % annäherte, wurde der Zinserhöhungszyklus bis September unterbrochen, als die Fed die Zinsen um 50 Basispunkte (Bp) senkte. Im November und Dezember senkte die Fed die Zinsen dann um jeweils 25 Bp. Andere große Zentralbanken senkten die Leitzinsen 2024 ebenfalls, da sich das Wachstum verlangsamte und die Inflation zurückging.
- Im Laufe des Jahres und insbesondere im vierten Quartal kam es vereinzelt zu Zins- und Marktvolatilität. Als die Fed im Dezember eine aggressive Zinssenkung vornahm und der zukünftige politische Kurswechsel der neuen Trump-Regierung für Unsicherheit sorgte, preiste der Markt zunehmend abgeschwächte zukünftige Zinssenkungen ein, und die Renditen auf Papiere der US-Regierung stiegen im letzten Monat des Jahres über die gesamte Kurve hinweg an. Im Gesamtjahr stiegen auch die Renditen auf 10-jährige Staatsanleihen der Industrieländer auf breiter Front an.
- Die Kreditspreads verengten sich im Berichtszeitraum in allen Segmenten, was auf eine besser als erwartete Wirtschaftsleistung, stabile Fundamentaldaten und eine stetige Nachfrage nach Krediten zurückzuführen ist. Die Kreditspreads von US-Anleihen mit Investment Grade, US-Hochzinsanleihen und variabel verzinslichen US-Darlehen engten sich um 19 Bp, 47 Bp bzw. 66 Bp ein. Die globalen aggregierten Spreads von Unternehmensanleihen engten sich ebenfalls um 26 Bp ein.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur absoluten Rendite:
  - Das Engagement in US-amerikanischen Krediten mit Investment Grade, US-Hochzinsanleihen und paneuropäischen Investment-Grade-Anleihen leisteten den größten Beitrag zur Performance
  - Das Engagement in besicherten Schuldtiteln (Collateralized Loan Obligations, CLOs) und US-Staatsanleihen folgten auf Platz zwei
  - Das Engagement in Bankkrediten und Kreditrisikotransfers trugen ebenfalls zur Wertentwicklung bei, wenn auch in geringerem Maße
- Negativbeiträge zur absoluten Rendite:
  - Aus Sektorperspektive gab es keine wesentlichen Negativbeiträge.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Portfolio war in verschiedenen Kreditsektoren sowie über Ratingkategorien und Regionen investiert.
- Das Engagement in Hartwährungsanleihen aus Schwellenländern und US-Staatsanleihen haben wir reduziert, wohingegen wir das Engagement in Krediten ohne Investment Grade, verbrieften Kredite und (leicht) in Investment-Grade-Krediten erhöht haben.
- Die Duration des Portfolios war Ende 2024 gegenüber dem Jahresende 2023 unverändert.

Wir denken, da sich die Inflationstendenzen verbessern und die Zinssenkungen der Zentralbanken im Jahr 2025 entweder pausieren oder moderater ausfallen werden, dass die Entwicklung des Wirtschaftswachstums zu einer immer wichtigeren Triebkraft für die Renditen festverzinslicher Wertpapiere werden könnte. Wir erwarten, dass sich die Zerteilung der Kreditmärkte zugunsten von Qualität fortsetzen könnte. Insgesamt glauben wir, dass 2025 eine lohnende Zeit für solche globale Anleiheinvestoren sein könnte, die sich beim Aufbau ihrer Portfolios auf Fundamentaldaten und Selektivität konzentrieren.

## Global High Yield Engagement – Bericht des Investment-Managers.

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2024 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD 18,56 %. Der als Benchmark dienende ICE BofA Global High Yield Constrained Index (Total Return, Hedged, USD) (der Index) verbuchte im selben Zeitraum 9,24 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Der globale Markt für Hochzinsanleihen schloss das Jahr 2024 mit soliden Renditen ab, die durch ein robustes Wirtschaftswachstum und eine sich abschwächende Inflation angetrieben wurden. Die Kreditspreads verengten sich im Berichtszeitraum in allen Segmenten, was auf eine besser als erwartete Wirtschaftsleistung, stabile Fundamentaldaten und eine stetige Nachfrage nach Krediten zurückzuführen ist.
- Abgesehen von den risikoreicheren osteuropäischen und chinesischen Immobiliensektoren hielten sich die aggregierten Fundamentaldaten von Hochzinsemitenten in Bezug auf das Wachstum des Gewinns vor Zinsen, Steuern und Abschreibungen (EBITDA), der freie Cashflow, die Zinsdeckung und der Verschuldungsgrad in einem recht günstigen Bereich.
- Die Ausfallquoten in den USA, in Europa und anderen Industrieländern dürften durchschnittlich bleiben, nachdem sie sich von den im Vorjahr erreichten historischen Tiefstständen nach oben bewegt haben. Die Ausfälle in Schwellenländern (EM) haben zwar zugenommen, doch konzentrieren wir uns auf ausgewählte Gelegenheiten außerhalb der Regionen und Sektoren mit einem höheren Risiko. Unsere Erwartung eines in etwa durchschnittlichen Ausfallrisikos stützt sich auf unsere Bottom-up-Beurteilung von Emittenten und wird getragen von dem qualitativ höherwertigen Ratingsmix im globalen Hochzinssegment (60 % der Emittenten mit Kreditratings von BB), von weniger aggressiven Neuemissionen, weniger kurzfristigen Fälligkeiten sowie einem Energiesektor, der deutlich solider ist als in den letzten Zyklen.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite
  - Aus Sektorperspektive trugen die Positionierungen in Telekommunikation, Technologie & Elektronik sowie Verpackungen am meisten zur Performance im Berichtszeitraum bei. Aus Perspektive der Ratings leisteten die Positionierungen bei Emittenten mit den Ratings BB, B sowie BBB und darüber den besten Wertbeitrag zur Performance im Berichtszeitraum.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Aus sektoraler Sicht kam es durch die Positionierungen in den Sektoren Großmärkte und diversifizierte Finanzdienstleistungen zu den größten Abzügen von der Performance im Berichtszeitraum. Aus Sicht der Ratings beeinträchtigten Titel mit CCC-Rating und darunter die Performance am stärksten.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Im Rahmen unserer Hochzinsstrategien haben wir selektiv in qualitativ höherwertige B- und BB-Anleihen umgeschichtet, wo die Preise im Verhältnis zu den zugrunde liegenden Fundamentaldaten attraktiv blieben und die Ausfallerwartungen niedrig waren.
- Bei den CCC-Positionierungen hatten wir eine differenzierte Sicht auf die einzelnen Kredite, die auf unseren hausinternen Ratings und den Einschätzungen der Analysten zu den einzelnen Krediten beruhte. Zudem konzentrierten wir uns auf Umschichtungen innerhalb von Branchen und Risikokategorien des Marktes, um die Widerstandsfähigkeit gegenüber Preismacht- und Lohnkostentrends zu maximieren, sofern diese fortbestanden. Außerdem haben wir das Verschuldungsprofil des Portfolios, wo dies ohne Verluste möglich war, heruntergefahren.
- Unser Plan war es, das Portfolio in erster Linie auf BB- und höherwertige B-Kreditrisiken zu konzentrieren (auf Basis unserer internen Kreditratings) und Sektoren überzugewichten, die wir im aktuellen Umfeld als widerstandsfähig einstufen.

Wir sind der Meinung, dass die Bewertungen von Hochzinsanleihen eine mehr als angemessene Entschädigung für die mehr oder weniger durchschnittlichen Ausfallerwartungen darstellen, die Anleihen weiterhin dauerhafte Erträge bieten sollten und im Vergleich zu anderen festverzinslichen Alternativen attraktiv sind. Makroökonomische Daten, die zukünftige politische Unsicherheit durch die neue Trump-Regierung, geopolitische Bedenken und die allgemeine Dynamik des Kreditzyklus können den Markt für Hochzinsanleihen zwar täglich beeinflussen, doch konzentrieren sich unsere Analysten weiterhin auf die spezifischen Fundamentaldaten einzelner Emittenten, wobei die Analysten die Basis- und Abwärtsszenarien bewerten. Wir sind der Meinung, dass wir mit unserem fundamentalen Bottom-up-Kreditresearch – mit Konzentration auf die Auswahl von Wertpapieren, die Vermeidung von Bonitätsherabstufungen und die ausschließliche Aufnahme der „besten Ideen“ in die Portfolios – gut aufgestellt sind, um von eventueller Volatilität zu profitieren.

## Global Investment Grade Credit – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2024 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 4,54 %. Der Bloomberg Global Aggregate Corporate Index (Total Return, abgesichert, USD) (der Index) rentierte im selben Zeitraum 3,69 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendeneträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die Märkte beendeten das Jahr in der Erwartung, dass die US-Notenbank (Fed) die Senkung des Leitzinses im Jahr 2025 angesichts der Erfolge bei der Bekämpfung der Inflation in der zweiten Jahreshälfte schrittweise fortsetzen wird. Der Ausgang der US-Wahlen mit einem republikanischen Erdrutschsieg bei der Präsidentschaftswahl und im Kongress hat auch zu Unsicherheit in Bezug auf eine Reihe von politischen Maßnahmen geführt, die Aufwärtsrisiken für die US-Inflation bürden.
- In den Vereinigten Staaten verlangsamten sich das Wachstum und der Arbeitsmarkt kühlt ab, doch waren beide weiterhin günstig. Außerhalb der Vereinigten Staaten blieben die makroökonomischen Aussichten weniger vorteilhaft. Die Fed und die Bank of England haben ihre restriktive Geldpolitik beibehalten, auch wenn beide voraussichtlich im Jahr 2025 eine allmähliche Lockerung vornehmen werden. Die Europäische Zentralbank senkte ihren Leitzins weiter, da bei der Inflation erhebliche Fortschritte erzielt wurden und die Erwartung vorherrscht, dass die Inflationsaussichten ihr Ziel erreichen werden.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Vorrangig unbesicherte Anleihen aus den Sektoren Immobilien, Banken und Versicherungen waren der Motor der Outperformance.
  - Nachrangige Tier-2-Schuldtitel von Finanzemittenten und hybride Unternehmensanleihen im Versorgungs- und im Immobiliensektor.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Kommunikation, Investitionsgüter und Technologie resultierten in leichten Wertabzügen.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Wir beteiligten uns in der zweiten Jahreshälfte 2024 an einer Reihe attraktiv bepreister Neuemissionen auf dem Primärmarkt, die dem Portfolio eine starke relative Outperformance bescherten.
- Die Durationsposition des Portfolios wurde leicht über dem Niveau der Benchmark gehalten, was vor allem auf die Bestände an Unternehmensanleihen in Euro und Pfund Sterling zurückzuführen ist.

Zu Beginn des Jahres 2025 bleiben wir in manchen der defensiveren Sektoren wie Versorger und Banken übergewichtet, während wir gleichzeitig unser Engagement bei Titeln mit einem höheren Beta sowie in einigen zyklischen Sektoren reduzieren. Wir bleiben übergewichtet in Sektoren mit starken Fundamentaldaten, die sich derzeit im Verschuldungsabbau befinden, wie Kommunikationsdienste, die unseres Erachtens weiterhin von einem moderaten Zinsumfeld geprägten Umfeld profitieren werden. Angesichts der starken relativen Outperformance von Immobilienemittenten im Jahr 2024 haben wir damit begonnen, unser Engagement hier zu reduzieren. Wir sind untergewichtet in Sektoren wie nicht-zyklische Konsumgüter, die wir für stärker gefährdet einschätzen, Fremdkapital zur Finanzierung von Aktionärsrenditen über Aktienrückkäufe und M&A-Aktivitäten einzusetzen und zu relativ angespannten Bewertungen gehandelt werden.

## Global Opportunistic Bond – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2024 betrug die Gesamterrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD 12,59 %. Der als Benchmark dienende Bloomberg Global Aggregate Index (Total Return, Hedged, USD) (der Index) verbuchte im selben Zeitraum 3,40 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamterrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Als sich die Inflation der Zielmarke der US-Notenbank (Fed) von 2 % annäherte, wurde der Zinserhöhungszyklus bis September unterbrochen, als die Fed die Zinsen um 50 Basispunkte (Bp) senkte. Im November und Dezember senkte die US-Notenbank die Zinsen um jeweils 25 Bp. Andere große Zentralbanken senkten die Leitzinsen 2024 ebenfalls, da sich das Wachstum verlangsamte und die Inflation zurückging.
- Im Laufe des Jahres und insbesondere im vierten Quartal kam es vereinzelt zu Zins- und Marktvolatilität. Als die Fed im Dezember eine aggressive Zinssenkung vornahm und der zukünftige politische Kurswechsel von Trump 2.0 für Unsicherheit sorgte, preiste der Markt zunehmend abgeschwächte zukünftige Zinssenkungen ein und die Renditen auf Papiere der US-Regierung stiegen im letzten Monat des Jahres über die gesamte Kurve hinweg an. Im Gesamtjahr stiegen auch die Renditen auf 10-jährige Staatsanleihen der Industrieländer auf breiter Front an.
- Die Kreditspreads verengten sich im Berichtszeitraum in allen Segmenten, was auf eine besser als erwartete Wirtschaftsleistung, stabile Fundamentaldaten und eine stetige Nachfrage nach Krediten zurückzuführen ist. Die Kreditspreads von US-Anleihen mit Investment Grade, US-Hochzinsanleihen und variabel verzinsliche US-Darlehen gaben um 19 Bp, 47 Bp bzw. 66 Bp nach. Die globalen aggregierten Spreads von Unternehmensanleihen engten sich ebenfalls um 26 Bp ein.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Positionierung in europäischen Hochzinsanleihen sowie die Einzeltitelauswahl und Positionierung in Schultiteln aus Schwellenländern in Hartwährung
  - Die Titelauswahl in globalen Krediten mit Investment Grade.
  - Die Einzeltitelauswahl und Positionierung und quasistaatlichen Mortgage Backed Securities (MBS).
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Große Währungsengagements schlossen eine Untergewichtung des japanischen Yen sowie Übergewichtungen des mexikanischen Peso und des südkoreanischen Won ein
  - Die Positionierung in hochverzinslichen Credit Default Swaps (CDX) und CDX-Schwellenmarktanleihen
  - Die Einzeltitelauswahl unter globalen nominalen Staatsanleihen

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Im zwölfmonatigen Berichtszeitraum haben wir die Gewichtung von Schwellenmarktanleihen, globalen Staatsanleihen und (leicht) in europäischen Hochzinsanleihen erhöht, während das Engagement in quasistaatlichen MBS von Behörden, verbrieften Krediten und Investment-Grade-Krediten reduziert haben
- Zum Jahresende hielten wir an einer übergewichteten Durationsposition fest.

Wir denken, da sich die Inflationstendenzen verbessern und die Zinssenkungen der Zentralbanken im Jahr 2025 entweder pausieren oder moderater ausfallen werden, sodass die Entwicklung des Wirtschaftswachstums zu einer immer wichtigeren Triebkraft für die Renditen festverzinslicher Wertpapiere wird. Wir denken, dass sich die Zerteilung der Kreditmärkte zugunsten von Qualität fortsetzen wird. Insgesamt glauben wir, dass 2025 eine lohnende Zeit für solche globale Anleiheinvestoren sein könnte, die sich beim Aufbau ihrer Portfolios auf Fundamentaldaten und Selektivität konzentrieren.

## Global Real Estate Securities\* – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2024 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I -3,13 %. Die Benchmark, der FTSE EPRA/Nareit Developed Real Estate Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der Index) verbuchte im gleichen Zeitraum 1,00 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Globale REITs erholten sich in der zweiten Hälfte des Jahres 2024, als die Zentralbanken die Zinsen senkten und sich die Stimmung der Anleger verbesserte. Trotz eines Rückgangs im Dezember, bedingt durch die vorsichtige Haltung der US-Notenbank zu Zinssenkungen im Jahr 2025, schlossen REITs das Jahr mit einem einstelligen Plus ab.
- Die Vereinigten Staaten und Australien führten die regionale Performance an, wobei die Sektoren Gesundheitswesen und Rechenzentren aufgrund der gestiegenen Nachfrage und des begrenzten Angebots eine deutliche Outperformance verbuchten.
- Alles in allem brachte der MSCI All Country World Index Berichtszeitraum eine Rendite von 17,49 % ein. Der Index kam demgegenüber auf 1,00 %. Immobilienwertpapiere wurden durch die Volatilität der Zinssätze beeinträchtigt.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Einzeltitelauswahl im Sektor Gesundheitswesen
  - Die Einzeltitelauswahl im Sektor der sonstigen Speciality REITs
  - Die Untergewichtungen von Schweden und Japan
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Einzeltitelauswahl im Sektor Büroraum.
  - Die Einzeltitelauswahl im Sektor Wohnraum.
  - Die Übergewichtungen von Belgien und Kanada

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Der Sektorpositionierung des Portfolios lag überwiegend eine Bottom-up-Einzeltitelauswahl zugrunde. Im Verlauf des Berichtszeitraums bestanden die größten Übergewichtungen im Verhältnis zum Index in den Sektoren Infrastruktur-REITs und Wohnimmobilien. Im Gegensatz dazu waren die im Portfolio gegenüber dem Index am stärksten untergewichteten Sektoren die REITs in den Segmenten Büroraum, Hotels und Beherbergung.
- Nach Ländern bestanden die größten Übergewichtungen in Kanada und Spanien, die größten Untergewichtungen in den Vereinigten Staaten und Schweden.

Das Portfolio wurde am 31. Dezember 2024 geschlossen. Wir danken Ihnen für die Gelegenheit, Sie bei der Erfüllung Ihrer finanziellen Bedürfnisse zu unterstützen.

\* Das Portfolio wurde am 31. Dezember 2024 aufgelöst.

## Global Sustainable Equity – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2024 betrug die Gesamterrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD 17,69 %. Der als Benchmark dienende MSCI World Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der Index) verzeichnete im selben Zeitraum 18,67 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamterrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Das Jahr 2024 begann mit starken globalen Aktienmärkten, angetrieben durch ein robustes US-Wirtschaftswachstum und positive globale Daten, wobei die Outperformance von Japan erwähnenswert ist.
- Die Inflationssorgen hielten bis ins zweite Quartal an, was die Erwartungen an weitere Zinssenkungen durch die Zentralbanken senkte, doch konnten Aktien aus Industrieländern positive Renditen erzielen.
- Im dritten Quartal zeigten sich die Aktienmärkte stabil, da die Inflation – unterstützt durch Maßnahmen der Zentralbanken und chinesische Konjunkturmaßnahmen, wovon Asien ohne Japan profitierte – zurückging.
- Der Ausgang der US-Präsidentenwahlen im letzten Quartal kurbelte die US-Aktienkursentwicklung an, während die Stärke des US-Dollars und die Sorge vor drohenden Handelszöllen die Schwellenländer vor Herausforderungen stellten.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Das Ergebnis der Sektorallokation war positiv, was auf die Outperformance der beiden übergewichteten Sektoren Kommunikationsdienstleistungen und Finanzen sowie auf die Underperformance der untergewichteten Sektoren Versorgungsunternehmen, Werkstoffe, Immobilien und insbesondere Energie zurückzuführen ist.
  - Auf Aktienebene trugen unsere Beteiligungen an 3i Group (Finanzen), Amazon.com (Nicht-Basiskonsumgüter), Netflix (Kommunikationsdienste) und Recruit (Digitale Unternehmen) am meisten zur Performance bei.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Underperformance lässt sich vollständig durch die Einzeltitelauswahl erklären, wobei die Bereiche Informationstechnologie, Basiskonsumgüter, Nicht-Basiskonsumgüter und Industrie für einen negativen Wertbeitrag verantwortlich zeichneten.
  - Unsere Beteiligungen an Nestlé, Estée Lauder (Konsumgüter), Nike (Nicht-Basiskonsumgüter), Alfen (Industrie), SolarEdge und Adobe sowie die Untergewichtung von Nvidia (Informationstechnologie) waren die größten Negativfaktoren.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Wir haben mehrere Beteiligungen aufgelöst, deren Wettbewerbsposition unter Druck geriet. Im Verbrauchersektor haben wir HelloFresh, Ulta Beauty und Estée Lauder verkauft und im Sektor für saubere Energie haben wir uns von SolarEdge und Alfen getrennt.
- Die Erlöse aus diesen Verkäufen wurden in mehrere neue Portfoliobeteiligungen reinvestiert, die den etablierten Akteuren Marktanteile abnehmen, da ihre Technologiekompetenz ihre Wettbewerbsposition stärkt: Uber (Industrie), Kinsale, Costar (Finanzen) und Spotify (Kommunikationsdienste).
- Schließlich haben wir das Engagement des Portfolios im Halbleitersektor erhöht, der durch den Vormarsch der KI ein starkes Wachstum verzeichnet. Wir haben Positionen in Nvidia, Broadcom und TSMC initiiert.

Unser Ausblick auf den Aktienmarkt deutet auf ein Potenzial, das über die größten Unternehmen im Index hinausgeht. Bei einem erwarteten überdurchschnittlichen Wachstum in den Vereinigten Staaten und einer kontrollierten Inflation könnte den Anlegern eine auf der Ertragsentwicklung beruhende Performance und eine Ausweitung der Marktführerschaft zugutekommen. Wir glauben, dass unser Portfolio gut positioniert ist, um davon zu profitieren, da es sich aus einem diversifizierten Pool qualitativ hochwertiger und widerstandsfähiger Unternehmen zusammensetzt, die einen Fokus auf Nachhaltigkeit haben und dieser ihren Wettbewerbsvorteil stärkt.

## Global Value – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2024 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD 19,95 %. Im selben Zeitraum erzielten der MSCI All Country World Value Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der „übergeordnete Index“) und der MSCI All-Country World Index (ACWI) (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der „Sekundärindex“) eine Rendite von 10,76 % bzw. 17,49 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die globalen Aktienmärkte beendeten das Jahr 2024 mit positiven Renditen, wobei es in der zweiten Jahreshälfte zu volatilen Phasen kam, die sich aus der plötzlichen Auflösung des Yen-Carry-Trade im August ergaben, gefolgt von politischer Unsicherheit in den Vereinigten Staaten und Europa.
- Die Sektoren Informationstechnologie und Kommunikationsdienstleistungen verzeichneten insgesamt die beste Wertentwicklung, wobei der KI-Optimismus Anfang 2024 seinen Höhepunkt erreichte und sich später im Jahr stabilisierte.
- Die Finanzpolitik vieler Länder verlagerte sich auf Zinssenkungen, wobei die US-Notenbank und die Europäische Zentralbank Zinssenkungen bis ins Jahr 2025 hinein signalisierten.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Übergewichtung im Sektor Informationstechnologie und die Untergewichtung von Werkstoffen
  - Die Wertpapierauswahl im Finanzsektor, der Informationstechnologie und bei Kommunikationsdienstleistungen
  - Die Einzeltitelauswahl in Schwellenmärkten und den Vereinigten Staaten
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Untergewichtung von Finanzwerten
  - Die Wertpapierauswahl in Energie, unter Industrierwerten und im Gesundheitswesen
  - Die Einzeltitelauswahl in Europa und in Großbritannien

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Portfolio behielt seine Übergewichtung im Sektor Informationstechnologie bei. Dabei konzentrierte sich der Großteil des Engagements auf Halbleiter und Hardware, wo wir die meisten Value-Kandidaten innerhalb des Sektors fanden.
- Das Portfolio war weiterhin auf Aktien mit niedrigerer Duration und hoher Rentabilität ausgerichtet, da weltweit zwar Zinssenkungen eingeleitet wurden, die Zinssätze aber weiterhin hoch sind.

Wir denken, dass das Portfolio für das im Jahr 2025 erwartete Marktumfeld gut positioniert ist. Wir sind der Meinung, dass der historische Kompromiss zwischen Zinsen und Inflation wiederhergestellt ist, was unsere Portfoliopositionierung zugunsten attraktiver und rentabler Unternehmen unterstützt. Darüber hinaus sind wir der Auffassung, dass der Schwerpunkt des Portfolios auf gute Kapitaldisziplin angesichts der möglichen Kreditverknappung und des unsicheren Handelsumfelds ebenfalls von Vorteil sein könnte.

## High Yield Bond – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2024 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD 18,02 %. Der als Benchmark dienende ICE BofA US High Yield Constrained Index (Total Return, USD) (der „Index“) verbuchte im selben Zeitraum 8,20 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Der Markt für Hochzinsanleihen beendete den Berichtszeitraum mit soliden Renditen, die durch ein robustes Wirtschaftswachstum und eine sich abschwächende Inflation angetrieben wurden. Die Kreditspreads verengten sich im Berichtszeitraum in allen Segmenten, was auf eine besser als erwartete Wirtschaftsleistung, stabile Fundamentaldaten und eine stetige Nachfrage nach Krediten zurückzuführen ist.
- Die aggregierten Fundamentaldaten von Hochzinsemittenten hielten sich in Bezug auf das Wachstum des Gewinns vor Zinsen, Steuern und Abschreibungen (EBITDA), den freien Cashflow, die Zinsdeckung und den Verschuldungsgrad in recht günstigen Bereichen.
- Zwar ist die Ausfallquote von ihren Tiefstständen im Jahr 2022 gestiegen, doch erwarten wir für 2025, dass sie in einem Bereich knapp um den langfristigen Durchschnitt bleiben wird. Dieser Ausblick stützt sich auf unsere Bottom-up-Beurteilung von Emittenten und wird getragen von dem qualitativ höherwertigen Ratingsmix im Hochzinssegment (ca. 50 % der Emittenten mit Kreditratings von BB), von weniger aggressiven Neuemissionen, weniger kurzfristigen Fälligkeiten sowie einem Energiesektor, der deutlich solider ist als in den letzten Zyklen.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite
  - Aus sektoraler Sicht trugen die Positionierungen in Telekommunikation, bei Versorgern und Verpackungen am meisten zur Performance im Berichtszeitraum bei. Aus Perspektive der Ratings leisteten die Positionierungen bei B- und BB-Emittenten den besten Wertbeitrag zur Performance im Berichtszeitraum.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Aus Sektorsicht kam es durch die Positionierungen in den Sektoren Großmärkte, Technologie & Elektronik, Nahrungsmittel- & Getränke sowie Tabak zu den heftigsten Abzügen von der Performance im Berichtszeitraum. Aus Sicht der Ratings beeinträchtigten Titel mit CCC-Rating und darunter die Performance am stärksten.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Im Rahmen unserer Hochzinsstrategien haben wir selektiv in qualitativ höherwertige B- und BB-Anleihen umgeschichtet, wo die Preise im Verhältnis zu den zugrunde liegenden Fundamentaldaten attraktiv blieben und die Ausfallerwartungen niedrig waren.
- Bei den CCC-Positionierungen hatten wir eine differenzierte Sicht auf die einzelnen Kredite, die auf unseren hausinternen Ratings und den Einschätzungen der Analysten zu den einzelnen Krediten beruhte. Zudem konzentrierten wir uns auf Umschichtungen innerhalb von Branchen und Risikokategorien des Marktes, um die Widerstandsfähigkeit gegenüber Preismacht- und Lohnkostentrends zu maximieren, sofern diese fortbestanden. Außerdem haben wir das Verschuldungsprofil des Portfolios, wo dies ohne Verluste möglich war, heruntergefahren.
- Unser Plan war es, das Portfolio in erster Linie auf BB- und höherwertige B-Kreditrisiken zu konzentrieren (auf Basis unserer internen Kreditratings) und Sektoren überzugewichten, die wir im aktuellen Umfeld als widerstandsfähig einstufen.

Wir sind der Meinung, dass die Bewertungen von Hochzinsanleihen eine mehr als angemessene Entschädigung für die mehr oder weniger durchschnittlichen Ausfallerwartungen darstellen, die Anleihen weiterhin dauerhafte Erträge bieten sollten und im Vergleich zu anderen festverzinslichen Alternativen attraktiv sind. Makroökonomische Daten, die zukünftige politische Unsicherheit durch die neue Trump-Regierung, geopolitische Bedenken und die allgemeine Dynamik des Kreditzyklus können den Markt für Hochzinsanleihen zwar täglich beeinflussen, doch konzentrieren sich unsere Analysten weiterhin auf die spezifischen Fundamentaldaten einzelner Emittenten, wobei die Analysten die Basis- und Abwärtsszenarien bewerten. Wir sind der Meinung, dass wir mit unserem fundamentalen Bottom-up-Kreditresearch – mit Konzentration auf die Auswahl von Wertpapieren, die Vermeidung von Bonitätsherabstufungen und die ausschließliche Aufnahme der „besten Ideen“ in die Portfolios – gut aufgestellt sind, um von eventueller Volatilität zu profitieren.

## InnovAsia – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2024 betrug die Gesamtertragsrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD 19,93 %. Der als Benchmark dienende MSCI All-Country Asia Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der Index) verbuchte im selben Zeitraum ein Plus von 10,63 %. (Die Performance für alle Anteilsklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtertragsrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die wichtigsten asiatischen Aktienmärkte beendeten das Jahr im positiven Bereich, da die Zentralbanken in der Region ihre Geldpolitik lockerten und ein KI-Boom die Technologieaktien beflügelte.
- Der taiwanische Aktienmarkt führte die Gewinne an, da dieser Markt einen Fokus auf Technologieaktien hat. Japanische Unternehmen profitierten unterdessen von Unternehmensreformen und einem schwachen Yen. Hinzu kam, dass sich die chinesischen Märkte im dritten Quartal erholten und die indischen Märkte kontinuierlich Zuflüsse erhielten.
- Südkorea beendete das Jahr im Minus, da Zollängste und politische Unruhen die Unsicherheit verstärkten.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Aktienauswahl in Indien und Südkorea
  - Die Allokation zu Südostasien, einem Nutznießer der Trends zur Umgestaltung der Lieferkette
  - Das Engagement in Gewinnern der KI-Infrastruktur, einschließlich KI-Server, Speicher mit hoher Bandbreite und Hochgeschwindigkeitsnetzwerke
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Untergewichtung von China
  - Japanische Small-Mid-Caps und Wachstumswerte im Softwaresegment

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Ein erhöhtes Engagement bei Wegbereitern und Nutznießern von KI aufgrund der starken Nachfragetrends und des Gewinnwachstums.
- Das erhöhte Engagement in Software in der zweiten Jahreshälfte aufgrund einer verbesserten Stimmung
- Die reduzierte Gewichtung in Südostasien und in Südkorea sowie die Umschichtung nach Japan, Taiwan und China

Vor dem Hintergrund der niedrigeren Zinssätze denken wir, dass die Argumente für asiatische Small-Mid-Cap-Aktien immer attraktiver werden. Wir sind in Bezug auf die Wachstumschancen in Asien optimistisch, vor allem bei modernsten Halbleitern, durch strukturelles Wachstum in KI, robuste Investitionsausgaben bei Datenzentren sowie die starke Zunahme Lifestyle-bezogener digitaler Inhalte.

## Japan Equity Engagement – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2024 betrug die Gesamterrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse JPY I 14,93 %. Der MSCI Japan Small Cap Net Index (Total Return, JPY) (der „Index“) verzeichnete im selben Zeitraum ein Plus von 16,35 %. (Die Performance für alle Anteilsklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamterrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendeneträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Japanische Aktien verzeichneten ein positives erstes Halbjahr, in dem die Benchmarkindizes im Juli auf Allzeithochs kletterten. Die Stabilisierung der Inflation und höhere Löhne fachten gleichzeitig die Erwartung an, dass die sogenannten „verlorenen Jahrzehnte“ Japans bald der Vergangenheit angehören. Derweil meldeten die Unternehmen solide Gewinne durch einen abgeschwächten Yen und steigerten die Aktionärsrenditen erneut.
- Die Stimmung der Anleger gegenüber japanischen Aktien trübte sich nach dem Rücktritt des Premierministers ein, was die politischen Unsicherheiten verstärkte, während die Zinserhöhungen der Bank of Japan (BOJ) zur Auflösung von Yen-Carry-Positionen führten. Dies, in Verbindung mit einer geringeren Liquidität, wird als der Auslöser für den historischen Börsencrash zu Anfang August betrachtet.
- Japanische Small Caps konnten mit ihren Large-Caps-Pendants nicht mithalten, da die Anleger darauf spekulierten, dass der schwache Yen die Importkosten erhöhen und die Gewinne von Large-Cap-Exporteuren steigern würde, während Zinserhöhungen durch die BOJ das Wachstum von auf den Inlandsmarkt fokussierten und stärker fremdfinanzierten Small-Cap-Unternehmen dämpfen könnten.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Einzeltitelauswahl in den Bereichen Nicht-Basiskonsumgüter und Konsumgüter sowie unsere Untergewichtung von Werkstoffen und unsere Übergewichtung von Kommunikationsdienstleistungen
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Einzeltitelauswahl unter Industrie- und Finanzwerten sowie unsere Untergewichtung von Informationstechnologie.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Wir haben unsere Gewichtung von Titeln aus dem Industriesektor erhöht, insbesondere im Bereich der spezialisierten Bauunternehmen. Wir erwarten von ihnen aufgrund der anhaltenden Investitionen in Rechenzentren und der damit verbundenen Infrastrukturen ein starkes Umsatz- und Rentabilitätswachstum.
- Andererseits haben wir unsere Positionen im Bereich der Finanzwerte und in der Informationstechnologie aufgrund von Bewertungen sowie aufgrund eines, durch schwache Kapitalinvestitionen im Halbleiterbereich bedingtes geringeren Gewinnwachstums reduziert.
- Wir arbeiteten weiterhin mit den Managementteams unserer Beteiligungsgesellschaften in wichtigen Fragen zusammen, beispielsweise in puncto Bilanzeffizienz und der Zusammensetzung des Geschäftsportfolios, was zu positiven Ergebnissen geführt hat.

Wir beobachten immer noch kurzfristige Unsicherheiten in Bezug auf die Geld- und Fiskalpolitik der Vereinigten Staaten und Japans sowie geopolitische Spannungen als Hauptrisikofaktoren. Dies gesagt, glauben wir aber dennoch, dass die Bank of Japan ihre Geldpolitik allmählich normalisieren könnte, was die Währung stärken und somit den Druck durch eine importierte Inflation möglicherweise verringern könnte. Dies könnte in Kombination mit der Möglichkeit höherer Löhne zur Stützung der Binnenwirtschaft beitragen. Darüber hinaus glauben wir, dass die Aufsichtsbehörden ebenfalls versuchen könnten, die Reformagenda auf kleine und mittelgroße Unternehmen auszudehnen, um die Kapitalrenditen zu steigern. Unserer Ansicht nach sind all diese Faktoren ein gutes Vorzeichen für die Erholung japanischer Aktien auf breiter Front.

## Macro Opportunities FX\* – Bericht des Investment-Managers

Für den Zeitraum vom 1. Januar 2024 bis zur Schließung des Portfolios am 8. Februar 2024 betrug die Gesamrendite für die Thesaurierende Klasse EUR I 1,17 %. Der als Benchmark dienende ICE BofA 0-1 Year AAA Euro Government Index (Total Return, EUR) (der Index) verzeichnete im selben Zeitraum 0,27 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Der Devisenmarkt wies im Berichtszeitraum nur eine geringe Volatilität auf.
- Die Handelsspannen waren gering.
- Der Markt wurde angesichts der geldpolitischen Aussichten der Vereinigten Staaten mit einem hohen Beta gehandelt.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Kurzfristige und taktische Handelsmöglichkeiten resultierten in einer positiven Performance im Berichtszeitraum.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Längerfristige Faktoren wie die Bewertung schmälerten die Performance ein wenig.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Portfolio wurde am 8. Februar 2024 geschlossen. Wir danken Ihnen für die Gelegenheit, Sie bei der Erfüllung Ihrer finanziellen Bedürfnisse zu unterstützen.

\* Das Portfolio wurde am 8. Februar 2024 aufgelöst.

## Next Generation Connectivity – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2024 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD 134,80 %. Der als Benchmark dienende MSCI All Country World Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der Index) verbuchte im selben Zeitraum ein Plus von 17,49 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Das wirtschaftliche Umfeld erwies sich angesichts robuster Wirtschaftsdaten als robust. Die Volatilität blieb vor dem Hintergrund der anhaltenden Inflation, der veränderten Markterwartungen hinsichtlich der Zinssenkung der US-Notenbank und der US-Präsidentenwahlen erhöht.
- Der globale Aktienmarkt erzielte positive Renditen, angetrieben von erstens großen Technologieunternehmen, die von starken Unternehmensgewinnen profitierten, und zweitens von Unternehmen im KI-Raum, die von der steigenden Nachfrage profitierten.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur absoluten Rendite:
  - Sektorspezifisch: Allokation zu Halbleitern und die Einzeltitelauswahl in Technologie, Hardware & Ausrüstung, Industrie und Software
  - Regional: Die Wertpapierauswahl in Asien, wobei die Engagements in Taiwan und Japan besondere Erwähnung verdienen
  - Das Engagement bei Gewinnern im Bereich der KI-Infrastruktur, u. a. bei Unternehmen in den Segmenten Hochleistungscomputer, Energie-/Thermomanagement und Hochgeschwindigkeitsnetzwerke.
- Negativbeiträge zur absoluten Rendite:
  - Die Unternehmen im Bereich der analogen/Leistungshalbleiter während schwacher Endmärkte in der Industrie und für Autos.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Ein erhöhtes Engagement bei KI-Infrastrukturunternehmen aufgrund der starken Nachfragetrends und des Gewinnwachstums.
- Zu Beginn des Jahres wurde das Engagement in Software reduziert und in den späteren Quartalen aufgrund der verbesserten Stimmung erhöht.
- Opportunistische Gewinnrealisierung bei Titeln mit Outperformance in einem volatilen Marktumfeld, um die Renditen mitzunehmen.

Niedrigere Zinssätze sind für Technologieaktien im Allgemeinen positiv, doch könnte die makroökonomische Unsicherheit anhalten. Es herrscht nach wie vor Volatilität, sodass unser Fokus weiter auf Bereichen mit kräftigem Rückenwind für die Erträge und guter Vorhersehbarkeit liegt. Dabei folgen wir unserer Bewertungsdisziplin. Die Konnektivität der nächsten Generation ist die Grundlage für aktuelle und künftige technologische Innovationen. Nutznießer der beschleunigten Einführung von KI, eine strategische Halbleiterindustrie, und die zunehmende digitale Akzeptanz beurteilen wir optimistisch.

## Next Generation Mobility – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2024 betrug die Gesamterrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I -1,63 %. Der MSCI All Country World Index (ACWI) (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der „Index“) rentierte im selben Zeitraum 17,49 %. (Die Performance für alle Anteilsklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamterrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die Aktienmärkte verzeichneten im Laufe des Jahres 2024 robuste Gewinne und setzten damit den Aufwärtstrend des Vorjahres fort. Dieser positive Trend wurde durch einen rückläufigen Inflationsdruck und nachlassende Rezessionsängste begünstigt.
- Im Jahr 2024 ließen Large-Cap-Wachstumsaktien ihre Small- und Mid-Cap-Pendants deutlich hinter sich. Wachstumsorientierte Aktien profitierten allgemein von dem günstigen Marktumfeld, wobei Large-Cap-Wachstumsaktien die Führungsrolle zukam. Im Gegensatz dazu verbuchten Substanzwerte eine Underperformance, was die generelle Marktpräferenz für Wachstumsaktien gegenüber Substanzwerten im Laufe des Jahres verdeutlicht.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Unser übergewichtetes Engagement des IT-Sektors und die Aktienausswahl im Industriesektor trugen am stärksten zur relativen Performance bei. Die Nullallokation zu Sektoren wie dem Gesundheitswesen, Basiskonsumgüter und Energie hatten ebenfalls einen positiven Einfluss.
  - Aus geografischer Sicht leistete unsere Einzeltitelauswahl in Japan den größten Wertbeitrag.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Einzeltitelauswahl in den Sektoren Informationstechnologie und Nicht-Basiskonsumgüter schmälerte die Renditen am stärksten.
  - Geografisch gesehen, führten sowohl unsere Aktienausswahl in den Vereinigten Staaten und die marginale Untergewichtung des Landes als auch die Übergewichtung von Korea zu den größten Beeinträchtigungen für die Performance.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Die größten Positionen, die während des Berichtszeitraums in das Portfolio aufgenommen wurden: Hitachi, Kia, and Contemporary Ampere Technology.
- Die größten Positionen, die aus dem Portfolio entfernt wurden, waren Caterpillar, Trimble und Analog Devices

Mit Blick auf das Jahr 2025 rechnen wir mit einer dynamischen makroökonomischen Landschaft, da die Zentralbanken beginnen, ihre Politik auf ein geldpolitisch lockeres Umfeld, als Reaktion auf sich verändernde Daten zur Inflationskontrolle, einzustellen. Es ist ermutigend, eine Verlangsamung der Inflationsraten in wichtigen Ländern wie den Vereinigten Staaten zu beobachten, was andeutet, dass die Zentralbanken ihre Zinserhöhungen abgeschlossen haben könnten. Die jüngsten US-Wahlen sind nun abgeschlossen, doch könnten die Aktienmärkte weiterhin Schwankungen ausgesetzt sein. Trotz wirtschaftlicher Verschiebungen und politischer Unsicherheiten bleiben die zentralen Fundamentaldaten des Themas „Next Generation Mobility“ (Mobilität für die nächste Generation) stark. Wir erwarten für die zweite Jahreshälfte 2024 eine weitere Marktexpansion und ein robustes Wachstum für autonome und elektrische Fahrzeuge, unterstützt durch vorteilhafte regionale Politikentscheidungen und andere Faktoren. Unser Ansatz betont weiterhin Investitionen in qualitativ hochwertige, fundamental solide Unternehmen mit einer kritischen Bedeutung für dieses dauerhafte Thema, von dem sie profitieren.

## Next Generation Space Economy – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2024 betrug die Gesamterrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD 125,76 %. Der als Benchmark dienende MSCI All Country World Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der „Index“) verbuchte im selben Zeitraum ein Plus von 17,49 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamterrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

Im Jahr 2024 verzeichneten globale Aktien erneut ein Jahr mit positiven Renditen, wobei die US-Märkte ein erhebliches Wachstum verzeichneten, in dessen Zentrum hauptsächlich Technologiegiganten standen. Auch die asiatischen Märkte verzeichneten starke Zuwächse, worin sich ihre regionale wirtschaftliche Widerstandsfähigkeit spiegelt. Europäische Märkte zeigten unterdessen eine gemischte Performance, was auf die gedämpfte Wirtschaftslage zurückzuführen ist. Aufbauend auf den Trends von 2023 konzentrierten sich die wichtigsten Anlagethemen auf die expansive KI-Entwicklung, wobei der Fokus auf neue Anwendungen ebenso im Mittelpunkt stand wie die Technologie lag, die Fortschritte in der künstlichen Intelligenz vorantreibt. Als die Inflation nachließ, senkte die US-Notenbank (Fed) die Zinsen um insgesamt 100 Basispunkte, blieb aber angesichts der anhaltenden wirtschaftlichen Unsicherheiten bei ihrer vorsichtigen Haltung. In der Zwischenzeit eskalierten die geopolitischen Spannungen weiter, was sich auf die Rohstoffpreise auswirkte und zur Stärkung des US-Dollars beitrug. Gegen Ende des Jahres richteten die Anleger ihre Aufmerksamkeit auf mögliche politische Veränderungen unter Trump 2.0, insbesondere in Bezug auf globale Zölle, Steuerreformen und Deregulierungsbemühungen.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Unsere Übergewichtung des Industriesektors sowie die starke Aktienausswahl innerhalb des Sektors trugen zu den relativen Renditen bei, wobei viele „Pure-Play-Anlagemöglichkeiten“ unter Luft-/Raumfahrt-/Verteidigungsunternehmen im Laufe des Jahres eine Outperformance erzielten.
  - Eine strukturelle Untergewichtung thematisch weniger relevanter Sektoren (z. B. Gesundheitswesen, Basiskonsumgüter, Energie), die während des Jahres eine unterdurchschnittliche Wertentwicklung verzeichneten.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Unsere Aktienausswahl in der Halbleiterindustrie schmälerte die relativen Renditen, was aber zu Teilen durch unsere Übergewichtung der Branche ausgeglichen wurde.
  - Die Aktienausswahl im Sektor Kommunikationsdienstleistungen wirkte sich auf die relativen Renditen negativ aus, da einige nicht themenrelevante Mega-Cap-Technologietitel eine Outperformance verbuchten.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Portfolio verfolgt weiterhin einen Hantel-Ansatz zwischen Titeln, die wir als wachstumsorientierte und defensive Positionen einstufen. Wir haben Verzerrungen als Chance genutzt, fundamental und thematisch relevante Positionen einzugehen und hochzuskalieren.
- Die Anzahl der Wertpapiere im Portfolio wurde ebenso erhöht wie das Engagement bei „Pure-Play-Anlagemöglichkeiten“, um die wachsende Zahl an Multi-Sektor-Anlagegelegenheiten zu nutzen und dabei zu helfen, das Risiko zu streuen.

Im Ökosystem Weltraum gab es bedeutende Fortschritte und Ankündigungen mit Auswirkungen auf verschiedene Branchen und Nationen. Das „Weltraumrennen 2.0“ geht weiter: Großbritannien plant seinen ersten Start für August, die Europäische Weltraumorganisation macht Fortschritte mit Ariane 6 und auch in Indien und China gibt es bedeutende Entwicklungen. Kommerzielle Unternehmen erweitern ihr weltraumgestütztes Engagement, so beispielsweise AST Spacemobile, das eine Partnerschaft mit AT&T und Verizon eingegangen ist, um eine 100 %-ige geografische Mobilfunkabdeckung zu erreichen, oder CNH, das eine Satellitenanbindung für seine Traktoren erforscht, und PL, das zwecks Nutzung von KI-Funktionen den ersten geplanten Einbau von NVDA-Chips in einen Satelliten ankündigt. Schließlich sehen wir mit Blick auf die Startkapazitäten der Raketen Falcon und Starship weiterhin positive Entwicklungen bei SpaceX sowie eine mehr als dreifache (3,3) Steigerung des Starlink-Verkehrs. Unsere Anlagestrategie konzentriert sich weiterhin auf starke Fundamentaldaten, die mit dem Thema Raumfahrt im Zusammenhang stehen, und positioniert das Portfolio so, dass es von dem erwarteten Wachstum profitieren kann.

## Short Duration Emerging Market Debt – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2024 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD 18,95 %. Der ICE BofA 3-Month US Treasury Bill Index (Total Return, USD) (der Index) verbuchte während des gleichen Zeitraums 5,25 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiedieranlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Im Jahr 2024 war die weltweite Konjunktur robust, und die US-Notenbank, die Europäische Zentralbank und andere große Zentralbanken leiteten Zinssenkungszyklen ein. Die globalen Anleiherenditen gerieten während des Jahres erneut unter Aufwärtsdruck, da der Markt die Risiken im Zusammenhang mit der Inflationsentwicklung und der Finanzpolitik bewertete.
- Die Schwellenmärkte (EM) sahen sich mit etwas Gegenwind konfrontiert, und zwar durch einen starken US-Dollar und – infolge des Wahlergebnisses in den Vereinigten Staaten – eine größere Unsicherheit in Bezug auf die US-Handelspolitik. Dennoch haben sich die Spreads von Hartwährungen der Schwellenländer im Laufe des Jahres verringert, unterstützt durch die Reformdynamik und einen Trend, die Kreditratings zu verbessern.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Mit die größten positiven Beiträge zur relativen Performance kamen von Staatsanleihen in Argentinien, die von wichtigen Fortschritten bei der Haushaltskonsolidierung und der Desinflation profitierten, gefolgt von ukrainischen und sri-lankischen Staatsanleihen, die 2024 erfolgreich Umschuldungen abgeschlossen haben.
  - Die Staatsanleihen aus El Salvador, Ägypten und der Elfenbeinküste sowie Unternehmensanleihen aus der Türkei und Kolumbien.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Positionierung der Renditekurve im Vergleich zur T-Bill-Benchmark wirkte sich aufgrund der durchschnittlichen Portfolioduration von etwa 2,5 Jahren negativ aus, da die Renditen von US-Staatsanleihen im Laufe des letzten Jahres gestiegen sind.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Portfolio blieb bei einer ausgewogenen Allokation zu EM-Unternehmensanleihen und staatlichen/quasistaatlichen Emissionen und einer Duration von um die 2,5 Jahren.
- Wir haben unser Engagement in Lateinamerika erhöht, insbesondere in Staatsanleihen aus Panama, da die Bewertungen von Anleihen mit kurzer Laufzeit selbst im Kontext einer möglichen Herabstufung des Ratings attraktiv erscheinen. Außerdem wurden die Gewichtung von quasistaatlichen Anleihen aus Mexiko, die eine attraktive Spread-Prämie gegenüber Staatsanleihen bieten, erhöht. Zudem haben wir an verschiedenen neuen Emissionen von hochwertigen Unternehmensanleihen in den Vereinigten Arabischen Emiraten partizipiert.
- Unser Engagement in Asien, vor allem in China, wurde angesichts relativ enger Spreads und eines etwas vorsichtigen Ausblicks für China – aufgrund des verlangsamten Wachstums und der Risiken im Zusammenhang mit der Handelspolitik der Vereinigten Staaten – reduziert. Die Gewichtung von auf EUR lautenden Anleihen in Serbien wurde verringert, nachdem sich die Spreads deutlich verengt hatten.

Die Anlageklasse der Schuldtitel aus Schwellenländern dürfte von einem Umfeld mit stetigem globalem Wachstum, einer Lockerung der Geldpolitik und einem soliden Wachstumsanstieg in den Schwellenländern im Vergleich zu den Industrieländern profitieren. Der Regierungswechsel in den Vereinigten Staaten birgt Risiken im Zusammenhang mit Handelsprotektionismus, insbesondere für einige der offeneren Volkswirtschaften in Asien und Osteuropa. Des Weiteren kommt mehr Unsicherheit in Bezug auf die zukünftige Entwicklung der US-Zinsen hinzu, doch sollten Schwellenländeranleihen mit kurzer Duration im Vergleich zum breiteren Markt für festverzinsliche Papiere aus Schwellenländern weniger anfällig für solche Risiken sein. Insgesamt haben sich die Fundamentaldaten von Krediten in den Schwellenländern verbessert, wobei die Rating-Upgrades sowohl für Unternehmens- als auch bei Staatsanleihen auf Zehnjahreshochs gestiegen sind. Während die Bewertungen in Teilen der Anlageklasse, z. B. von verschiedenen Unternehmensanleihen mit Investment Grade, relativ teuer geworden sind, sehen wir bei diversen Emittenten weiterhin Gelegenheiten für Spread-Verengungen, insbesondere im Hochzinssegment.

## Short Duration Euro Bond – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2024 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse EUR I 7,37 %. Der Bloomberg Euro Aggregate Bond 1-3 Year Index (Total Return, EUR) (der „Index“) rentierte im selben Zeitraum 3,66 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die Marktbewegungen im Jahr 2024 wurden in erster Linie durch über den Erwartungen liegende Wirtschaftsdaten (insbesondere in den Vereinigten Staaten), uneinheitliche Inflationstrends, wobei die Vereinigten Staaten und Großbritannien nicht mit dem Fortschritt in Europa mithalten können, neue Regierungen in Großbritannien und den Vereinigten Staaten und anhaltende geopolitische Spannungen zwischen Russland und der Ukraine sowie in Gaza bestimmt.
- Risikoanlagen entwickelten sich 2024 an den Märkten für festverzinsliche Wertpapiere stark, wobei europäische Hochzinsanleihen am besten abschnitten, während globale Investment-Grade-Anleihen und Anleihen aus Schwellenmärkten (EM) ebenfalls positive Renditen verbuchten.
- Europäische Investment-Grade-Kredite, die Märkte für Staatsanleihen und besicherte Instrumente, die zusammen den Großteil des Anlageuniversums für die Strategie ausmachen, verzeichneten ebenfalls positive Renditen.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Kreditauswahl war der entscheidende Faktor für die starken relativen Renditen im Jahresverlauf, insbesondere durch unser Engagement in REITs und im breiteren Finanzwertbereich, während unsere Übergewichtung in diesen beiden Segmenten (und im Kreditbereich generell) die Auswirkungen dieser Auswahlentscheidungen weiter verstärkte, da sich die Spreads verengten und die Fundamentaldaten der Portfoliositionen im Laufe des Jahres deutlich besser ausfielen.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Für die einzigen realen Abzüge von der Performance war die Kurvenpositionierung verantwortlich. Sie kostete das Portfolio im Laufe des Jahres ~45 Basispunkte an relativen Renditen.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Im Laufe des Jahres beteiligten wir uns weiterhin an Transaktionen am Primärmarkt und nutzten Fehlbewertungen sowohl auf Kredit- als auch auf Zinsebene, was in beiden Fällen erheblich zu den positiven Renditen für das Jahres beitrug.
- Unsere Kreditpositionen waren eine beständige Antriebskraft für die Renditen, und wir haben gegen Ende des Jahres bei einigen davon die Gewinne mitgenommen.
- Aus Perspektive der Duration trug unsere Short-Positionierung zu den Renditen bei. Wir lösten sie am Ende des dritten Quartals nach dem Rückgang an den Zinsmärkten auf. In dieser Hinsicht blieben wir im Laufe des Jahres aktiv.

Unserer Ansicht nach wird das Jahr 2025 wahrscheinlich so beginnen, wie das Jahr 2024 endete. Die Zinssätze könnten volatil sein, da sich die globale Inflation als hartnäckig erweisen wird und die Entscheidungen der Zentralbanken datenabhängig sein werden. Ferner wird erwartet, dass Risikobereitschaft hoch sein dürfte und die Gesamtnachfrage nach Anleihen durch das überdurchschnittliche Niveau der auf dem Markt verfügbaren „All-in-Renditen“ (risikofreie Zinssätze + Spreads) gestützt wird. Da sich die Spreads auf historischen Tiefständen befinden, rechnen wir für 2025 mit einer Zunahme der Volatilität und der Streuung, da sich das neue, höhere Zinsumfeld wahrscheinlich negativ (und vor allem unterschiedlich) auf die Bilanzen der Emittenten auswirken wird. Aufgrund dieser Ansichten glauben wir, dass es im Jahr 2025 wichtiger denn je sein wird, sich auf fundamental starke Emittenten/Sektoren/Länder zu konzentrieren und Emittenten mit schwachen Finanzprofilen (z. B. höhere Verschuldung, weniger nachhaltige Cashflows usw.) zu meiden. Die aktuellen Spreads sind nicht weit genug, um uns für das eingegangene Risiko zu entschädigen.

## Short Duration High Yield Engagement – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2024 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD 16,69 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Der Markt für Hochzinsanleihen schloss das Jahr 2024 mit soliden Renditen ab, die durch ein robustes Wirtschaftswachstum und eine sich abschwächende Inflation angetrieben wurden. Die Kreditspreads verengten sich im Berichtszeitraum in allen Segmenten, was auf eine besser als erwartete Wirtschaftsleistung, stabile Fundamentaldaten und eine stetige Nachfrage nach Krediten zurückzuführen ist.
- Die aggregierten Fundamentaldaten von Hochzinsemitenten in Bezug auf das Wachstum des Gewinns vor Zinsen, Steuern und Abschreibungen, der freie Cashflow, die Zinsdeckung und der Verschuldungsgrad, hielten sich in einem recht günstigen Bereich, und die Ertragsaison fiel im Großen und Ganzen besser aus als befürchtet.
- Zwar ist die Ausfallquote von ihren Tiefstständen im Jahr 2022 gestiegen, doch erwarten wir, dass die Ausfallquoten in 2025 in einem Bereich knapp um den langfristigen Durchschnitt bleiben werden. Dieser Ausblick stützt sich auf unsere Bottom-up-Beurteilung von Emittenten und wird getragen von dem qualitativ höherwertigen Ratingmix im Hochzinssegment (50 % der Emittenten mit Kreditratings von BB), von weniger aggressiven Neuemissionen, weniger kurzfristigen Fälligkeiten sowie einem Energiesektor, der deutlich solider ist als in den letzten Zyklen.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur Rendite:
  - Aus Branchensicht die Positionierungen in den Bereichen Telekommunikation, Versorgungsunternehmen und Medien und Kabel.
  - Aus der Perspektive der Ratings: Positionierung in Emittenten mit einem Rating von CCC, BB und BBB.
- Negativbeiträge zur Rendite:
  - Aus Sektorsperspektive: Positionierung in den Sektoren Autos & Autoteile, Lebensmittel, Getränke und Tabak sowie diversifizierte Finanzdienstleistungen.
  - Aus Ratingperspektive ergaben sich die größten Abzüge von der Performance durch die Positionierung in Emittenten mit B-Rating.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Im Rahmen unserer Hochzinsstrategien haben wir selektiv in qualitativ höherwertige B- und BB-Anleihen umgeschichtet, wo die Preise im Verhältnis zu den zugrunde liegenden Fundamentaldaten attraktiv blieben und die Ausfallerwartungen niedrig waren.
- Bei den CCC-Positionierungen haben wir eine differenzierte Sicht auf die einzelnen Unternehmensanleihen, die auf unseren hausinternen Ratings und den Einschätzungen der Analysten zu den einzelnen Krediten beruht. Zudem konzentrierten wir uns auf Umschichtungen innerhalb von Branchen und Risikokategorien des Marktes, um die Widerstandsfähigkeit gegenüber Preismacht- und Lohnkostentrends zu maximieren, sofern diese fortbestehen. Außerdem haben wir das Verschuldungsprofil des Portfolios, wo dies ohne Verluste für die Portfolios möglich war, heruntergefahren.
- Unser Plan war es, das Portfolio in erster Linie auf BB- und höherwertige B-Kreditrisiken zu konzentrieren (auf Basis unseren internen Kreditratings) und Sektoren überzugewichten, die wir im aktuellen Umfeld als widerstandsfähig einschätzen.

Wir sind der Meinung, dass die Bewertungen von Hochzinsanleihen eine mehr als angemessene Entschädigung für die mehr oder weniger durchschnittlichen Ausfallerwartungen darstellen, die Anleihen weiterhin dauerhafte Erträge bieten und im Vergleich zu anderen festverzinslichen Alternativen attraktiv sind. Makroökonomische Daten, die politische Unsicherheit durch Trump 2.0, geopolitische Bedenken und die allgemeine Dynamik des Kreditzyklus können den Markt für Hochzinsanleihen zwar täglich beeinflussen, doch konzentrieren sich unsere Analysten und Portfoliomanager weiterhin auf die spezifischen Fundamentaldaten einzelner Emittenten, wobei die Analysten die Basis- und Abwärtsszenarien bewerten. Wir sind der Meinung, dass wir mit unserem fundamentalen Bottom-up-Kreditresearch – mit Konzentration auf die Auswahl von Wertpapieren, die Vermeidung von Bonitätsherabstufungen und die ausschließliche Aufnahme der „besten Ideen“ in die Portfolios – gut aufgestellt sind, um von eventueller Volatilität zu profitieren.

## Strategic Income – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2024 betrug die Gesamterrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD 15,16 %. Der als Benchmark dienende Bloomberg US Aggregate Bond Index (Total Return, USD) verbuchte im selben Zeitraum 1,25 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamterrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendeneträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Als sich die Inflation der Zielmarke der US-Notenbank (Fed) von 2 % annäherte, wurde der Zinserhöhungszyklus bis September unterbrochen, als die Fed die Zinsen um 50 Basispunkte (Bp) senkte. Im November und Dezember senkte die Fed die Zinsen dann um jeweils 25 Bp. Andere große Zentralbanken senkten die Leitzinsen 2024 ebenfalls, da sich das Wachstum verlangsamte und die Inflation zurückging.
- Im Laufe des Jahres und insbesondere im vierten Quartal kam es vereinzelt zu Zins- und Marktvolatilität. Als die Fed im Dezember eine aggressive Zinssenkung vornahm und der zukünftige politische Kurswechsel von Trump 2.0 für Unsicherheit sorgte, preiste der Markt zunehmend abgeschwächte zukünftige Zinssenkungen ein, und die Renditen auf Papiere der US-Regierung stiegen im letzten Monat des Jahres über die gesamte Kurve hinweg an. Im Gesamtjahr stiegen auch die Renditen auf 10-jährige Staatsanleihen der Industrieländer auf breiter Front an.
- Die Kreditspreads verengten sich im Berichtszeitraum in allen Segmenten, was auf eine besser als erwartete Wirtschaftsleistung, stabile Fundamentaldaten und eine stetige Nachfrage nach Krediten zurückzuführen ist. Die Kreditspreads von US-Anleihen mit Investment Grade (IG), US-Hochzinsanleihen und variabel verzinslichen US-Darlehen engten sich um 19 Bp, 47 Bp bzw. 66 Bp ein. Die globalen aggregierten Spreads von Unternehmensanleihen engten sich ebenfalls um 26 Bp ein.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Allokationen zu US-amerikanischen und europäischen Hochzinsanleihen, verbrieften Kredite, quasistaatlichen MBS, vorrangigen variabel verzinslichen Darlehen, variabel verzinslichen besicherten Schuldtitel („CLO“) und Schuldtitel aus Schwellenländern (EM).
  - Die Einzeltitelauswahl bei IG-Krediten war der Performance förderlich, doch wurde dies durch die Wertabzüge im Zusammenhang mit der Untergewichtung dieses Sektors teilweise wettgemacht.
  - Die Untergewichtung der Duration im Portfolio.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Untergewichtung von IG-Unternehmensanleihen.
  - Allokation zu Schwellenländeranleihen in lokaler Währung

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Hinsichtlich der Portfolioadjustierung haben wir das Engagement in Schuldtiteln aus Schwellenländern, nominalen US-Staatsanleihen und IG-Krediten reduziert.
- Wir erhöhten das Engagement in quasistaatlichen MBS, verbrieften Krediten, variabel verzinslichen Bankdarlehen, Hochzinsanleihen und CLO.
- Auf Kernebene reduzierten wir die Portfolioduration um etwa 0,63 Jahre.

Wir denken, da sich die Inflationstendenzen verbessern und die Zinssenkungen der Zentralbanken im Jahr 2025 entweder pausieren oder moderater ausfallen werden, sodass die Entwicklung des Wirtschaftswachstums zu einer immer wichtigeren Triebkraft für die Renditen festverzinslicher Wertpapiere wird. Wir erwarten, dass sich die Zerteilung der Kreditmärkte zugunsten von Qualität fortsetzen wird. Insgesamt glauben wir, dass 2025 eine lohnende Zeit für solche globale Anleiheinvestoren sein könnte, die sich beim Aufbau ihrer Portfolios auf Fundamentaldaten und Selektivität konzentrieren.

## Sustainable Asia High Yield – Bericht des Investment-Managers.

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2024 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 13,87 %. Der als Benchmark dienende JP Morgan ESG Asia Credit (JSEC JACI) – High Yield Index (Total Return, USD) (der „Index“) verbuchte im selben Zeitraum 15,49 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Im Jahr 2024 lieferten asiatische Kreditanleihen eine robuste positive Performance, die durch ein günstiges makroökonomisches Umfeld angetrieben wurde. Der Beginn des Lockerungszyklus der US-Notenbank, das robuste globale Wachstum und die starken Fundamentaldaten an den asiatischen Märkten, in Kombination mit der Unterstützung durch technische Faktoren, führten im Laufe des Jahres zu einer deutlichen Verengung der Kreditspreads. Mehrere Special Situations, beispielsweise die erfolgreiche Umstrukturierung der von der Regierung von Sri Lanka begebenen Anleihen und eine starke Performance im Metall- und Bergbausektor in Indien trugen ebenfalls zu den Gesamtrenditen des Portfolios bei.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Aufgrund des stabilen Makro-Umfelds in Indien resultierte unsere Übergewichtung des Landes zu einer Outperformance der Allokation, die durch die starke Wertentwicklung von Vedanta-Anleihen noch verstärkt wurde.
  - Sri Lanka machte gute Fortschritte bei den Umstrukturierungsbemühungen, was sich positiv auf unsere Übergewichtung der Anleihen aus Sri Lanka auswirkte.
  - Unsere Untergewichtung der Philippinen aufgrund der anspruchsvollen Bewertung leistete einen alloktationsbedingten Beitrag zu den relativen Renditen des Portfolios.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Unsere Untergewichtung des chinesischen Immobiliensektors zu Beginn des Jahres schmälerte die relativen Renditen.
  - Unser Engagement in defensiven Investment-Grade-Titeln war abträglich, als sich am breiteren Markt der Risikoappetit verbesserte.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Wir behielten die Übergewichtete von Sri Lanka und Macau bei. In Sri Lanka blieben wir in Bezug auf die wirtschaftliche Trendwende bei unserer konstruktiven Einschätzung, während uns in Macau die mittelfristigen Aussichten auf eine Entschuldung des Glücksspielsektors mit attraktiven Spread-Niveaus interessieren.
- Wir begannen das Jahr mit einer konservativen Positionierung, erhöhten jedoch im zweiten und dritten Quartal 2024 schrittweise das Risiko, da das Makro-Umfeld konstruktiv war und sich die Fundamentaldaten asiatischer Kredite verbesserten. Im vierten Quartal nahmen wir angesichts der politischen Unsicherheiten durch die neue US-Regierung einige Gewinne mit.

Anleihen aus den asiatischen Schwellenländern sind in unseren Augen weiterhin eine überzeugende Anlagegelegenheit, die durch die sich verbessernde Kreditqualität am gesamten Markt sowie durch den Rückenwind begrenzter Nettoemissionen und höherer Gesamtrenditen untermauert wird. Mit Blick auf das Jahr 2025 bleiben wir angesichts des schwachen Wachstums in China und der wahrscheinlich auf kurze Sicht zunehmenden geopolitischen/handelsbezogenen Unsicherheiten taktisch vorsichtig. Wir sind allerdings der Meinung, dass asiatische Unternehmen gut positioniert sind, um die kurzfristige Volatilität zu überstehen, und würden versuchen, die sich bietenden Gelegenheiten zu nutzen.

## Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2024 betrug die Gesamterrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 10,35 %. Der als Benchmark dienende JP Morgan ESG EMBI Global Diversified Index (Total Return, USD) (der „Index“) verbuchte im selben Zeitraum 5,75 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamterrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Im Jahr 2024 waren die Inflation und die Geldpolitik der Vereinigten Staaten die wichtigsten Faktoren am Anleihemarkt. Die Rendite 10-jähriger US-Anleihen stieg von 3,9 % auf 4,6 % zum Jahresende mit erheblichen Schwankungen in der Zwischenzeit.
- Auch geopolitische Ereignisse hatten Auswirkungen auf den Markt, insbesondere im April, als die Spannungen im Nahen Osten eskalierten. Im Oktober kam es bedingt durch Bedenken hinsichtlich der Inflation und der Finanzpolitik inmitten einer möglichen republikanischen Welle zu Marktstress, doch folgte nach der Wahl dann eine Markterholung, die in der Erwartung einer Deregulierung und wachstumsfreundlicher Maßnahmen gründete. Die Märkte strauchelten im Dezember, als die US-Notenbank trotz der Zinssenkungen eine aggressivere Haltung einnahm und während der US-Exzeptionalismus den US-Dollar auf den stärksten Jahresschlusskurs seit 2001 brachte.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Länderallokation, angetrieben durch die Übergewichtung von Märkten mit höheren Renditen, insbesondere von Argentinien, El Salvador, Sri Lanka und der Ukraine.
  - Die Einzeltitelauswahl über auf Euro lautende Anleihen aus Rumänien und Peru.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Nullgewichtung von Ägypten und die Untergewichtung von Ecuador aufgrund der verantwortungsvollen und übergangsspezifischen Richtlinien des Portfolios.
  - Die übergewichtete Allokation von Kolumbien, das sich mit politischen und fiskalischen Herausforderungen konfrontiert sah.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Portfolio hielt an einer Ausrichtung auf Hochzinstitel gegenüber Krediten mit Investment Grade (IG) fest und strebte eine vollständige Allokation zu nachhaltigen Investitionen an.
- Im Anschluss an eine starke Performance der Anlageklasse konzentrierten sich der jüngste Handel auf die Reduzierung des Risikos. Wir reduzierten die Übergewichtung von Argentinien, Mexiko und Marokko. Darüber hinaus haben wir unsere Positionen in Rumänien aufgrund der Risiken bei der Versorgung und durch den Haushaltsetat vor den Wahlen reduziert und uns aus Usbekistan und Jordanien zurückgezogen.
- Wir haben unser Engagement in Costa Rica, El Salvador und der Elfenbeinküste aufgrund von deren positiven Reformaussichten erhöht. Auch haben wir auch unser Engagement in Unternehmensanleihen in Chile, Hongkong, Indien, Mexiko und der Türkei sowie in grünen Anleihen in Indonesien und der Stadtverwaltung von Istanbul, jeweils im Einklang mit dem Nachhaltigkeitsrahmen des Portfolios, erhöht.
- Die Allokation von auf EUR lautende Anleihen und Unternehmensanleihen betrug am Ende des Berichtszeitraums 28,2 % beziehungsweise 8,7 %.

Die Anlageklasse der Schuldtitel aus Schwellenmärkten (EM) sollte von einem stetigen globalen Wachstum, einer Lockerung der Geldpolitik und stärkeren Wachstumsaussichten für Schwellenländer profitieren. Die politischen Kurswechsel der US-Regierung bergen allerdings die Gefahr durch Handelsprotektionismus und schaffen Unsicherheit in Bezug auf die US-Zinsen. Trotz dieser Herausforderungen verbessern sich die Fundamentaldaten für Kredite aus Schwellenländern. Die Rating-Upgrades für Unternehmens- und Staatsanleihen liegen auf dem höchsten Niveau seit zehn Jahren. Während die Bewertungen für als IG- und mit BB bewertete Komponenten teuer erscheinen, bieten Segmente mit B-Rating und niedrigeren Ratings unserer Auffassung nach immer noch Wert. Chancen für eine Verengung der Spreads bestehen bei bestimmten Emittenten und Anleihen von außerhalb der Benchmark, insbesondere im BB-Segment.

## Tactical Macro – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2024 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 4,31 %. Der ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return, USD) (der „Index“) rentierte im selben Zeitraum 5,47 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. (Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Globale Aktien und Anleihen erlebten 2024 ein weiteres starkes Jahr und überraschten viele Anleger, die mit Herausforderungen durch die wirtschaftliche Straffung gerechnet hatten. Die robuste Performance von Risikoanlagen wurde durch die anhaltende Stärke der Industrieländer angetrieben, wobei aber auch nennenswerte Wertbeiträge von wichtigen Schwellenländern hinzukamen.
- Die Zentralbanken begannen im Laufe des Jahres mit der Normalisierung ihrer Politik, doch führten das stabile Wachstum und die anhaltende Inflation zu einem vorsichtigen Ansatz bei den Zinsanpassungen. Dieses Umfeld, gepaart mit Optimismus nach politischen Entwicklungen, war für diverse Sektoren hilfreich, darunter Technologie und Finanzen.
- Investoren navigierten in einem dynamischen Wirtschafts- und Investitionsumfeld, das von einem starken US-Dollar und steigenden Renditen geprägt war. Trotz zunehmender regionaler Unterschiede beim Wirtschaftswachstum blieben die Unternehmensgewinne weitgehend stabil, unterstützt durch die Stärke des Verbraucher- und Arbeitsmarktes. Auch trug der Optimismus in Bezug auf technologische Fortschritte zu einer positiven Marktstimmung bei.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur absoluten Rendite:
  - Die größten Beiträge zur Gesamrendite des Portfolios (ohne Zahlungsmittel) leisteten Short-Positionen in 10-jährigen US-Staatsanleihen, Short-Positionen im USD gegenüber dem JPY und Short-Positionen im EUR gegenüber dem JPY.
- Negativbeiträge zur absoluten Rendite:
  - Die größten Beeinträchtigungen für die Gesamrendite des Portfolios kamen von Long-Positionen in defensiven US-Aktien vs. zyklischen Aktienkörben, Short-Positionen im EUR gegenüber dem JPY und Short-Positionen im 3-Monats-SOFR.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Im ersten Quartal 2024 steuerte das Portfolio durch die makroökonomische Volatilität und profitierte von Long-Positionen in japanischen Aktien und im Nasdaq, sah sich jedoch bei Devisenpositionen gegenüber dem Euro und dem Yen mit Herausforderungen konfrontiert.
- Im zweiten Quartal 2024 standen geopolitische Spannungen und die Marktstimmung im Mittelpunkt, wobei von Long-Positionen bei US-Staatsanleihen mit zweijähriger Laufzeit gegenüber deutschen Bundesanleihen profitiert wurde. Politische Entwicklungen führten in Hinsicht auf Stagflation zu einem vorsichtigen Ausblick.
- Im dritten Quartal 2024 profitierte das Portfolio von der Marktvolatilität aufgrund von Wirtschaftsdaten und politischen Veränderungen, mit Gewinnen aus Short-Positionen in US-Zyklikern, Long-Positionen in SPX-Put-Optionen, Positionen in Gold und Short-Positionen in USD/JPY.
- Im Zuge einer Neubewertung der Zinssätze im vierten Quartal 2024 wurden die größten Gewinne durch eine Short-Position in 10-jährigen US-Staatsanleihen verbucht. Das Portfolio navigierte außerdem durch die geopolitischen Unsicherheiten unter Einsatz von strategischen Optionspositionen in Bezug auf China, von Aktien und von Devisen, während es Gelegenheiten durch kurzfristige Fehlbewertungen identifizierte.

Zu Beginn des Jahres 2025 muss das Portfolio auf diverse potenzielle Ergebnisse vorbereitet sein. Der jüngste Straffungszyklus weist einzigartige Charakterzüge auf, und trotz der Widerstandsfähigkeit des Marktes zeichnen sich Herausforderungen ab. Der an Wert zulegende US-Dollar und die 10-Jahres-Renditen sowie geopolitische Unsicherheiten deuten auf einen turbulenten Weg hin. Die Dynamik der aktuellen Steuer- und Geldpolitik könnte die Wirtschaftslandschaft fragmentieren, was Vorsicht erfordert. Wir werden uns darauf konzentrieren, Gelegenheiten durch kurzfristige Fehlbewertungen inmitten anhaltender Volatilität zu identifizieren. Unsere Strategie umfasst die Positionierung für potenzielle Renditen am hinteren Ende der Kurve aufgrund von Haushaltsungleichgewichten und der globalen Handelsdynamik. Wir rechnen damit, dass Positionen angesichts möglicher geldpolitischer Kurswechsel und des sich entwickelnden geopolitischen Klimas neu bewertet werden. Wir räumen zwar ein, dass eine potenzielle von Liquidität angetriebene Erholung stattfindet, sind uns aber auch der Möglichkeit von unterschiedlichen Ergebnissen am Markt bewusst, insbesondere zwischen Szenarien einer sanften Landung und Stagflation. Diese Prognose spricht für ein Short-Engagement bei US-Aktien gegenüber japanischen Aktien und für Long-Positionen bei US-Staatsanleihen, falls Angebotsengpässe zu Renditeanstiegen führen. Wir gehen davon aus, dass 2025 von erhöhter Unsicherheit und Volatilität geprägt sein wird, was einen dynamischen Anlageansatz erfordert, um durch das komplexe globale makroökonomischen Umfeld zu manövrieren.

## Uncorrelated Strategies – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2024 betrug die Gesamterrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 6,69 %. Der als Benchmark dienende Index, der ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return, USD) (der Index), rentierte im selben Zeitraum 5,47 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamterrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- 2024 war ein weiteres Jahr mit einer positiven Risikostimmung, obwohl es im August und rund um das Datum der US-Wahlen Phasen der Volatilität gab, sowie Marktbewegungen, die durch die Erwartung von Zinssenkungen, zahlreiche globale Wahlen und den anhaltenden Konflikt im Nahen Osten ausgelöst wurden. Trotz der knappen Führungsposition der Aktienmärkte in den Vereinigten Staaten entwickelten sich die Aktienindizes äußerst stark, da die anhaltende Begeisterung für KI die Aktienwerte nach oben trieb. Die Anleihemärkte bewegten sich innerhalb einer größeren Bandbreite, da die Marktteilnehmer aufgrund der Veröffentlichung von Inflationsdaten und der Erwartungen an die Politik nach der Wiederwahl von Donald Trump unterschiedlich starke Zinssenkungen einpreisten.
- Der MSCI World Index beendete den Berichtszeitraum mit einem Plus von 19 %, während der Bloomberg Global Aggregate einen Rückgang von 1,7 % verbuchte. Der US-Dollar (gemessen am DXY-Index) legte in der zweiten Jahreshälfte deutlich zu und schloss mit einem Plus von etwa 5,9 %, da die höheren US-Renditen die Währung stützten.
- In der zweiten Jahreshälfte lag die implizite Aktienvolatilität im Durchschnitt um 24 % höher als in der ersten Jahreshälfte (gemessen am VIX-Index) und die implizite Währungsvolatilität um 15 % höher (unter Verwendung der impliziten 1-Monats-Volatilität des EUR/USD als Näherungswert). Dies ermöglichte zwei starke Quartalsergebnisse und eine deutliche Erholung von einer für das Portfolio schwierigeren Phase.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur absoluten Rendite:
  - Short Term Trading (+2,93 %), Global Macro (+2,53 %), Equity Market Neutral (+1,95 %), Insurance-Linked Securities (+1,15 %) und Volatility Relative Value (+0,71 %)
- Negativbeiträge zur absoluten Rendite:
  - Trend Following (-1,51 %) and Statistical Arbitrage (-1,11 %)

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Risiko innerhalb der G10/Manteio-Allokation wurde im Januar erneut zurückgefahren, und dem Konto wurden in der ersten Jahreshälfte diversifizierende Strategien hinzugefügt.
- Die kleinere Allokation in Bezug auf Cipher (etwa 4,6 % des Portfoliorisikos) innerhalb von Statistical Arbitrage wurde im Mai aufgrund einer Neuausrichtung des gesamten Geschäftsmodells von Cipher geschlossen.
- Im diskretionären Makro-Segment wurde das Engagement in DG Partners gegen Ende des ersten Quartals aufgestockt, um die bestehende systematische Strategie von DG Partners (BH-DG) im Rahmen des Trendfolge-Segments zu ergänzen. Im Gegenzug wurde das Risiko im Soloda-Konto im März reduziert.

Das Team ist der Ansicht, dass es gute Gründe gibt, anhaltende aktive Marktbewegungen zu erwarten, und nicht eine Rückkehr zu der Monotonie früherer Perioden mit Verengung, insbesondere wenn man die Vielzahl der gegenwärtig so offensichtlichen makroökonomischen und geopolitischen Faktoren berücksichtigt. Angesichts der Schwierigkeiten, Marktumkehrungen und die Performance einer einzelnen Strategie im nächsten Quartal zu prognostizieren, hält das Team weiterhin an einem diversifizierten Portfolio von Handelsstrategien mit einem sehr differenzierten Profil im Vergleich zu traditionellen Risikoanlagen oder einem „60/40“-Portfolio fest.

## US Equity – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2024 betrug die Gesamtertragsrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD 123,72 %. Der als Benchmark dienende S&P 500 Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der Index) verzeichnete im selben Zeitraum ein Plus von 24,50 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtertragsrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Der Aktienmarkt legte im Geschäftsjahr auf breiter Front kräftig zu. Der Markt wurde von Technologie-/Wachstumsaktien angeführt, die teilweise von Aktien im Feld der KI angetrieben wurden. Im Jahresverlauf schnitten Large-Cap-Wachstumsaktien besser ab als Large-Cap-Substanzwerte. Das Wirtschaftswachstum in den Vereinigten Staaten blieb stabil und weckte Hoffnungen auf eine sanfte Landung der Wirtschaft. Die Inflation schwächte sich ab, blieb aber über dem Ziel der US-Notenbank (Fed) von 2 %. Nachdem die Zentralbank die Zinssätze bei ihren letzten drei Sitzungen des Jahres gesenkt hatte, schraubte sie im Dezember ihre Erwartungen auf Zinssenkungen im Jahr 2025 zurück.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Sektorallokation insgesamt, vor allem eine übergewichtete Allokation in Informationstechnologie und eine untergewichtete Allokation im Gesundheitswesen, waren für die größten Zugewinne verantwortlich.
  - Die Einzeltitelauswahl in den Sektoren Basiskonsumgüter und Gesundheitswesen trug am meisten zur Performance bei.
  - Zu den Einzelwerten mit positiven Performancebeiträgen, gehörten NVIDIA Corp., Amazon.com, Inc., Meta Platforms, Inc. Class A, Broadcom, Inc. and Alphabet, Inc. Class A
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Insgesamt kam es durch die Einzeltitelauswahl zu den größten Wertabzügen, insbesondere durch die Beteiligungen im IT-Sektor und bei Industriewerten.
  - In Bezug auf die Sektorallokation hatten eine Untergewichtung von Finanzwerten und eine geringe Bargeldposition den größten negativen Einfluss auf die Wertentwicklung.
  - Zu den Einzelwerten, die sich negativ auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten, gehörten Dollar Tree, Inc., NIKE, Inc. Class B, Adobe, Inc., Advanced Micro Devices, Inc. and CDW Corp.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Wir nahmen im Berichtszeitraum etliche geringfügige Anpassungen vor. Gegen Ende des Berichtszeitraums waren unsere größten Übergewichtungen im Vergleich zur Benchmark die Sektoren Informationstechnologie und Nicht-Basiskonsumgüter. Demgegenüber waren Finanzwerte und das Gesundheitswesen am stärksten untergewichtet.

Die Wirtschaft hat sich als widerstandsfähiger erwiesen als von vielen erwartet. Ein schwächeres Makro-Umfeld sowie politische und geopolitische Volatilität belasten allerdings Teile der Verbraucherbasis. Darüber hinaus deuten die weiteren Anzeichen auf eine Abschwächung des Arbeitsmarktes an, dass sich der Straffungszyklus der Fed auf die Gesamtwirtschaft auswirkt. Zur selben Zeit haben die politischen Unsicherheiten im Zusammenhang mit den Zoll- und Einwanderungsvorschlägen der Trump-Regierung zu Befürchtungen einer erneuten Inflation geführt. Vor diesem Hintergrund rechnet die US-Notenbank nun mit nur zwei Zinssenkungen im Jahr 2025. Bis wir mehr Klarheit über die Entwicklung der Wirtschaft und der Inflation haben und wie sich dies in tatsächlichen Zinssenkungen gegenüber den Erwartungen niederschlägt, rechnen wir mit einer anhaltenden Marktvolatilität. Darüber hinaus sind die globalen geopolitischen Spannungen nach wie vor allgegenwärtig und nehmen zu. Zudem könnte die globale politische Unsicherheit durch die neue Politik der Trump-Regierung eskalieren. Im aktuellen Umfeld dürfte sich unseres Erachtens daher im weiteren Verlauf immer klarer abzeichnen, dass sich die operative Leistung der zugrunde liegenden Unternehmen auseinanderentwickelt.

## US Equity Premium – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2024 betrug die Gesamtertragsrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 13,15 %. In demselben Zeitraum verzeichnete die zu je 50 % aus dem Cboe S&P 500 One-Week PutWrite Index und dem Cboe S&P 500 PutWrite Index (zusammen der Index) zusammengesetzte Benchmark 13,27 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtertragsrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die Präsidentschaftswahl in den Vereinigten Staaten im Jahr 2024 wirkte sich auf die Stimmung der Anleger aus, doch konnte der S&P 500 Index trotz eines Rückgangs um 2,38 % im Dezember das Quartal mit einem Plus von 2,41 % beenden, was auf eine starke „wahlbedingte Erleichterung“ im November zurückzuführen ist. Der durch eine mögliche Deregulierung und Steuersenkungen unter der neuen Regierung ausgelöste Optimismus führte 2024 zu einem Anstieg von 25,02 %.
- Als die US-Notenbank die Zinsen um 1 % senkte, waren die Märkte für festverzinsliche Wertpapiere aufgrund geopolitischer Ereignisse, Maßnahmen der Zentralbanken und Inflationsdruck volatil. Hochzinsanleihen schnitten besser ab als Investment-Grade-Anleihen, mit einer zwölfmonatigen Rendite von 8,19 % für den Bloomberg Corporate High Yield Bond Index gegenüber 1,25 % für den Bloomberg US Aggregate Bond Index.
- Die Marktvolatilität nahm 2024 zu, insbesondere gegen Jahresende, als der Cboe Volatility Index (VIX) bei einer Volatilitätsprämie von 3,06 im Durchschnitt bei 15,56 lag.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Für 2024 steuerte das S&P 500-Optionssegment beeindruckende 9,63 % zur Wertentwicklung bei, ergänzt durch einen Beitrag von 4,32 % aus dem Sicherheitenportfolio.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die relativen Renditen wurden während des Berichtszeitraums durch keinerlei Beteiligungen beeinträchtigt.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das durchschnittliche rechnerische Optionsengagement des Portfolios entsprach im Berichtszeitraum durchgehend dem strategischen Ziel von 100% S&P 500 Index.

Unserer Ansicht nach bevorzugen die meisten Aktienmanager, insbesondere substanzorientierte Manager, im Allgemeinen Märkte, die auf „Fundamentaldaten“ basieren. Wir glauben, dass die globalen Volkswirtschaften zu den wettbewerbsorientierten, weniger vorhersehbaren Persönlichkeiten der Vergangenheit zurückkehren. Die Unternehmensführungen müssen unter Umständen um Ressourcen konkurrieren, für Kredite zahlen, sich in umstrittenen geopolitischen Fragen zurechtfinden und die Zufriedenheit von Aktionären und Mitarbeitern in der neuen Ära der ESG- und DEI-Investitionen (Diversity, Equity and Inclusion) aufrechterhalten. Unserer Ansicht nach scheint diese Zukunftsperspektive schwieriger zu sein als es noch die relativ einfachen Bedingungen des letzten Jahrzehnts waren. Unser Optimismus in Bezug auf unsere Strategien basiert nicht auf der Erwartung von höheren Optionsprämien für die impliziten Volatilitätsniveaus, sondern darauf, dass der S&P 500 Index wieder in die Welt der öffentlichen Investmentindizes zurückkehrt. Niedrigere oder „normalere“ Renditen am US-Aktienmarkt könnten den Wert risikobereinigter Strategien hervorheben. Anleger betrachten nicht-öffentliche oder -private US-Aktien oft als lediglich Instrumente für die Reduzierung des Risikos. Allerdings sind wir der Meinung, dass strukturell diversifizierte Strategien die Anleger in den nächsten Jahren positiv überraschen könnten, wenn die langfristigen Renditen am Aktienmarkt, insbesondere der S&P 500, zu ihren langfristigen Trends zurückkehren.

## US Large Cap Value – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2024 betrug die Gesamterrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 10,39 %. Der als Benchmark dienende Russell 1000 Value Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der Index) verzeichnete im selben Zeitraum ein Plus von 13,65 %. (Die Performance für alle Anteilsklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamterrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Der Aktienmarkt legte im Geschäftsjahr auf breiter Front kräftig zu. Der Markt wurde von Technologie-/Wachstumsaktien angeführt, die teilweise von Aktien im Feld der künstlichen Intelligenz angetrieben wurden. Im Jahresverlauf schnitten Large-Cap-Wachstumswerte deutlich besser ab als Large-Cap-Substanzwerte.
- Das Wirtschaftswachstum in den Vereinigten Staaten blieb stabil und weckte Hoffnungen auf eine sanfte Landung der Wirtschaft.
- Die Inflation schwächte sich ab, blieb aber über dem Ziel der US-Notenbank (Fed) von 2 %. Nachdem die Zentralbank die Zinssätze bei ihren letzten drei Sitzungen des Jahres gesenkt hatte, schraubte sie im Dezember ihre Erwartungen auf Zinssenkungen im Jahr 2025 zurück.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - In Bezug auf die Einzeltitelauswahl leisteten die Beteiligungen in den Sektoren Basiskonsumgüter, Informationstechnologie und Werkstoffe die größten positiven Wertbeiträge.
  - Zu den einzelnen Aktien, die am meisten zur relativen Performance beitrugen, gehörten Übergewichtungen von Walmart, Inc. und Agnico Eagle Mines Limited sowie der Ausschluss von Beteiligungen an Intel Corp.
  - Aus der Perspektive der Sektorpositionierung trug eine Übergewichtung von Versorgern in Verbindung mit einer Untergewichtung von Nicht-Basiskonsumgütern und Immobilien am stärksten zur relativen Performance bei.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Sektorallokation beeinträchtigte insgesamt die relative Performance. Die größten Wertabzüge gingen auf das Konto von Übergewichtungen des Werkstoffsektors und im Gesundheitswesen.
  - Die Einzeltitelauswahl hat in ihrer Gesamtheit die relative Performance ebenfalls geschmälert. Die größten Renditeeinbußen ergaben sich durch Positionen in den Sektoren Gesundheitswesen, Versorgungsunternehmen und Industrie.
  - Zu den einzelnen Aktien, die die relative Performance am stärksten beeinträchtigten, gehörten eine Position in Rio Tinto Plc. sowie die Übergewichtung von Freeport-McMoRan, Inc. und Johnson & Johnson.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Der Sektorpositionierung des Portfolios liegt die Bottom-up-Einzeltitelauswahl zugrunde, und am Ende des Berichtszeitraums bestanden die größten Übergewichtungen gegenüber dem Index in den Versorger und Werkstoffe.
- Die im Portfolio gegenüber dem Index am stärksten untergewichteten Sektoren waren Industriewerte und Informationstechnologie.

Mit Blick auf die Zukunft erwarten wir eine ausgewogene Risikobilanz, mit auch weiterhin besseren Wirtschaftsdaten auf der einen Seite und teuren und stark konzentrierten Märkten auf der anderen Seite. Es besteht die Sorge, dass es im kommenden Jahr zu einer höheren Volatilität kommen könnte, da sowohl die Aktien- als auch die Anleihemärkte von Unsicherheit geplagt sind. Wir haben schon jetzt nach den Wahlen eine höhere Volatilität an den Märkten beobachtet. Zu Beginn des Jahres 2025 rechnen wir mit einer stärker datenabhängigen und vorsichtiger operierenden US-Notenbank, und wir erwarten in diesem Berichtszeitraum eine erhöhte Marktvolatilität. Angesichts dieser unsicheren Wirtschaftsbedingungen könnten sich Substanzwerte in naher Zukunft überdurchschnittlich entwickeln. Wir sind der Meinung, dass der Markt zwar weiterhin Risiken birgt, aber auch für diejenigen Marktteilnehmer zahlreiche Gelegenheiten bietet, die bereit sind, in der sich entwickelnden Wirtschaftslandschaft mit einer strategischen, langfristigen Perspektive vorzugehen. Wir sind bereit, diese Gelegenheiten zu nutzen, sobald sie sich bieten. Wir schätzen Ihr Vertrauen und Ihre Partnerschaft mit uns und freuen uns darauf, unsere Partnerschaft mit Ihnen fortzusetzen.

## US Long Short Equity – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2024 betrug die Gesamtertragsrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 6,47 %. Die als Benchmark dienenden zwei Indizes, der S&P 500 Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) und der HFRX Equity Hedge Index (Total Return, USD) verbuchten im selben Zeitraum ein Plus von 24,50 % bzw. 7,83 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtertragsrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Der Aktienmarkt legte im Geschäftsjahr auf breiter Front kräftig zu. Der Markt wurde von Technologie-/Wachstumsaktien angeführt, die teilweise von Aktien im Feld der KI angetrieben wurden. Im Jahresverlauf schnitten Large-Cap-Wachstumsaktien besser ab als Large-Cap-Substanzwerte. Das Wirtschaftswachstum in den Vereinigten Staaten blieb stabil und weckte Hoffnungen auf eine sanfte Landung der Wirtschaft. Die Inflation schwächte sich ab, blieb aber über dem Ziel der US-Notenbank (Fed) von 2 %. Nachdem die Zentralbank die Zinssätze bei ihren letzten drei Sitzungen des Jahres gesenkt hatte, schraubte sie im Dezember ihre Erwartungen auf Zinssenkungen im Jahr 2025 zurück.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Short-Positionen bei Aktien waren insgesamt vorteilhaft. Insbesondere Long-Positionen in den Sektoren Basiskonsumgüter und Nicht-Basiskonsumgüter trugen zur Performance bei.
  - Long-Positionen bei Aktien in den Sektoren Gesundheitswesen und Energie generierten den größten Mehrwert.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Long-Positionen bei Aktien schmälerten insgesamt die Renditen. Insbesondere die Long-Positionen in den Sektoren Informationstechnologie und Industrie wirkten sich negativ auf die Performance aus.
  - Short-Positionen bei Aktien im Sektor Informationstechnologie hatten einen negativen Effekt auf die Renditen.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Nettoengagement des Portfolios ging im Berichtszeitraum schrittweise auf eine Netto-Long-Position von etwa 40 % bis 45 % zurück, während das rechnerische Bruttoengagement in den Bereich von rund 125 % bis 130 % fiel.
- Das fundamentale Short-Engagement wurde im Berichtszeitraum reduziert, vor allem durch einen Rückgang von Short-Positionen in den Sektoren Informationstechnologie, Kommunikationsdienste und Basiskonsumgüter.
- Das Short-Engagement auf dem Markt im Zusammenhang mit Absicherungsgeschäften nahm im Berichtszeitraum zu.

Die Wirtschaft verlangsamte sich zwar, war aber widerstandsfähiger als von vielen erwartet. Ein schwächeres Makro-Umfeld sowie politische und geopolitische Volatilität belasten allerdings Teile der Verbraucherbasis. Darüber hinaus deuten die weiteren Anzeichen auf eine Abschwächung des Arbeitsmarktes an, dass sich der Straffungszyklus der Fed auf die Gesamtwirtschaft auswirkt. Zur selben Zeit haben die politischen Unsicherheiten im Zusammenhang mit den Zoll- und Einwanderungsvorschlägen der Trump-Regierung zu Befürchtungen einer erneuten Inflation geführt. Vor diesem Hintergrund rechnet die US-Notenbank nun mit nur zwei Zinssenkungen im Jahr 2025. Bis wir mehr Klarheit über die Entwicklung der Wirtschaft und der Inflation haben und wie sich dies in tatsächlichen Zinssenkungen gegenüber den Erwartungen niederschlägt, rechnen wir mit einer anhaltenden Marktvolatilität. Darüber hinaus sind die globalen geopolitischen Spannungen nach wie vor allgegenwärtig und nehmen zu. Zudem könnte die globale politische Unsicherheit durch die neue Politik der Trump-Regierung eskalieren. Im aktuellen Umfeld dürfte sich unseres Erachtens daher im weiteren Verlauf immer klarer abzeichnen, dass sich die operative Leistung der zugrunde liegenden Unternehmen auseinanderentwickelt.

## US Multi Cap Opportunities – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2024 betrug die Gesamrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 20,68 %. Der S&P 500 Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der Index) rentierte im selben Zeitraum 24,50 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- US-Aktien erzielten im Jahr 2024 hohe Renditen. Die Stimmung der Anleger in Bezug auf Aktien wurde durch das anhaltende Wachstum der Wirtschafts- und Unternehmensgewinne, die Aussicht auf eine Normalisierung der Zinssätze und den Ausgang der US-Wahlen gestärkt.
- Der Offenmarktausschuss der US-Notenbank senkte die Spanne seines Leitzinses im Laufe des dritten und vierten Quartals um 100 Basispunkte.
- Im November gewann Donald Trump die US-Präsidentenwahlen und die Republikanische Partei übernahm die Kontrolle über den Senat und das Repräsentantenhaus. Die neue US-Regierung hat angedeutet, dass sie eine wirtschaftsfreundliche Agenda mit dem Schwerpunkt auf dem Wachstum der US-Wirtschaft verfolgen wird. Politische Veränderungen, wie z. B. die Möglichkeit höherer Handelszölle, können ebenfalls ein Risiko darstellen.
- Während die Renditen am Aktienmarkt insgesamt positiv ausfielen, führte die Outperformance von ausgewählten Large-Cap-Wachstumswerten- und IT-orientierten Namen zu einer erhöhten Marktkonzentration und einer geringeren Marktbreite. Im Berichtszeitraum übertraf der S&P 500 Index den S&P 500 Equal Weight Index um etwa 1.200 Basispunkte.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Gesamrendite:
  - Die positive Aktienausswahl in den Sektoren Basiskonsumgüter, Energie, Finanzen, Gesundheitswesen und Werkstoffe
  - Eine Übergewichtung der Sektoren Nicht-Basiskonsumgüter und Finanzen, eine Untergewichtung der Sektoren Energie und Gesundheitswesen und eine Nullgewichtung des Immobiliensektor
  - Die Marktbreite verbesserte sich von Ende Juni bis November, wobei die Gesamtpformance des Marktes weniger konzentriert wurde. Dies kam dem Multi-Cap-Ansatz und dem auf Fundamentaldaten ausgerichteten Anlageprozess des Portfolios zugute. Vom 30. Juni bis zum 30. November erzielte das Portfolio ein Plus von 15,07 % und übertraf damit seine Benchmark um 417 Basispunkte.
- Negativbeiträge zur relativen Gesamrendite:
  - Die Untergewichtung ausgewählter Large-Cap-Wachstumsaktien und des IT-Sektors
  - Eine Übergewichtung des Werkstoffsektors und die Einzeltitelauswahl im Industriesektor wirkten sich ebenfalls negativ aus

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Portfolio beendete den Berichtszeitraum mit einer Übergewichtung in den Sektoren Finanzen, Industrie und Werkstoffe sowie einer Untergewichtung im Gesundheitswesen und in der IT sowie ohne ein Engagement in Immobilien.

Wir denken, dass die Aussichten für US-Aktien und unsere Anlagestrategie günstig sind. Die Erwartung ist, dass sowohl die Wirtschaftstätigkeit als auch die Unternehmensgewinne wachsen werden. Dies wird durch eine Kombination aus wachstumsfördernden politischen Initiativen der US-Regierung, gesunden Ausgaben der US-Verbraucher, einem robusten Arbeitsmarkt, technologischer Innovation und einer sich stabilisierenden Inflation unterstützt. Wir glauben, dass eine Verbesserung der Marktbreite (weniger Marktkonzentration) für das diversifizierte Engagement des Portfolios in US-Aktien über Marktkapitalisierungen und Anlagestile hinweg vorteilhaft ist. Darüber hinaus werden das Zinsniveau und der Verlauf der Renditekurve wahrscheinlich vom Inflationsniveau, der zugrunde liegenden Gesundheit der Wirtschaft und der Entwicklung des US-Bundesdefizits beeinflusst werden. Wir denken, dass unsere auf den freien Cashflow ausgerichtete Strategie unseren Kunden in einem von sich verändernden Zinssätzen geprägten Umfeld zugutekommen wird.

## US Real Estate Securities – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2024 betrug die Gesamterrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD 14,06 %. Der als Benchmark dienende FTSE Nareit All Equity REITs Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der Index) verbuchte im selben Zeitraum 3,66 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamterrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die Aktienmärkte blieben trotz der durch die geopolitischen Spannungen verursachten Volatilität stabil, wobei Mega-Cap-Wachstumsaktien aufgrund des KI-Optimismus eine Outperformance erzielten. Die Gewinne wurden durch Bedenken in Bezug auf Kapitalanforderungen und Probleme in der Lieferkette gedämpft.
- Die anhaltende Inflation könnte die Zinsen auf einem hohen Niveau halten und sich auf das künftige Wirtschaftswachstum auswirken. Die Zinssenkungen der US-Notenbank gegen Ende des Jahres, von denen für 2025 weniger erwartet werden, sind eine Reaktion auf die höheren Wachstums- und Inflationsprognosen. Dieses Umfeld mit der Erwartung auf Wachstum und moderate Inflation ist angesichts des Optimismus der Anleger nach den Wahlen im Allgemeinen günstig für REITs.
- Insgesamt rentierte der S&P 500 Index im Berichtszeitraum 24,50 %. Im Gegensatz dazu erzielte der Index (nach Steuern) eine Rendite von 3,66 %. Immobilienwertpapiere wurden durch die Volatilität der Zinssätze beeinträchtigt.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Einzeltitelauswahl im Gesundheitswesen.
  - Die Einzeltitelauswahl im Wohnungssektor.
  - Die Untergewichtung von Industrie und Hotellerie/Resorts
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Einzeltitelauswahl im Sektor Büroraum
  - Die Einzeltitelauswahl bei Einkaufszentren.
  - Die Untergewichtung von Rechenzentren und eine Übergewichtung von REITs.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Der Sektorpositionierung des Portfolios liegt überwiegend die Bottom-up-Einzeltitelauswahl zugrunde. Am Ende des Berichtszeitraums bestanden die größten Übergewichtungen im Verhältnis zum Index in den Sektoren Fertighäuser und regionale Einkaufszentren. Im Gegensatz dazu waren die im Portfolio gegenüber dem Index am stärksten untergewichteten Sektoren zum einen diversifizierte Unternehmen und zum anderen Industrie.

2024 erwies sich für REITs als ein Jahr der Herausforderungen, zurückzuführen in erster Linie auf die erhöhte Volatilität der Zinssätze. Da jedoch im Vergleich zu den letzten beiden Jahren stabilere Zinssätze und eine Beschleunigung des Gewinnwachstums erwartet wird, sind REITs zu Beginn des Jahres 2025 gut positioniert. Langfristige Themen in Bezug auf das Mietwachstum, u. a. die alternde Bevölkerung (Seniorenwohnungen und Fertighäuser), die Rückverlagerung der Produktion (Industrie), generative KI (Rechenzentren) und die starke Verbrauchernachfrage (Einzelhandel), bleiben strategisch günstig. Darüber hinaus lässt der Angebotsdruck in verschiedenen Sektoren nach, darunter bei Wohnungen im Sunbelt, den US-Bundesstaaten im Süden und Südwesten, bei Lagerflächen und in der Industrie. Eine nur begrenzte Neubautätigkeit und ein möglicherweise besseres externes Wachstum dürfte für REITs mit soliden Bilanzen und guter Liquidität vorteilhaft sein. Wir rechnen damit, dass die Volatilität, bedingt durch ein sich entwickelndes Makro-Umfeld, sich ändernde Zinserwartungen, geopolitische Risiken und die Unsicherheit über die Wirtschafts- und Finanzpolitik der neuen Regierung, anhalten wird. Verbesserte Kreditspreads, die höhere Leitzinsen ausgleichen, haben die Kapitalkosten gesenkt und könnten den Markt für Immobilientransaktionen beleben. Unser Fokus liegt weiterhin auf REITs mit einer geringen Verschuldung, diversen Nachfragetreibern, hervorragenden Fundamentaldaten im Vergleich zu Mitbewerbern und klaren, transparenten Ertragsprofilen. Erfahrenen REITs mit guter Performance und soliden Bilanzen sollte es unseres Erachtens möglich sein, ihre marktführende Position zu festigen.

## US Small Cap – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2024 betrug die Gesamterrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD 18,76 %. Der als Benchmark dienende Russell 2000 Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der Index) verzeichnete im selben Zeitraum ein Plus von 11,11 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamterrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Trotz Phasen mit Volatilität erholte sich der Aktienmarkt als Ganzes im Laufe des Jahres deutlich. Ein robustes Wirtschaftswachstum, eine rückläufige Inflation, drei Zinssenkungen der US-Notenbank (Fed) und der Optimismus über die wachstumsfördernde Agenda des designierten Präsidenten Donald Trump stützten den Markt. Historisch gesehen profitieren Small-Cap-Aktien tendenziell von einer wachsenden Wirtschaft und niedrigeren Zinssätzen. Im Dezember kam es allerdings zu einem Ausverkauf bei Small-Cap-Aktien, als die Fed ihre Erwartungen für Zinssenkungen im Jahr 2025 zurückschraubte. Kleinere Unternehmen nutzen in der Regel eine höhere finanzielle Hebelwirkung, und weniger Zinssenkungen könnten sich auf ihre Kosten für den Schuldendienst auswirken.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Einzeltitelauswahl im Sektor Energie und unter Finanzwerten. Im Bereich Energie haben unsere Titel im Bereich Öl, Gas und fossile Brennstoffe den größten Mehrwert generiert. Viele unserer Titel im Finanzsektor verbuchten eine überdurchschnittliche Wertentwicklung.
  - Eine Übergewichtung von Technologie und eine Untergewichtung der Biotechnologiebranche erwiesen sich als vorteilhaft.
  - Zu den individuellen Aktien, die zum Wertbeiträge leisteten, gehörten Fair Isaac Corp., CSW Industrials, Inc. und Commvault Systems, Inc.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Einzeltitelauswahl in den Sektoren Informationstechnologie und Nicht-Basiskonsumgüter. In Informationstechnologie hatten unsere Beteiligungen in der Halbleiter- und Halbleiterausstattungsbranche einen negativen Effekt auf die Rendite. Im Sektor Nicht-Basiskonsumgüter schnitten die Beteiligungen im Bereich Fachhandel unterdurchschnittlich ab.
  - Die Untergewichtung des Portfolios von Finanzwerten und Energie minderte die relative Performance.
  - Zu den Einzeltiteln, die sich negativ entwickelten, gehörten Qualys, Inc., Fox Factory Holding Corp. und Power Integrations, Inc.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Am Ende des Berichtszeitraums fanden sich unsere größten Sektorübergewichtungen bei Industriewerten und im Sektor Informationstechnologie, und die größten Untergewichtungen waren das Gesundheitswesen und Finanzwerte.

Die aktuellen Wirtschaftsdaten und die Kommentare der US-Notenbank deuten an, dass das Tempo und das Ausmaß des aktuellen Zinssenkungszyklus langsamer und nicht so tiefgreifend sein werden, wie die meisten Marktteilnehmer noch vor einigen Monaten erwartet hatten. Die Märkte reagieren daher weiterhin sehr empfindlich auf Kommentare der US-Notenbank und die Wirtschaftsindikatoren, wobei die zunehmende Unsicherheit über zukünftige geldpolitische Maßnahmen Volatilität an die Märkte bringt. Wir sind nach wie vor zuversichtlich, dass unser qualitativ hochwertiges Portfolio aus Unternehmen mit attraktiven Finanzmerkmalen, differenzierten und beständigen Geschäftsmodellen und nachhaltigen Ertragssteigerungen gut aufgestellt ist, um diese unsicheren Zeiten zu überstehen und überdurchschnittliche risikobereinigte Ergebnisse zu liefern. Wir glauben, dass wir uns am Anfang der Reindustrialisierung Amerikas befinden. Darüber hinaus scheint die neue Regierung eine Pro-USA-, Pro-Wachstum und Pro-Wirtschaft-Politik zu verfolgen. Dies könnte zusammen zu einer bedeutenden Wirtschaftstätigkeit in den Vereinigten Staaten führen, die tendenziell kleinen Unternehmen zugutekommt, da diese den Großteil ihrer Einnahmen im Inland generieren.

## US Small Cap Intrinsic Value – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2024 betrug die Gesamterrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD 17,72 %. Der als Benchmark dienende Russell 2000 Value Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der Index) verzeichnete im selben Zeitraum ein Plus von 7,40 %. (Die Performance für alle Anteilsklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamterrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendeneträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

### Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- 2024 war ein verrücktes, volatiles Jahr, das von abrupten Stimmungsschwankungen und Anlegerpräferenzen für Aktien, Sektoren und Themen geprägt war. Im Laufe des Jahres konzentrierten sich die Anleger, mit unterschiedlichem Überzeugungsgrad, auf Gewinner im Bereich der künstlichen Intelligenz (KI), die Nutznießer von Zinsbewegungen wie Bauunternehmen und Banken, Unternehmen mit geringer Marktkapitalisierung, auf den Inlandsmarkt fokussierte Unternehmen, qualitativ hochwertige Unternehmen und Momentum-Aktien. Sie zeigten wenig Interesse – und gingen in einigen Fällen aggressiv Leerverkäufe ein – an Unternehmen mit Produkten, die bei Fortschritten in der KI als anfällig wahrgenommen wurden. Gleiches galt für Unternehmen mit hoher Verschuldung, Substanzwerte ohne Momentum, Tweeners (Unternehmen ohne überzeugende Faktorattribute) und Unternehmen aus dem Gesundheitswesen.
- Der Blick zurück auf das Jahr zeigt die Dinge, die uns überrascht haben und solche, die keine Überraschung waren.
  - Überraschungen im Jahr 2024
    - Die positiven Auswirkungen der Wahl auf unsere relative Performance, insbesondere nach den Ereignissen im Jahr 2016.
    - Der Einfluss von DOGE und RFK Jr. auf Unternehmen aus den Bereichen Verteidigung, Gesundheitswesen und Basiskonsumgüter.
    - Die nur leichten Auswirkungen der anhaltenden geopolitischen Turbulenzen auf die Rohstoffpreise.
    - Das Risiko, als Investor in ein börsennotiertes Unternehmen zu investieren, das von Private-Equity-Investoren kontrolliert wird.
  - Keine Überraschungen im Jahr 2024
    - Die Trendwende bzgl. der Nutznießer von Zinsbewegungen im vierten Quartal.
    - Die wachsende Erkenntnis, dass die Inflation hartnäckig bleiben würde.
    - Feste Arbeitsmärkte und eine widerstandsfähige Wirtschaft.
    - Die anhaltende Outperformance von Large-Cap-Wachstumsaktien.

### Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur Gesamterrendite:
  - Der Blick auf unsere Aktien mit der besten Wertentwicklung zeigt einen starken positiven Performancebeitrag durch das Thema KI/Rechenzentren.
  - Die Zuordnung nach Sektoren im Verhältnis zum Index spiegelt ebenfalls die positiven Auswirkungen des Themas KI/Rechenzentren wider.
  - Zu den Sektoren mit positiven relativen Renditen gehören Versorgungsunternehmen, für die die Nachfrage nach Strom für Rechenzentren und Informationstechnologie als Motor wirkt.
- Negativbeiträge zur Gesamterrendite:
  - Unsere Aktien mit der schlechtesten Performance illustrieren einige der sich hier abzeichnenden Überraschungen.
  - Die Zuordnung nach Sektoren im Verhältnis zum Index spiegelt die negativen Auswirkungen des Gesundheitswesens in Kombination mit einer Untergewichtung der Nutznießer von Zinsbewegungen (Finanzwesen) wider.

### Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Wir sind in vielen unterbewerteten Unternehmen investiert, bei denen eine kleine positive Veränderung der Fundamentaldaten zu einer deutlichen Verbesserung des Aktienkurses führen kann. Wir bleiben aber auch, wenn auch in geringerem Umfang, unseren Gewinnern von 2024 treu. Die Kombination aus Aktien, die sich bewährt haben, und vielen, die sich noch bewähren müssen, führte zu einem Abschlag beim inneren Wert von 32 %. Wenn wir auf frühere Zeiträume mit einem ähnlichen Abschlag auf den inneren Wert zurückblicken, zeichnet sich unseres Erachtens die Möglichkeit ab, dass absolute und relative zukünftige Renditen möglich sind.
- Während die langfristigen Renditen attraktiv bleiben, waren die letzten drei Jahre mühselig. Eine Teilerklärung ist „Mean Reversion“, also die Rückkehr zum Mittelwert, im Nachhinein hätten wir aber vielleicht mit mehr Geschick die Sektoren wechseln sollen. Wir vermuten, dass die extreme Geduld, die wir bei Investitionen üben, zusammen mit unseren Sektorausrichtungen den mehr taktischen Handel verhindert. Wir finden aber immer noch überzeugende Ideen, um das Portfolio mit dem Ziel aufzufrischen, das Risiko-Rendite-Profil unserer Strategie zu verbessern. In den letzten drei Jahren haben wir 28 neue Ideen (neun im Jahr 2024) aus einer Vielzahl an Sektoren eingeführt, die in unseren Augen den Grundstein für eine bessere Performance in den kommenden Jahren legen werden.

Was erwartet uns im Jahr 2025? Wir vermuten mehr des Gleichen: Volatilität und Stimmungsschwankungen und viele Überraschungen. Wie könnte es auch anders sein? Wir haben einen sprunghaften und hitzköpfigen Präsidenten, der von dem innovativsten und disruptivsten Unternehmer des letzten Jahrhunderts beraten wird. Hinzu kommt obendrein, dass eine transformative Technologie kurz vor ihrer Entfesselung steht. Wir empfehlen Ihnen, während des gesamten Fluges angeschnallt zu bleiben.

Die schwierigere Frage ist, ob Small Caps wieder an ihre alte Performance anknüpfen können. Unsere beste Prognose ist, dass attraktive zukünftige Renditen von Small Caps wahrscheinlich sind, eine Outperformance aber schwieriger zu vorhersagen ist. In einer früheren Mitteilung haben wir dargelegt, warum es ohne eine Rezession und Zinsrückgänge schwer vorstellbar ist, dass kleine Unternehmen ihren großen Pendants gegenüber Outperformance verzeichnen, wir sind aber schon lange genug im Geschäft, um zu wissen, dass die Vergangenheit nicht unbedingt ein Indikator für die Zukunft ist. Wie immer sind wir Ihnen für Ihr Vertrauen in unsere Strategie dankbar und werden uns bemühen, attraktive absolute und relative Renditen zu erzielen.

## Absolute Return Multi Strategy - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der Anteile                                 | Wertpapierbezeichnung          | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--------------------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Aktien 0,00 % (31. Dezember 2023: 100,00 %)</b> |                                |                  |                              |
| <b>US-Dollar</b>                                   |                                |                  |                              |
| 1.356  | Clementia Pharmaceuticals Inc† | 0                | 0,00                         |
| 1.250  | Tobira Therapeutics Inc†       | 0                | 0,00                         |
| <b>Aktien insgesamt</b>                            |                                | <b>0</b>         | <b>0,00</b>                  |
| <b>Anlagen insgesamt</b>                           |                                | <b>0</b>         | <b>0,00</b>                  |

|  | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|------------------|------------------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> | <b>0</b>         | <b>0,00</b>                  |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>           | <b>0</b>         | <b>0,00</b>                  |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>   | <b>0</b>         | <b>0,00</b>                  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                | <b>0</b>         | <b>0,00</b>                  |

| Portfolioanalyse                                   | US\$     | % des<br>Gesamtver-<br>mögens |
|--|----------|-------------------------------|
| † Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente | 0        | 0,00                          |
| <b>Anlagen insgesamt</b>                           | <b>0</b> | <b>0,00</b>                   |

## Asia Responsible Transition Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                              | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 73,63 % (31. Dezember 2023: 71,46 %)</b> |  |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |  |        |                       |                  |                              |
| 200.000  | AIA Group Ltd**                                    | 2,70 % | 31.12.2149            | 192.936          | 0,68                         |
| 200.000  | AIA Group Ltd*                                     | 3,20 % | 16.09.2040            | 149.286          | 0,52                         |
| 200.000  | AIA Group Ltd**                                    | 5,38 % | 05.04.2034            | 198.945          | 0,70                         |
| 200.000  | Alibaba Group Holding Ltd**                        | 2,13 % | 09.02.2031            | 168.611          | 0,59                         |
| 200.000  | Alibaba Group Holding Ltd*                         | 4,40 % | 06.12.2057            | 158.517          | 0,56                         |
| 400.000  | Axis Bank Ltd*                                     | 4,10 % | 31.12.2149            | 383.098          | 1,34                         |
| 400.000  | Bangkok Bank PCL**                                 | 3,73 % | 25.09.2034            | 362.832          | 1,27                         |
| 200.000  | Bangkok Bank PCL**                                 | 5,00 % | 31.12.2149            | 198.470          | 0,70                         |
| 200.000  | Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT**             | 3,75 % | 30.03.2026            | 195.341          | 0,68                         |
| 200.000  | Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT*              | 4,30 % | 31.12.2149            | 191.239          | 0,67                         |
| 375.000  | Bank of East Asia Ltd**                            | 6,75 % | 27.06.2034            | 375.184          | 1,31                         |
| 200.000  | BOC Aviation Ltd*                                  | 3,00 % | 11.09.2029            | 183.807          | 0,64                         |
| 200.000  | BOC Aviation Ltd*                                  | 4,50 % | 23.05.2028            | 197.273          | 0,69                         |
| 300.000  | CAS Capital No 1 Ltd*                              | 4,00 % | 31.12.2149            | 287.540          | 1,01                         |
| 300.000  | Cathaylife Singapore Pte Ltd**                     | 5,95 % | 05.07.2034            | 309.834          | 1,09                         |
| 200.000  | CCBL Cayman 1 Corp Ltd*                            | 1,80 % | 22.07.2026            | 190.750          | 0,67                         |
| 400.000  | CDBL Funding 2*                                    | 2,00 % | 04.03.2026            | 387.155          | 1,36                         |
| 200.000  | CFAMC III Co Ltd*                                  | 4,25 % | 07.11.2027            | 192.346          | 0,67                         |
| 400.000  | China Cinda 2020 I Management Ltd**                | 5,50 % | 23.01.2030            | 400.121          | 1,40                         |
| 200.000  | China Cinda 2020 I Management Ltd**                | 5,75 % | 28.05.2029            | 201.944          | 0,71                         |
| 400.000  | China Construction Bank Corp*                      | 2,45 % | 24.06.2030            | 394.881          | 1,38                         |
| 200.000  | China Overseas Grand Oceans Finance IV Cayman Ltd* | 2,45 % | 09.02.2026            | 191.191          | 0,67                         |
| 200.000  | CICC Hong Kong Finance 2016 MTN Ltd*               | 5,49 % | 01.03.2026            | 201.421          | 0,71                         |
| 200.000  | CK Hutchison International 21 Ltd*                 | 2,50 % | 15.04.2031            | 171.736          | 0,60                         |
| 390.000  | CK Hutchison International 23 Ltd**                | 4,88 % | 21.04.2033            | 379.929          | 1,33                         |
| 500.000  | Dua Capital Ltd*                                   | 2,78 % | 11.05.2031            | 434.424          | 1,52                         |
| 200.000  | Elect Global Investments Ltd*                      | 4,10 % | 31.12.2149            | 190.850          | 0,67                         |
| 200.000  | ENN Clean Energy International Investment Ltd**    | 3,38 % | 12.05.2026            | 194.920          | 0,68                         |
| 400.000  | Fortune Star BVI Ltd**                             | 5,00 % | 18.05.2026            | 384.657          | 1,35                         |
| 250.000  | FWD Group Holdings Ltd**                           | 7,64 % | 02.07.2031            | 266.977          | 0,94                         |
| 200.000  | FWD Group Holdings Ltd**                           | 8,05 % | 31.12.2149            | 199.625          | 0,70                         |
| 200.000  | Globe Telecom Inc*                                 | 4,20 % | 31.12.2149            | 195.406          | 0,68                         |
| 200.000  | GLP China Holdings Ltd**                           | 2,95 % | 29.03.2026            | 180.480          | 0,63                         |
| 200.000  | GLP Pte Ltd**                                      | 3,88 % | 04.06.2025            | 193.052          | 0,68                         |
| 334.000  | Greenko Power II Ltd*                              | 4,30 % | 13.12.2028            | 314.836          | 1,10                         |
| 400.000  | HDFC Bank Ltd**                                    | 3,70 % | 31.12.2149            | 375.210          | 1,31                         |
| 200.000  | Hyundai Capital America**                          | 5,60 % | 30.03.2028            | 202.542          | 0,71                         |
| 200.000  | Hyundai Card Co Ltd*                               | 5,75 % | 24.04.2029            | 203.009          | 0,71                         |
| 200.000  | Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT**                | 3,54 % | 27.04.2032            | 177.291          | 0,62                         |

## Asia Responsible Transition Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung  | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 73,63 % (31. Dezember 2023: 71,46 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |        |                       |                  |                              |
| 400.000  | Industrial & Commercial Bank of China Ltd**                      | 4,88 % | 21.09.2025            | 399.419          | 1,40                         |
| 313.000  | IRB Infrastructure Developers Ltd**                              | 7,11 % | 11.03.2032            | 316.885          | 1,11                         |
| 200.000  | JD.com Inc**   | 3,38 % | 14.01.2030            | 184.873          | 0,65                         |
| 221.250  | JSW Hydro Energy Ltd*  | 4,13 % | 18.05.2031            | 199.794          | 0,70                         |
| 300.000  | Kasikornbank PCL*  | 3,34 % | 02.10.2031            | 287.293          | 1,01                         |
| 200.000  | Kookmin Bank**   | 2,50 % | 04.11.2030            | 170.442          | 0,60                         |
| 273.000  | Lenovo Group Ltd*  | 5,83 % | 27.01.2028            | 276.956          | 0,97                         |
| 200.000  | Longfor Group Holdings Ltd**                                     | 3,95 % | 16.09.2029            | 150.422          | 0,53                         |
| 300.000  | Medco Bell Pte Ltd**   | 6,38 % | 30.01.2027            | 300.073          | 1,05                         |
| 300.000  | Meituan*   | 3,05 % | 28.10.2030            | 265.664          | 0,93                         |
| 200.000  | Metropolitan Bank & Trust Co*                                    | 5,50 % | 06.03.2034            | 199.263          | 0,70                         |
| 200.000  | Nanshan Life Pte Ltd**   | 5,45 % | 11.09.2034            | 193.997          | 0,68                         |
| 300.000  | NWD Finance BVI Ltd*   | 5,25 % | 31.12.2149            | 132.334          | 0,46                         |
| 200.000  | Oversea-Chinese Banking Corp Ltd**                               | 1,83 % | 10.09.2030            | 195.365          | 0,68                         |
| 200.000  | Oversea-Chinese Banking Corp Ltd*                                | 4,60 % | 15.06.2032            | 198.094          | 0,69                         |
| 800.000  | Pertamina Persero PT*  | 6,50 % | 27.05.2041            | 835.023          | 2,93                         |
| 300.000  | Power Finance Corp Ltd*  | 3,35 % | 16.05.2031            | 265.927          | 0,93                         |
| 400.000  | Prudential Funding Asia Plc*                                     | 2,95 % | 03.11.2033            | 364.389          | 1,28                         |
| 250.000  | Reliance Industries Ltd*   | 3,63 % | 12.01.2052            | 172.822          | 0,61                         |
| 200.000  | ReNew Wind Energy AP2/ReNew Power Pvt Ltd other 9 Subsidiaries** | 4,50 % | 14.07.2028            | 185.933          | 0,65                         |
| 200.000  | SF Holding Investment 2021 Ltd*                                  | 3,13 % | 17.11.2031            | 176.875          | 0,62                         |
| 300.000  | Shinhan Bank Co Ltd**  | 3,88 % | 24.03.2026            | 295.483          | 1,04                         |
| 200.000  | Shinhan Bank Co Ltd*   | 4,38 % | 13.04.2032            | 185.500          | 0,65                         |
| 200.000  | Shinhan Financial Group Co Ltd*                                  | 3,34 % | 05.02.2030            | 199.646          | 0,70                         |
| 200.000  | Shriram Finance Ltd**  | 6,63 % | 22.04.2027            | 201.910          | 0,71                         |
| 200.000  | Singapore Telecommunications Ltd**                               | 7,38 % | 01.12.2031            | 226.876          | 0,80                         |
| 300.000  | SK Hynix Inc**   | 5,50 % | 16.01.2029            | 301.572          | 1,06                         |
| 200.000  | SK Hynix Inc*  | 6,38 % | 17.01.2028            | 206.362          | 0,72                         |
| 200.000  | SMIC SG Holdings Pte Ltd*  | 5,38 % | 24.07.2029            | 198.916          | 0,70                         |
| 400.000  | Standard Chartered Plc*  | 4,30 % | 31.12.2149            | 358.500          | 1,26                         |
| 200.000  | Standard Chartered Plc*  | 6,19 % | 06.07.2027            | 203.396          | 0,71                         |
| 200.000  | Standard Chartered Plc*  | 6,30 % | 06.07.2034            | 207.749          | 0,73                         |
| 600.000  | Standard Chartered Plc*  | 6,30 % | 09.01.2029            | 616.470          | 2,16                         |
| 200.000  | Star Energy Geothermal Darajat II/Star Energy Geothermal Salak*  | 4,85 % | 14.10.2038            | 185.924          | 0,65                         |
| 200.000  | Sun Hung Kai Properties Capital Market Ltd*                      | 2,75 % | 13.05.2030            | 177.725          | 0,62                         |
| 200.000  | Sunac China Holdings Ltd**                                       | 7,25 % | 30.09.2030            | 23.014           | 0,08                         |
| 200.000  | Tencent Holdings Ltd*  | 3,24 % | 03.06.2050            | 132.894          | 0,47                         |
| 200.000  | Thaioil Treasury Center Co Ltd*                                  | 3,75 % | 18.06.2050            | 126.944          | 0,44                         |
| 500.000  | TSMC Global Ltd*   | 2,25 % | 23.04.2031            | 426.415          | 1,49                         |

## Asia Responsible Transition Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                              | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 73,63 % (31. Dezember 2023: 71,46 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                   |                              |
| 400.000  | United Overseas Bank Ltd*                          | 3,86 %  | 07.10.2032            | 387.882           | 1,36                         |
| 200.000  | Vedanta Resources Finance II Plc**                 | 10,88 % | 17.09.2029            | 207.128           | 0,73                         |
| 400.000  | Woori Bank**                                       | 6,38 %  | 31.12.2149            | 405.637           | 1,42                         |
| 200.000  | Yanlord Land HK Co Ltd**                           | 5,13 %  | 20.05.2026            | 189.515           | 0,66                         |
| 300.000  | Zhongsheng Group Holdings Ltd*                     | 5,98 %  | 30.01.2028            | 297.444           | 1,04                         |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>  |  |         |                       | <b>21.012.411</b> | <b>73,63</b>                 |
| <b>Staatsanleihen 17,85 % (31. Dezember 2023: 18,81 %)</b>                     |  |         |                       |                   |                              |
| <b>Euro</b>  |  |         |                       |                   |                              |
| 400.000  | Indonesia Government International Bond            | 1,10 %  | 12.03.2033            | 339.936           | 1,19                         |
| 508.000  | Indonesia Government International Bond            | 1,40 %  | 30.10.2031            | 456.431           | 1,60                         |
| 200.000  | Philippine Government International Bond           | 1,20 %  | 28.04.2033            | 172.474           | 0,61                         |
| <b>Euro insgesamt</b>  |  |         |                       | <b>968.841</b>    | <b>3,40</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>   |  |         |                       |                   |                              |
| 200.000  | Airport Authority                                  | 2,40 %  | 31.12.2149            | 184.697           | 0,65                         |
| 200.000  | City of Ulaanbaatar Mongolia                       | 7,75 %  | 21.08.2027            | 204.279           | 0,72                         |
| 400.000  | Development Bank of Mongolia LLC                   | 11,00 % | 07.03.2026            | 416.500           | 1,46                         |
| 200.000  | Export-Import Bank of India                        | 2,25 %  | 13.01.2031            | 168.823           | 0,59                         |
| 200.000  | Export-Import Bank of Korea                        | 4,50 %  | 15.09.2032            | 192.976           | 0,68                         |
| 200.000  | Export-Import Bank of Korea                        | 5,00 %  | 11.01.2028            | 201.245           | 0,71                         |
| 95.000   | Indonesia Government International Bond            | 7,75 %  | 17.01.2038            | 114.878           | 0,40                         |
| 500.000  | Indonesia Government International Bond            | 8,50 %  | 12.10.2035            | 623.004           | 2,18                         |
| 200.000  | Korea Development Bank                             | 4,38 %  | 15.02.2028            | 197.808           | 0,69                         |
| 200.000  | Korea Development Bank                             | 4,38 %  | 15.02.2033            | 190.824           | 0,67                         |
| 400.000  | Korea Gas Corp                                     | 5,00 %  | 08.07.2029            | 400.753           | 1,40                         |
| 400.000  | Korea Mine Rehabilitation & Mineral Resources Corp | 5,38 %  | 11.05.2028            | 403.296           | 1,41                         |
| 200.000  | Pakistan Government International Bond             | 6,00 %  | 08.04.2026            | 188.427           | 0,66                         |
| 97.374   | Sri Lanka Government International Bond            | 3,10 %  | 15.01.2030            | 80.820            | 0,28                         |
| 190.998  | Sri Lanka Government International Bond            | 3,35 %  | 15.03.2033            | 145.407           | 0,51                         |
| 128.968  | Sri Lanka Government International Bond            | 3,60 %  | 15.06.2035            | 93.502            | 0,33                         |
| 89.506   | Sri Lanka Government International Bond            | 3,60 %  | 15.05.2036            | 68.248            | 0,24                         |
| 179.088  | Sri Lanka Government International Bond            | 3,60 %  | 15.02.2038            | 137.235           | 0,48                         |
| 119.235  | Sri Lanka Government International Bond            | 4,00 %  | 15.04.2028            | 111.938           | 0,39                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |  |         |                       | <b>4.124.660</b>  | <b>14,45</b>                 |
| <b>Staatsanleihen insgesamt *</b>  |  |         |                       | <b>5.093.501</b>  | <b>17,85</b>                 |
| <b>Anlagen insgesamt</b>   |  |         |                       | <b>26.105.912</b> | <b>91,48</b>                 |

## Asia Responsible Transition Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 0,35 % (31. Dezember 2023: 0,20 %)

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 488.228 THB   | 14.334 US\$         | 19.03.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 57                             | 0,00                 |
| 5.288.702 THB   | 153.448 US\$        | 09.01.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 1.723                          | 0,00                 |
| 351.007 US\$  | 2.555.853 CNY       | 02.04.2025       | BNP Paribas                 | 1         | 2.070                          | 0,01                 |
| 660.555 US\$  | 4.707.773 CNY       | 02.01.2025       | Citibank NA                 | 1         | 15.588                         | 0,05                 |
| 295.244 US\$  | 2.116.919 CNY       | 13.02.2025       | Citibank NA                 | 1         | 6.722                          | 0,02                 |
| 87.005 US\$   | 2.889.269 THB       | 09.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | 2.234                          | 0,01                 |
| 147.775 US\$  | 2.296.568.818 IDR   | 06.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | 5.341                          | 0,02                 |
| 148.541 US\$  | 4.711.724 TWD       | 22.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | 5.231                          | 0,02                 |
| 647.561 US\$  | 4.621.964 CNY       | 06.01.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 11.326                         | 0,04                 |
| 246.097 US\$  | 8.025.219 THB       | 02.01.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 10.719                         | 0,04                 |
| 216.005 US\$  | 3.399.481.233 IDR   | 06.01.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 5.167                          | 0,02                 |
| 498.894 US\$  | 16.645.890 THB      | 09.01.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 2         | 10.501                         | 0,04                 |
| 148.193 US\$  | 657.561 MYR         | 06.03.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 740                            | 0,00                 |
| 146.634 US\$  | 4.993.322 THB       | 21.01.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 36                             | 0,00                 |
| 9.858 US\$  | 43.942 MYR          | 19.03.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 0                              | 0,00                 |
| 279.795 US\$  | 2.011.421 CNY       | 02.01.2025       | Standard Chartered Bank     | 2         | 4.230                          | 0,01                 |
| 1.030.635 US\$  | 976.556 €           | 19.03.2025       | Standard Chartered Bank     | 1         | 16.063                         | 0,06                 |
| 97.754 US\$   | 139.271.100 KRW     | 19.03.2025       | UBS AG                      | 1         | 3.256                          | 0,01                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>101.004</b>                 | <b>0,35</b>          |

### Futures-Kontrakte 0,12 % (31. Dezember 2023: 0,40 %)

| Anzahl Kontrakte   | Beschreibung                                     | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|--|--------------------------------|----------------------|
| (6)  | Euro-Bund Future March 2025                      | 12.923                         | 0,05                 |
| (20)   | US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2025 | 19.891                         | 0,07                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten <sup>*</sup></b> |  | <b>32.814</b>                  | <b>0,12</b>          |

### Zinsswap-Kontrakte 0,00 % (31. Dezember 2023: 0,00 %)

| Nominalwert  | Fälligkeit | Gegenpartei                    | Erhalt/(Zahlung)# | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|------------|--------------------------------|-------------------|-----------------|--------------------|--------------------------------|----------------------|
| CNY 2.225.639  | 11.12.2029 | LCH Clearenet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)         | 1,48 %          | 7D CNRR            | 171                            | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Zinsswapkontrakten <sup>∞</sup></b> |            |                                |                   |                 |                    | <b>171</b>                     | <b>0,00</b>          |

#Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

|  | Zeitwert US\$     | % des Nettovermögens |
|--|-------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> | <b>26.239.901</b> | <b>91,95</b>         |

## Asia Responsible Transition Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (0,29 %) (31. Dezember 2023: (0,21 %))

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 93.585 CNY   | 12.917 US\$         | 19.03.2025       | BNP Paribas                 | 1         | (148)                           | (0,00)               |
| 4.707.773 CNY  | 654.867 US\$        | 02.01.2025       | Citibank NA                 | 1         | (9.900)                         | (0,04)               |
| 2.031.861 CNY  | 288.056 US\$        | 06.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (8.361)                         | (0,03)               |
| 680.777 CNY  | 97.824 US\$         | 06.01.2025       | Standard Chartered Bank     | 1         | (4.112)                         | (0,02)               |
| 2.011.421 CNY  | 287.651 US\$        | 02.01.2025       | Standard Chartered Bank     | 2         | (12.085)                        | (0,04)               |
| 5.799.802.426 IDR  | 379.794 US\$        | 06.01.2025       | Standard Chartered Bank     | 1         | (20.088)                        | (0,07)               |
| 21.948.734 ¥   | 147.338 US\$        | 06.03.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | (6.671)                         | (0,02)               |
| 4.917.893 THB  | 146.092 US\$        | 19.03.2025       | Citibank NA                 | 2         | (1.134)                         | (0,00)               |
| 7.990.134 THB  | 250.004 US\$        | 02.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (15.655)                        | (0,06)               |
| 163.077 THB  | 4.916 US\$          | 02.01.2025       | Standard Chartered Bank     | 1         | (133)                           | (0,00)               |
| 360.236 THB  | 11.117 US\$         | 02.01.2025       | UBS AG                      | 2         | (551)                           | (0,00)               |
| 3.870.735 THB  | 114.164 US\$        | 09.01.2025       | UBS AG                      | 1         | (597)                           | (0,00)               |
| 4.757.994 TWD  | 147.110 US\$        | 22.01.2025       | Standard Chartered Bank     | 1         | (2.392)                         | (0,01)               |
| 14.288 US\$  | 488.228 THB         | 02.01.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | (32)                            | (0,00)               |
| 146.985 US\$   | 656.288 MYR         | 26.02.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | (137)                           | (0,00)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>(81.996)</b>                 | <b>(0,29)</b>        |

### Futures-Kontrakte (0,24 %) (31. Dezember 2023: (0,20 %))

| Anzahl Kontrakte  | Beschreibung                                    | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---|---------------------------------|----------------------|
| 9   | US Treasury 2-Year Note (CBT) Future March 2025 | (1.603)                         | (0,01)               |
| 7   | US Treasury 5-Year Note (CBT) Future March 2025 | (5.211)                         | (0,02)               |
| 13  | US Treasury Ultra Bond (CBT) Future March 2025  | (61.106)                        | (0,21)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten <sup>*</sup></b> |   | <b>(67.920)</b>                 | <b>(0,24)</b>        |

|   | Zeitwert US\$     | % des Nettovermögens |
|---|-------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(149.916)</b>  | <b>(0,53)</b>        |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>26.089.985</b> | <b>91,42</b>         |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>2.446.676</b>  | <b>8,58</b>          |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>28.536.661</b> | <b>100,00</b>        |

| Portfolioanalyse  | US\$              | % des Gesamtvermögens |
|---|-------------------|-----------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 16.998.467        | 59,14                 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden            | 9.107.445         | 31,69                 |
| ± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden                          | (35.106)          | (0,12)                |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap                            | 19.179            | 0,07                  |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>26.089.985</b> | <b>90,78</b>          |

## China A-Share Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der<br>Anteile                               | Wertpapierbezeichnung                                   | Zeitwert<br>CNY | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|-----------------|------------------------------|
| <b>Aktien 100,14 % (31. Dezember 2023: 94,84 %)</b> |   |                 |                              |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi</b>                   |   |                 |                              |
| 36.500  | Air China Ltd Class A                                   | 288.715         | 1,97                         |
| 52.600  | Bank of Changsha Co Ltd Class A                         | 467.614         | 3,19                         |
| 32.500  | Bank of Hangzhou Co Ltd Class A                         | 474.825         | 3,24                         |
| 50.200  | Bank of Jiangsu Co Ltd Class A                          | 492.964         | 3,36                         |
| 28.300  | Bank of Nanjing Co Ltd Class A                          | 301.395         | 2,06                         |
| 2.600   | Betta Pharmaceuticals Co Ltd Class A                    | 140.218         | 0,96                         |
| 25.600  | Bluestar Adisseo Co Class A                             | 321.280         | 2,19                         |
| 1.500   | BYD Co Ltd Class A                                      | 423.990         | 2,89                         |
| 9.300   | Chacha Food Co Ltd Class A                              | 270.165         | 1,84                         |
| 36.200  | China Construction Bank Corp Class A                    | 318.198         | 2,17                         |
| 8.900   | China Merchants Bank Co Ltd Class A                     | 349.770         | 2,39                         |
| 53.000  | CMOC Group Ltd Class A                                  | 352.450         | 2,40                         |
| 1.900   | Contemporary Amperex Technology Co Ltd Class A          | 505.400         | 3,45                         |
| 1.560   | Eastroc Beverage Group Co Ltd Class A                   | 387.691         | 2,64                         |
| 6.300   | Foshan Haitian Flavouring & Food Co Ltd Class A         | 289.170         | 1,97                         |
| 3.900   | Goneo Group Co Ltd Class A                              | 273.936         | 1,87                         |
| 18.500  | Haier Smart Home Co Ltd Class A                         | 526.695         | 3,59                         |
| 6.100   | Henan Shuanghui Investment & Development Co Ltd Class A | 158.356         | 1,08                         |
| 13.500  | Hisense Visual Technology Co Ltd Class A                | 269.190         | 1,84                         |
| 600   | Hithink RoyalFlush Information Network Co Ltd Class A   | 172.500         | 1,18                         |
| 1.400   | Imeik Technology Development Co Ltd Class A             | 255.500         | 1,74                         |
| 22.800  | Inner Mongolia Yuan Xing Energy Co Ltd Class A          | 127.452         | 0,87                         |
| 6.000   | Jiangsu Xinquan Automotive Trim Co Ltd Class A          | 256.200         | 1,75                         |
| 6.200   | Jiangsu Yanghe Distillery Co Ltd Class A                | 517.886         | 3,53                         |
| 185   | Kweichow Moutai Co Ltd Class A                          | 281.940         | 1,92                         |
| 14.300  | Luxshare Precision Industry Co Ltd Class A              | 582.868         | 3,97                         |
| 6.300   | Midea Group Co Ltd Class A                              | 473.886         | 3,23                         |
| 4.808   | Montage Technology Co Ltd Class A                       | 326.463         | 2,23                         |
| 6.200   | Ningbo Tuopu Group Co Ltd Class A                       | 303.800         | 2,07                         |
| 16.600  | SAIC Motor Corp Ltd Class A                             | 344.616         | 2,35                         |
| 6.900   | SF Holding Co Ltd Class A                               | 278.070         | 1,90                         |
| 23.100  | Shandong Sinocera Functional Material Co Ltd Class A    | 393.624         | 2,68                         |
| 1.122   | Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co Ltd Class A | 286.110         | 1,95                         |
| 5.240   | Sungrow Power Supply Co Ltd Class A                     | 386.870         | 2,64                         |
| 8.600   | Three Squirrels Inc Class A                             | 317.082         | 2,16                         |
| 3.500   | Xiamen Faratronic Co Ltd Class A                        | 416.220         | 2,84                         |
| 28.900  | Yunnan Aluminium Co Ltd Class A                         | 391.017         | 2,67                         |
| 13.200  | Yunnan Yuntianhua Co Ltd Class A                        | 294.360         | 2,01                         |

## China A-Share Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile  | Wertpapierbezeichnung                               | Zeitwert CNY        | % des Nettovermögens         |
|---|---|---------------------|------------------------------|
| <b>Aktien 100,14 % (31. Dezember 2023: 94,84 %) (Fortsetzung)</b>                                       |   |                     |                              |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi (Fortsetzung)</b>   |   |                     |                              |
| 12.100  | Zhejiang Sanhua Intelligent Controls Co Ltd Class A | 284.471             | 1,94                         |
| 3.300   | Zhongji Innolight Co Ltd Class A                    | 407.583             | 2,78                         |
| 8.200   | ZTE Corp Class A                                    | 331.280             | 2,26                         |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt</b>   |   | <b>14.041.820</b>   | <b>95,77</b>                 |
| <b>Hongkong-Dollar</b>  |   |                     |                              |
| 12.000  | Geely Automobile Holdings Ltd                       | 168.077             | 1,15                         |
| 1.200   | Tencent Holdings Ltd                                | 472.928             | 3,22                         |
| <b>Hongkong-Dollar insgesamt</b>  |   | <b>641.005</b>      | <b>4,37</b>                  |
| <b>Aktien insgesamt *</b>   |   | <b>14.682.825</b>   | <b>100,14</b>                |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  |   | <b>14.682.825</b>   | <b>100,14</b>                |
|   |   | <b>Zeitwert CNY</b> | <b>% des Nettovermögens</b>  |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>  |   | <b>14.682.825</b>   | <b>100,14</b>                |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>            |   | <b>14.682.825</b>   | <b>100,14</b>                |
| <b>Sonstige Nettoverbindlichkeiten</b>  |   | <b>(20.124)</b>     | <b>(0,14)</b>                |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                 |   | <b>14.662.701</b>   | <b>100,00</b>                |
| <b>Portfolioanalyse</b>   |   | <b>CNY</b>          | <b>% des Gesamtvermögens</b> |
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind |   | 14.682.825          | 98,16                        |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  |   | <b>14.682.825</b>   | <b>98,16</b>                 |

## China Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                              | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>CNY   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 55,20 % (31. Dezember 2023: 63,24 %)</b> |  |         |                       |                   |                              |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi</b>                                |  |         |                       |                   |                              |
| 10.000.000   | Agricultural Bank of China Ltd**                   | 3,10 %  | 06.05.2030            | 10.050.410        | 7,99                         |
| 500.000  | Bank of Chengdu Co Ltd*                            | 0,70 %  | 03.03.2028            | 700.775           | 0,56                         |
| 400.000  | Bank of Hangzhou Co Ltd*                           | 1,20 %  | 29.03.2027            | 516.360           | 0,41                         |
| 10.000.000   | Central Huijin Investment Ltd**                    | 2,80 %  | 27.10.2026            | 10.202.640        | 8,12                         |
| 200.000  | China CITIC Bank Corp Ltd*                         | 4,00 %  | 04.03.2025            | 250.076           | 0,20                         |
| 250.000  | China Southern Airlines Co Ltd*                    | 1,50 %  | 15.10.2026            | 313.850           | 0,25                         |
| 5.000.000  | Guotai Junan Securities Co Ltd**                   | 3,16 %  | 15.02.2026            | 5.083.570         | 4,04                         |
| 350.000  | LONGi Green Energy Technology Co Ltd*              | 0,80 %  | 05.01.2028            | 371.350           | 0,29                         |
| 300.000  | Luxshare Precision Industry Co Ltd*                | 1,80 %  | 03.11.2026            | 355.440           | 0,28                         |
| 10.000.000   | State Grid Corp of China**                         | 2,11 %  | 28.08.2027            | 10.110.350        | 8,04                         |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt</b>                      |  |         |                       | <b>37.954.821</b> | <b>30,18</b>                 |
| <b>US-Dollar</b>   |  |         |                       |                   |                              |
| 250.000  | CAS Capital No 1 Ltd*                              | 4,00 %  | 31.12.2149            | 1.759.147         | 1,40                         |
| 250.000  | Central Plaza Development Ltd*                     | 4,65 %  | 19.01.2026            | 1.795.731         | 1,43                         |
| 200.000  | CFAMC II Co Ltd*                                   | 5,50 %  | 16.01.2025            | 1.473.219         | 1,17                         |
| 200.000  | China Cinda 2020 I Management Ltd**                | 5,50 %  | 23.01.2030            | 1.468.744         | 1,17                         |
| 200.000  | China Overseas Grand Oceans Finance IV Cayman Ltd* | 2,45 %  | 09.02.2026            | 1.403.631         | 1,11                         |
| 200.000  | FEC Finance Ltd**                                  | 12,76 % | 31.12.2149            | 1.463.675         | 1,16                         |
| 200.000  | Fortune Star BVI Ltd**                             | 5,00 %  | 18.05.2026            | 1.411.979         | 1,12                         |
| 200.000  | GLP Pte Ltd**                                      | 3,88 %  | 04.06.2025            | 1.417.290         | 1,13                         |
| 500.000  | Guangzhou Metro Investment Finance BVI Ltd**       | 1,51 %  | 17.09.2025            | 3.578.197         | 2,84                         |
| 300.000  | Meituan**  | 0,00 %  | 27.04.2028            | 2.093.828         | 1,67                         |
| 300.000  | Melco Resorts Finance Ltd*                         | 5,25 %  | 26.04.2026            | 2.171.831         | 1,73                         |
| 200.000  | NWD Finance BVI Ltd**                              | 6,15 %  | 31.12.2149            | 890.964           | 0,71                         |
| 500.000  | Sands China Ltd**                                  | 3,80 %  | 08.01.2026            | 3.602.387         | 2,86                         |
| 500.000  | Shanghai Port Group BVI Development 2 Co Ltd*      | 1,50 %  | 13.07.2025            | 3.604.844         | 2,87                         |
| 200.000  | Studio City Finance Ltd**                          | 6,00 %  | 15.07.2025            | 1.467.908         | 1,17                         |
| 250.000  | Sunny Optical Technology Group Co Ltd*             | 5,95 %  | 17.07.2026            | 1.857.456         | 1,48                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>                                       |  |         |                       | <b>31.460.831</b> | <b>25,02</b>                 |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>                            |  |         |                       | <b>69.415.652</b> | <b>55,20</b>                 |
| <b>Staatsanleihen 37,69 % (31. Dezember 2023: 20,89 %)</b>       |  |         |                       |                   |                              |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi</b>                                |  |         |                       |                   |                              |
| 10.000.000   | Agricultural Development Bank of China             | 2,50 %  | 24.08.2027            | 10.286.630        | 8,18                         |
| 5.000.000  | China Development Bank                             | 2,34 %  | 05.01.2027            | 5.097.098         | 4,06                         |
| 5.000.000  | China Government Bond                              | 1,91 %  | 15.07.2029            | 5.113.330         | 4,07                         |

## China Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung       | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>CNY    | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|-----------------------------|--------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 37,69 % (31. Dezember 2023: 20,89 %) (Fortsetzung)</b> |                             |        |                       |                    |                              |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi (Fortsetzung)</b>                          |                             |        |                       |                    |                              |
| 1.000.000  | China Government Bond       | 1,99 % | 15.03.2026            | 1.011.373          | 0,80                         |
| 1.000.000  | China Government Bond       | 2,00 % | 15.06.2025            | 1.004.662          | 0,80                         |
| 10.000.000   | China Government Bond       | 2,05 % | 15.04.2029            | 10.275.200         | 8,17                         |
| 3.000.000  | China Government Bond       | 2,67 % | 25.05.2033            | 3.227.055          | 2,57                         |
| 1.000.000  | China Government Bond       | 3,00 % | 15.10.2053            | 1.229.200          | 0,98                         |
| 10.000.000   | Export-Import Bank of China | 2,01 % | 12.04.2027            | 10.138.625         | 8,06                         |
| <b>Staatsanleihen insgesamt **</b>                                       |                             |        |                       | <b>47.383.173</b>  | <b>37,69</b>                 |
| <b>Anlagen insgesamt</b>   |                             |        |                       | <b>116.798.825</b> | <b>92,89</b>                 |

Devisenterminkontrakte 1,31 % (31. Dezember 2023: 0,42 %)

| Geforderter<br>Betrag  | Zu zahlender<br>Betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei             | Kontrakte | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn CNY | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|------------------------|-----------------------|-------------------------|-----------|-------------------------------------|------------------------------|
| 816.458 US\$   | 5.957.697 CNY          | 06.01.2025            | JPMorgan Chase Bank     | 1         | 138.909                             | 0,11                         |
| 2.948.304 US\$   | 21.282.122 CNY         | 17.01.2025            | Standard Chartered Bank | 2         | 363.320                             | 0,29                         |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>                                      |                        |                       |                         |           |                                     |                              |
| 2.821 CNY  | 365 €                  | 16.01.2025            | JPMorgan Chase Bank     | 1         | 43                                  | 0,00                         |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>                                      |                        |                       |                         |           |                                     |                              |
| 7 CNY  | 1 £                    | 13.03.2025            | JPMorgan Chase Bank     | 2         | 0                                   | 0,00                         |
| <i>Abgesicherte Klassen USD</i>                                      |                        |                       |                         |           |                                     |                              |
| 12.107.765 US\$  | 87.627.278 CNY         | 13.03.2025            | JPMorgan Chase Bank     | 2         | 1.128.915                           | 0,90                         |
| 178.586 US\$   | 1.291.289 CNY          | 13.03.2025            | UBS AG                  | 1         | 17.839                              | 0,01                         |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ~</b> |                        |                       |                         |           | <b>1.649.026</b>                    | <b>1,31</b>                  |

Futures-Kontrakte 0,01 % (31. Dezember 2023: 0,13 %)

| Anzahl<br>Kontrakte   | Beschreibung                                    | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn CNY | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|-------------------------------------|------------------------------|
| 6   | US Treasury 2-Year Note (CBT) Future March 2025 | 14.109                              | 0,01                         |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten *</b> |   | <b>14.109</b>                       | <b>0,01</b>                  |

Zinsswap-Kontrakte 0,01 % (31. Dezember 2023: 0,00 %)

| Nominalwert   | Fälligkeit | Gegenpartei         | Erhalt/(Zahlung)# | Fester<br>Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn CNY | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|------------|---------------------|-------------------|--------------------|--------------------|-------------------------------------|------------------------------|
| CNY 1.300.000   | 11.12.2029 | JPMorgan Chase Bank | (Zahlung)         | 1,48 %             | 7D CNRR            | 5.674                               | 0,01                         |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Zinsswapkontrakten ~</b> |            |                     |                   |                    |                    | <b>5.674</b>                        | <b>0,01</b>                  |

#Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

## China Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

|  | Zeitwert<br>CNY    | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|--------------------|------------------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> | <b>118.467.634</b> | <b>94,22</b>                 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (1,19 %) (31. Dezember 2023: (0,51 %))

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei             | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust CNY | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 21.054.449 CNY   | 2.948.304 US\$      | 17.01.2025       | Citibank NA             | 1         | (590.993)                      | (0,47)               |
| 7.833.044 CNY  | 1.113.262 US\$      | 22.04.2025       | JPMorgan Chase Bank     | 1         | (311.921)                      | (0,25)               |
| 15.555.571 CNY   | 2.194.059 US\$      | 14.11.2025       | Standard Chartered Bank | 1         | (286.811)                      | (0,23)               |
| 5.364.387 CNY  | 754.245 US\$        | 20.11.2025       | Standard Chartered Bank | 1         | (79.618)                       | (0,06)               |
| 5.827.472 CNY  | 829.340 US\$        | 06.01.2025       | JPMorgan Chase Bank     | 2         | (233.486)                      | (0,18)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                         |           | <b>(1.502.829)</b>             | <b>(1,19)</b>        |

|   | Zeitwert<br>CNY    | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|---|--------------------|------------------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(1.502.829)</b> | <b>(1,19)</b>                |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>116.964.805</b> | <b>93,03</b>                 |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>8.769.059</b>   | <b>6,97</b>                  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>125.733.864</b> | <b>100,00</b>                |

| Portfolioanalyse  | CNY                | % des<br>Gesamtver-<br>mögens |
|---|--------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 16.573.710         | 12,98                         |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden            | 100.225.115        | 78,50                         |
| ± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden                          | 14.109             | 0,01                          |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente   | 151.871            | 0,12                          |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>116.964.805</b> | <b>91,61</b>                  |

## China Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der<br>Anteile                              | Wertpapierbezeichnung  | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------------------|------------------------------|
| <b>Aktien 97,60 % (31. Dezember 2023: 96,46 %)</b> |  |                    |                              |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi</b>                  |  |                    |                              |
| 638.500  | Beijing New Building Materials Plc Class A                     | 2.636.101          | 1,91                         |
| 160.003  | Changzhou Xingyu Automotive Lighting Systems Co Ltd Class A    | 2.909.106          | 2,11                         |
| 508.400  | Chaozhou Three-Circle Group Co Ltd Class A                     | 2.666.823          | 1,94                         |
| 180.040  | Contemporary Amperex Technology Co Ltd Class A                 | 6.523.277          | 4,73                         |
| 1.650.053  | Luxshare Precision Industry Co Ltd Class A                     | 9.161.092          | 6,65                         |
| 550.031  | Midea Group Co Ltd Class A                                     | 5.635.542          | 4,09                         |
| 900.000  | Neway Valve Suzhou Co Ltd Class A                              | 2.717.837          | 1,97                         |
| 3.308.816  | Satellite Chemical Co Ltd Class A                              | 8.468.658          | 6,14                         |
| 230.024  | Shenzhen Sunlord Electronics Co Ltd Class A                    | 986.332            | 0,72                         |
| 130.000  | Sieyuan Electric Co Ltd Class A                                | 1.287.339          | 0,93                         |
| 75.071   | Suzhou Maxwell Technologies Co Ltd Class A                     | 1.075.218          | 0,78                         |
| 350.059  | Wanhua Chemical Group Co Ltd Class A                           | 3.402.126          | 2,47                         |
| 600.022  | Zhejiang Shuanghuan Driveline Co Ltd Class A                   | 2.502.578          | 1,82                         |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt</b>        |  | <b>49.972.029</b>  | <b>36,26</b>                 |
| <b>Hongkong-Dollar</b>                             |  |                    |                              |
| 1.125.000  | Akeso Inc  | 8.790.929          | 6,38                         |
| 650.000  | Alibaba Group Holding Ltd                                      | 6.894.998          | 5,00                         |
| 6.376.000  | CGN Power Co Ltd - H Shares                                    | 2.339.305          | 1,70                         |
| 8.200.000  | China Construction Bank Corp - H Shares                        | 6.840.415          | 4,96                         |
| 1.050.000  | China Merchants Bank Co Ltd - H Shares                         | 5.406.832          | 3,92                         |
| 1.495.000  | China Pacific Insurance Group Co Ltd - H Shares                | 4.849.928          | 3,52                         |
| 825.228  | China Resources Beer Holdings Co Ltd                           | 2.682.433          | 1,95                         |
| 549.000  | Cowell e Holdings Inc  | 2.000.103          | 1,45                         |
| 650.000  | Haier Smart Home Co Ltd - H Shares                             | 2.301.122          | 1,67                         |
| 325.000  | Meituan Class B  | 6.346.913          | 4,61                         |
| 765.000  | Shenzhou International Group Holdings Ltd                      | 6.105.858          | 4,43                         |
| 240.000  | Tencent Holdings Ltd   | 12.883.708         | 9,35                         |
| 350.000  | Xiaomi Corp Class B  | 1.554.464          | 1,13                         |
| 700.000  | Zhuzhou CRRC Times Electric Co Ltd - H Shares                  | 2.955.735          | 2,14                         |
| 5.500.000  | Zoomlion Heavy Industry Science & Technology Co Ltd - H Shares | 4.035.814          | 2,93                         |
| <b>Hongkong-Dollar insgesamt</b>                   |  | <b>75.988.557</b>  | <b>55,14</b>                 |
| <b>US-Dollar</b>                                   |  |                    |                              |
| 25.213   | New Oriental Education & Technology Group Inc ADR              | 1.618.170          | 1,17                         |
| 35.500   | Trip.com Group Ltd ADR   | 2.437.430          | 1,77                         |
| 230.000  | ZTO Express Cayman Inc ADR                                     | 4.496.500          | 3,26                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>                         |  | <b>8.552.100</b>   | <b>6,20</b>                  |
| <b>Aktien insgesamt *</b>                          |  | <b>134.512.686</b> | <b>97,60</b>                 |

## China Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile  | Wertpapierbezeichnung              | Fälligkeitsdatum | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens |
|---|------------------------------------|------------------|--------------------|----------------------|
| <b>Participatory Notes 0,19 % (31. Dezember 2023: 0,00 %)</b> |                                    |                  |                    |                      |
| <b>US-Dollar</b>  |                                    |                  |                    |                      |
| 61.500  | Beijing New Building Materials Plc | 10.11.2025       | 255.378            | 0,19                 |
| <b>Participatory Notes insgesamt **</b>                       |                                    |                  | <b>255.378</b>     | <b>0,19</b>          |
| <b>Anlagen insgesamt</b>                                      |                                    |                  | <b>134.768.064</b> | <b>97,79</b>         |

Devisenterminkontrakte 0,50 % (31. Dezember 2023: 0,31 %)

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i>   |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 27.401 US\$   | 23.972 CHF          | 16.01.2025       | UBS AG                      | 8         | 908                            | 0,00                 |
| 206.965 US\$  | 180.880 CHF         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 12        | 7.075                          | 0,01                 |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>   |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 25 €  | 26 US\$             | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | 0                              | 0,00                 |
| 192.593 US\$  | 178.421 €           | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 5         | 7.740                          | 0,01                 |
| 7.173.437 US\$  | 6.518.006 €         | 16.01.2025       | UBS AG                      | 9         | 420.453                        | 0,30                 |
| 145.113 US\$  | 135.120 €           | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 14        | 5.121                          | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>   |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 64.810 US\$   | 86.532 SGD          | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 5         | 1.343                          | 0,00                 |
| 59.104 US\$   | 78.493 SGD          | 16.01.2025       | UBS AG                      | 5         | 1.534                          | 0,00                 |
| 5.048.876 US\$  | 6.554.207 SGD       | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 18        | 241.731                        | 0,18                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>o</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>685.905</b>                 | <b>0,50</b>          |

|  |  |  | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens |
|--|--|--|--------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |  |  | <b>135.453.969</b> | <b>98,29</b>         |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,63 %) (31. Dezember 2023: (0,24 %))

| Geforderter Betrag              | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i> |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 467 CHF                         | 531 US\$            | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (15)                            | (0,00)               |
| 26.530 CHF                      | 30.898 US\$         | 16.01.2025       | UBS AG                      | 10        | (1.581)                         | (0,00)               |
| 223.561 CHF                     | 263.670 US\$        | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 9         | (16.613)                        | (0,01)               |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 126.138 €                       | 139.640 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 2         | (8.954)                         | (0,01)               |
| 8.410.205 €                     | 9.266.789 US\$      | 16.01.2025       | UBS AG                      | 10        | (553.393)                       | (0,40)               |
| 207.100 €                       | 221.419 US\$        | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 10        | (6.853)                         | (0,01)               |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i> |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 16.346 SGD                      | 12.291 US\$         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (302)                           | (0,00)               |

## China Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (0,63 %) (31. Dezember 2023: (0,24 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei          | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens         |
|---|---------------------|------------------|----------------------|-----------|---------------------------------|------------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen SGD (Fortsetzung)</i>   |                     |                  |                      |           |                                 |                              |
| 88.024 SGD  | 66.885 US\$         | 16.01.2025       | UBS AG               | 6         | (2.325)                         | (0,00)                       |
| 7.488.213 SGD   | 5.769.125 US\$      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp | 12        | (276.940)                       | (0,20)                       |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>                          |                     |                  |                      |           | <b>(866.976)</b>                | <b>(0,63)</b>                |
|   |                     |                  |                      |           | <b>Zeitwert US\$</b>            | <b>% des Nettovermögens</b>  |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> |                     |                  |                      |           | <b>(866.976)</b>                | <b>(0,63)</b>                |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              |                     |                  |                      |           | <b>134.586.993</b>              | <b>97,66</b>                 |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  |                     |                  |                      |           | <b>3.227.755</b>                | <b>2,34</b>                  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   |                     |                  |                      |           | <b>137.814.748</b>              | <b>100,00</b>                |
| <b>Portfolioanalyse</b>   |                     |                  |                      |           | <b>US\$</b>                     | <b>% des Gesamtvermögens</b> |
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind   |                     |                  |                      |           | 134.512.686                     | 95,93                        |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden              |                     |                  |                      |           | 255.378                         | 0,18                         |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente   |                     |                  |                      |           | (181.071)                       | (0,13)                       |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  |                     |                  |                      |           | <b>134.586.993</b>              | <b>95,98</b>                 |

## Climate Innovation – Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der<br>Anteile                              | Wertpapierbezeichnung                         | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|------------------|------------------------------|
| <b>Aktien 95,71 % (31. Dezember 2023: 96,88 %)</b> |   |                  |                              |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi</b>                  |   |                  |                              |
| 2.300  | Contemporary Ampere Technology Co Ltd Class A | 83.334           | 2,70                         |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt</b>        |   | <b>83.334</b>    | <b>2,70</b>                  |
| <b>Euro</b>  |   |                  |                              |
| 1.557  | DSM-Firmenich AG                              | 157.551          | 5,11                         |
| 954  | Heidelberg Materials AG                       | 117.853          | 3,83                         |
| 5.636  | Iberdrola SA                                  | 77.620           | 2,52                         |
| 2.454  | Infineon Technologies AG                      | 79.791           | 2,59                         |
| <b>Euro insgesamt</b>                              |   | <b>432.815</b>   | <b>14,05</b>                 |
| <b>Hongkong-Dollar</b>                             |   |                  |                              |
| 3.500  | BYD Co Ltd - H Shares                         | 120.122          | 3,90                         |
| <b>Hongkong-Dollar insgesamt</b>                   |   | <b>120.122</b>   | <b>3,90</b>                  |
| <b>Indische Rupie</b>                              |   |                  |                              |
| 174  | Dixon Technologies India Ltd                  | 36.449           | 1,18                         |
| 618  | InterGlobe Aviation Ltd                       | 32.867           | 1,07                         |
| 465  | Kaynes Technology India Ltd                   | 40.246           | 1,30                         |
| <b>Indische Rupie insgesamt</b>                    |   | <b>109.562</b>   | <b>3,55</b>                  |
| <b>Japanischer Yen</b>                             |   |                  |                              |
| 7.000  | Hitachi Ltd                                   | 171.632          | 5,57                         |
| <b>Japanischer Yen insgesamt</b>                   |   | <b>171.632</b>   | <b>5,57</b>                  |
| <b>Neuer taiwanesischer Dollar</b>                 |   |                  |                              |
| 3.000  | Silergy Corp                                  | 36.923           | 1,20                         |
| 2.000  | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd     | 65.580           | 2,13                         |
| <b>Neuer taiwanesischer Dollar insgesamt</b>       |   | <b>102.503</b>   | <b>3,33</b>                  |
| <b>Südkoreanischer Won</b>                         |   |                  |                              |
| 629  | Hanmi Semiconductor Co Ltd                    | 34.480           | 1,12                         |
| 184  | HD Hyundai Heavy Industries Co Ltd            | 35.635           | 1,16                         |
| 1.446  | Kia Corp                                      | 97.850           | 3,17                         |
| 113  | L&F Co Ltd                                    | 6.109            | 0,20                         |
| 3.355  | Samsung Heavy Industries Co Ltd               | 25.597           | 0,83                         |
| 149  | Samsung SDI Co Ltd                            | 24.628           | 0,80                         |
| <b>Südkoreanischer Won insgesamt</b>               |   | <b>224.299</b>   | <b>7,28</b>                  |

## Climate Innovation – Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile   | Wertpapierbezeichnung           | Zeitwert US\$        | % des Nettovermögens        |
|--|---------------------------------|----------------------|-----------------------------|
| <b>Aktien 95,71 % (31. Dezember 2023: 96,88 %) (Fortsetzung)</b>                                       |                                 |                      |                             |
| <b>Schweizer Franken</b>   |                                 |                      |                             |
| 1.019  | ABB Ltd                         | 55.103               | 1,79                        |
| <b>Schweizer Franken insgesamt</b>   |                                 | <b>55.103</b>        | <b>1,79</b>                 |
| <b>US-Dollar</b>   |                                 |                      |                             |
| 220  | Albemarle Corp                  | 18.938               | 0,62                        |
| 178  | Applied Materials Inc           | 28.948               | 0,94                        |
| 981  | Bentley Systems Inc Class B     | 45.813               | 1,49                        |
| 89   | Builders FirstSource Inc        | 12.721               | 0,41                        |
| 107  | Cadence Design Systems Inc      | 32.149               | 1,04                        |
| 97   | DR Horton Inc                   | 13.562               | 0,44                        |
| 592  | First Solar Inc                 | 104.334              | 3,39                        |
| 375  | FTAI Aviation Ltd               | 54.015               | 1,75                        |
| 191  | GE Vernova Inc                  | 62.826               | 2,04                        |
| 5.198  | GFL Environmental Inc           | 231.519              | 7,51                        |
| 492  | Howmet Aerospace Inc            | 53.810               | 1,75                        |
| 2.409  | NEXTracker Inc Class A          | 88.001               | 2,86                        |
| 2.621  | nVent Electric Plc              | 178.647              | 5,80                        |
| 138  | NXP Semiconductors NV           | 28.683               | 0,93                        |
| 1.330  | ON Semiconductor Corp           | 83.856               | 2,72                        |
| 152  | Onto Innovation Inc             | 25.334               | 0,82                        |
| 245  | PTC Inc                         | 45.048               | 1,46                        |
| 577  | Quanta Services Inc             | 182.361              | 5,92                        |
| 1.807  | Sunrun Inc                      | 16.715               | 0,54                        |
| 58   | Synopsys Inc                    | 28.151               | 0,91                        |
| 377  | Trane Technologies Plc          | 139.245              | 4,52                        |
| 654  | Xylem Inc                       | 75.877               | 2,46                        |
| 257  | Zebra Technologies Corp Class A | 99.259               | 3,22                        |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |                                 | <b>1.649.812</b>     | <b>53,54</b>                |
| <b>Aktien insgesamt *</b>  |                                 | <b>2.949.182</b>     | <b>95,71</b>                |
| <b>Anlagen insgesamt</b>   |                                 | <b>2.949.182</b>     | <b>95,71</b>                |
|  |                                 | <b>Zeitwert US\$</b> | <b>% des Nettovermögens</b> |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |                                 | <b>2.949.182</b>     | <b>95,71</b>                |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>           |                                 | <b>2.949.182</b>     | <b>95,71</b>                |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>   |                                 | <b>132.294</b>       | <b>4,29</b>                 |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                |                                 | <b>3.081.476</b>     | <b>100,00</b>               |

## Climate Innovation – Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

| Portfolioanalyse  | US\$             | % des<br>Gesamtver-<br>mögens |
|---|------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 2.949.182        | 94,85                         |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>2.949.182</b> | <b>94,85</b>                  |

## CLO Income - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag  | Wertpapierbezeichnung                                    | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Schatzwechsel 7,47 % (31. Dezember 2023: 2,69 %)</b>                                     |  |         |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar</b>  |  |         |                       |                   |                              |
| 80.225.000  | United States Treasury Bill                              | 0,00 %  | 21.01.2025            | 80.045.443        | 7,47                         |
| <b>Schatzwechsel insgesamt **</b>   |  |         |                       | <b>80.045.443</b> | <b>7,47</b>                  |
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 87,21 % (31. Dezember 2023: 86,02 %)</b> |  |         |                       |                   |                              |
| <b>Euro</b>   |  |         |                       |                   |                              |
| 1.750.000   | Adagio X Eur CLO DAC Series X-X Class ER                 | 11,58 % | 20.10.2037            | 1.844.291         | 0,17                         |
| 6.000.000   | Aqueduct European CLO 10 DAC Series 2024-10X Class E     | 8,46 %  | 18.01.2039            | 6.216.106         | 0,58                         |
| 3.000.000   | Aqueduct European CLO 10 DAC Series 2024-10X Class F     | 10,88 % | 18.01.2039            | 3.059.902         | 0,29                         |
| 1.896.000   | Aqueduct European CLO 3-2019 DAC Series 2019-3X Class ER | 8,95 %  | 15.08.2034            | 2.030.329         | 0,19                         |
| 1.700.000   | Aqueduct European CLO 6-2021 DAC Series 2021-6X Class E  | 9,14 %  | 15.12.2034            | 1.821.735         | 0,17                         |
| 3.500.000   | Aqueduct European CLO 7-2022 DAC Series 2022-7X Class ER | 8,85 %  | 15.08.2037            | 3.726.677         | 0,35                         |
| 3.000.000   | Aqueduct European CLO 8 DAC Series 2024-8X Class E       | 9,38 %  | 15.07.2037            | 3.151.899         | 0,29                         |
| 9.500.000   | Arbour CLO XIII DAC Series 13X Class E                   | 9,56 %  | 15.08.2038            | 10.077.605        | 0,94                         |
| 1.470.000   | Ares European CLO X DAC Series 10X Class F               | 10,25 % | 15.10.2031            | 1.550.475         | 0,14                         |
| 1.050.000   | Armada Euro CLO I DAC Series 1X Class ER                 | 9,19 %  | 24.10.2033            | 1.108.082         | 0,10                         |
| 2.500.000   | Armada Euro CLO II DAC Series 2X Class ER                | 9,12 %  | 15.02.2037            | 2.642.536         | 0,25                         |
| 1.500.000   | Armada Euro CLO V DAC Series 5X Class E                  | 9,04 %  | 28.07.2034            | 1.580.169         | 0,15                         |
| 3.000.000   | Armada Euro CLO VI DAC Series 6X Class D                 | 6,54 %  | 15.07.2037            | 3.139.898         | 0,29                         |
| 3.000.000   | Armada Euro CLO VI DAC Series 6X Class E                 | 9,43 %  | 15.07.2037            | 3.148.521         | 0,29                         |
| 2.000.000   | Armada Euro CLO VI DAC Series 6X Class F                 | 11,18 % | 15.07.2037            | 2.077.817         | 0,19                         |
| 3.000.000   | Aurium CLO III DAC Series 3X Class E                     | 8,08 %  | 16.04.2030            | 3.124.394         | 0,29                         |
| 1.200.000   | Aurium CLO VI DAC Series 6X Class ER                     | 9,04 %  | 22.05.2034            | 1.268.279         | 0,12                         |
| 1.767.000   | Aurium CLO VII DAC Series 7X Class E                     | 8,88 %  | 15.05.2034            | 1.853.031         | 0,17                         |
| 2.000.000   | Aurium CLO X DAC Series 10X Class DR                     | 5,90 %  | 17.04.2037            | 2.103.010         | 0,20                         |
| 2.400.000   | Aurium CLO X DAC Series 10X Class ER                     | 9,00 %  | 17.04.2037            | 2.533.990         | 0,24                         |
| 2.250.000   | Aurium CLO XII DAC Series 12X Class E                    | 9,27 %  | 17.10.2037            | 2.379.508         | 0,22                         |
| 3.000.000   | Aurium CLO XII DAC Series 12X Class F                    | 11,52 % | 17.10.2037            | 3.064.331         | 0,29                         |
| 5.782.000   | Avoca Capital CLO X Ltd Series 10X Class ERR             | 8,88 %  | 15.04.2035            | 6.132.620         | 0,57                         |
| 4.000.000   | Avoca CLO XI DAC Series 11X Class ERR                    | 8,99 %  | 15.10.2038            | 4.204.860         | 0,39                         |
| 2.000.000   | Avoca CLO XI DAC Series 11X Class FRR                    | 11,09 % | 15.10.2038            | 2.082.934         | 0,19                         |
| 2.500.000   | Avoca CLO XII DAC Series 12X Class ERR                   | 9,01 %  | 15.04.2034            | 2.638.202         | 0,25                         |
| 1.500.000   | Avoca CLO XIII DAC Series 13X Class ERR                  | 9,01 %  | 15.04.2034            | 1.583.396         | 0,15                         |
| 2.500.000   | Avoca CLO XVI DAC Series 16X Class FRR                   | 11,26 % | 15.10.2037            | 2.549.919         | 0,24                         |
| 3.232.000   | Avoca CLO XVII DAC Series 17X Class ER                   | 9,56 %  | 15.10.2032            | 3.423.660         | 0,32                         |
| 1.500.000   | Avoca CLO XVIII DAC Series 18X Class DR                  | 5,71 %  | 15.01.2038            | 1.554.027         | 0,14                         |
| 5.000.000   | Avoca CLO XVIII DAC Series 18X Class ER                  | 8,41 %  | 15.01.2038            | 5.180.089         | 0,48                         |
| 2.500.000   | Avoca CLO XVIII DAC Series 18X Class FR                  | 1,09 %  | 15.01.2038            | 2.549.919         | 0,24                         |
| 1.000.000   | Avoca CLO XXIII DAC Series 23X Class D                   | 5,84 %  | 15.04.2034            | 1.046.097         | 0,10                         |
| 4.500.000   | Avoca CLO XXIII DAC Series 23X Class E                   | 8,55 %  | 15.04.2034            | 4.765.714         | 0,44                         |

## CLO Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag  | Wertpapierbezeichnung                                    | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|---|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 87,21 % (31. Dezember 2023: 86,02 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 1.400.000   | Avoca CLO XXIV DAC Series 24X Class ER                   | 8,56 %  | 15.07.2034            | 1.491.565        | 0,14                         |
| 1.000.000   | Avoca CLO XXIX DAC Series 29X Class F                    | 10,88 % | 15.04.2037            | 1.030.704        | 0,10                         |
| 3.000.000   | Avoca CLO XXV DAC Series 25X Class F                     | 11,49 % | 15.10.2034            | 3.149.106        | 0,29                         |
| 2.000.000   | Avoca CLO XXVI DAC Series 26X Class E                    | 9,30 %  | 15.04.2035            | 2.127.802        | 0,20                         |
| 2.400.000   | Avoca CLO XXVI DAC Series 26X Class F                    | 11,91 % | 15.04.2035            | 2.539.791        | 0,24                         |
| 4.500.000   | Avoca CLO XXX DAC Series 30X Class E                     | 9,38 %  | 15.07.2037            | 4.713.944        | 0,44                         |
| 2.500.000   | Avoca CLO XXX DAC Series 30X Class F                     | 10,99 % | 15.07.2037            | 2.582.053        | 0,24                         |
| 2.500.000   | Avoca CLO XXXI DAC Series 31X Class F                    | 11,80 % | 15.07.2038            | 2.605.489        | 0,24                         |
| 1.750.000   | Avoca Static CLO I DAC Series 1X Class DR                | 5,74 %  | 15.01.2035            | 1.823.464        | 0,17                         |
| 5.450.000   | Avoca Static CLO I DAC Series 1X Class ER                | 8,64 %  | 15.01.2035            | 5.688.234        | 0,53                         |
| 2.000.000   | Bain Capital Euro CLO 2022-1 DAC Series 2022-1X Class ER | 10,21 % | 19.10.2037            | 2.093.852        | 0,20                         |
| 2.000.000   | Bain Capital Euro CLO 2023-1 DAC Series 2023-1X Class E  | 10,20 % | 25.10.2037            | 2.088.806        | 0,19                         |
| 1.100.000   | Bain Capital Euro CLO 2023-1 DAC Series 2023-1X Class F  | 11,86 % | 25.10.2037            | 1.146.869        | 0,11                         |
| 3.100.000   | BlackRock European CLO XIV DAC Series 14X Class E        | 10,46 % | 15.07.2036            | 3.214.816        | 0,30                         |
| 1.000.000   | BlackRock European CLO XIV DAC Series 14X Class F        | 13,01 % | 15.07.2036            | 1.036.991        | 0,10                         |
| 3.500.000   | BlackRock European CLO XV DAC Series 15X Class D         | 5,96 %  | 28.01.2038            | 3.626.062        | 0,34                         |
| 2.600.000   | BlackRock European CLO XV DAC Series 15X Class E         | 8,41 %  | 28.01.2038            | 2.693.646        | 0,25                         |
| 1.045.000   | Bridgepoint CLO 3 DAC Series 3X Class D                  | 6,19 %  | 15.01.2036            | 1.097.309        | 0,10                         |
| 2.500.000   | Bridgepoint CLO VI DAC Series 6X Class E                 | 9,68 %  | 14.11.2036            | 2.620.102        | 0,24                         |
| 3.000.000   | Bridgepoint CLO VII DAC Series 7X Class E                | 8,94 %  | 20.10.2038            | 3.160.870        | 0,29                         |
| 2.000.000   | Bridgepoint CLO VII DAC Series 7X Class F                | 11,12 % | 20.10.2038            | 2.071.546        | 0,19                         |
| 2.000.000   | Cabinteely Park CLO DAC Series 1X Class D                | 6,37 %  | 15.08.2034            | 2.091.495        | 0,20                         |
| 3.865.000   | Carysfort Park CLO DAC Series 2021-1X Class D            | 9,21 %  | 28.07.2034            | 4.096.864        | 0,38                         |
| 3.450.000   | CIFC European Funding CLO II DAC Series 2X Class E       | 7,82 %  | 15.04.2033            | 3.604.075        | 0,34                         |
| 1.010.000   | CIFC European Funding CLO IV DAC Series 4X Class E       | 8,71 %  | 18.08.2035            | 1.070.279        | 0,10                         |
| 2.000.000   | CIFC European Funding VI DAC Series 6X Class E           | 9,38 %  | 15.10.2037            | 2.126.795        | 0,20                         |
| 2.440.000   | Clarinda Park CLO DAC Series 1X Class DRR                | 8,59 %  | 15.02.2034            | 2.571.723        | 0,24                         |
| 3.000.000   | Clonkeen Park CLO DAC Series 2024-1X Class E             | 9,64 %  | 15.10.2037            | 3.203.778        | 0,30                         |
| 1.200.000   | Clonkeen Park CLO DAC Series 2024-1X Class F             | 12,13 % | 15.10.2037            | 1.260.807        | 0,12                         |
| 3.000.000   | Contego CLO VIII DAC Series 8X Class ER                  | 9,15 %  | 25.01.2034            | 3.173.369        | 0,30                         |
| 1.000.000   | Contego CLO XII DAC Series 12X Class E                   | 11,21 % | 25.01.2038            | 1.053.412        | 0,10                         |
| 2.000.000   | Contego CLO XII DAC Series 12X Class F                   | 11,43 % | 25.01.2038            | 2.075.142        | 0,19                         |
| 1.200.000   | Cumulus Static CLO 2024-1 DAC Series 2024-1X Class E     | 9,26 %  | 15.11.2033            | 1.258.103        | 0,12                         |
| 1.300.000   | CVC Cordatus Loan Fund VI DAC Series 6X Class D1RR       | 6,44 %  | 15.10.2037            | 1.361.914        | 0,13                         |
| 4.000.000   | CVC Cordatus Loan Fund VI DAC Series 6X Class ERR        | 9,51 %  | 15.10.2037            | 4.204.713        | 0,39                         |
| 1.850.000   | CVC Cordatus Loan Fund VI DAC Series 6X Class F1RR       | 10,95 % | 15.10.2037            | 1.950.819        | 0,18                         |
| 2.000.000   | CVC Cordatus Loan Fund VII DAC Series 7X Class ER        | 8,21 %  | 15.09.2031            | 2.083.930        | 0,19                         |
| 3.000.000   | CVC Cordatus Loan Fund VIII DAC Series 8X Class ER       | 8,59 %  | 15.07.2034            | 3.168.728        | 0,30                         |
| 1.000.000   | CVC Cordatus Loan Fund XI DAC Series 11X Class F         | 10,23 % | 15.10.2031            | 1.052.815        | 0,10                         |

## CLO Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag  | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|---|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 87,21 % (31. Dezember 2023: 86,02 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 1.850.000   | CVC Cordatus Loan Fund XIX DAC Series 19X Class E             | 8,65 %  | 23.12.2033            | 1.952.817        | 0,18                         |
| 2.590.000   | CVC Cordatus Loan Fund XV DAC Series 15X Class F              | 11,06 % | 26.08.2032            | 2.661.111        | 0,25                         |
| 2.000.000   | CVC Cordatus Loan Fund XVII DAC Series 17X Class ER           | 9,13 %  | 18.11.2033            | 2.117.022        | 0,20                         |
| 2.500.000   | CVC Cordatus Loan Fund XVIII DAC Series 18X Class ER          | 9,12 %  | 29.07.2034            | 2.654.212        | 0,25                         |
| 1.000.000   | CVC Cordatus Loan Fund XVIII DAC Series 18X Class FR          | 11,91 % | 29.07.2034            | 1.050.761        | 0,10                         |
| 1.000.000   | CVC Cordatus Loan Fund XX DAC Series 20X Class E              | 8,45 %  | 22.06.2034            | 1.060.488        | 0,10                         |
| 1.700.000   | CVC Cordatus Loan Fund XXIII DAC Series 23X Class ER          | 9,94 %  | 25.04.2036            | 1.800.943        | 0,17                         |
| 1.500.000   | CVC Cordatus Loan Fund XXIII DAC Series 23X Class F           | 12,45 % | 25.04.2036            | 1.560.719        | 0,15                         |
| 4.400.000   | CVC Cordatus Loan Fund XXIX DAC Series 29X Class E            | 10,63 % | 15.02.2037            | 4.632.382        | 0,43                         |
| 4.200.000   | CVC Cordatus Loan Fund XXVI DAC Series 26X Class ER           | 8,46 %  | 15.01.2038            | 4.351.274        | 0,41                         |
| 3.000.000   | CVC Cordatus Loan Fund XXVI DAC Series 26X Class FR           | 11,05 % | 15.01.2038            | 3.044.370        | 0,28                         |
| 1.400.000   | CVC Cordatus Loan Fund XXVII DAC Series 27X Class F           | 13,17 % | 15.04.2035            | 1.500.541        | 0,14                         |
| 3.000.000   | CVC Cordatus Loan Fund XXX DAC Series 30X Class F2            | 11,25 % | 15.05.2037            | 3.073.511        | 0,29                         |
| 3.000.000   | CVC Cordatus Loan Fund XXXI DAC Series 31X Class E            | 10,25 % | 15.06.2037            | 3.148.568        | 0,29                         |
| 1.000.000   | CVC Cordatus Loan Fund XXXI DAC Series 31X Class F1           | 11,78 % | 15.06.2037            | 1.050.150        | 0,10                         |
| 1.000.000   | CVC Cordatus Loan Fund XXXI DAC Series 31X Class F2           | 12,26 % | 15.06.2037            | 1.049.699        | 0,10                         |
| 3.000.000   | CVC Cordatus Loan Fund XXXII DAC Series 32X Class E           | 9,45 %  | 15.09.2038            | 3.186.884        | 0,30                         |
| 1.500.000   | CVC Cordatus Loan Fund XXXII DAC Series 32X Class F2          | 12,06 % | 15.09.2038            | 1.547.290        | 0,14                         |
| 3.400.000   | CVC Cordatus Loan Fund XXXIII DAC Series 33X Class E          | 8,67 %  | 24.03.2038            | 3.567.479        | 0,33                         |
| 1.150.000   | CVC Cordatus Loan Fund XXXIII DAC Series 33X Class F1         | 10,36 % | 24.03.2038            | 1.208.270        | 0,11                         |
| 1.250.000   | CVC Cordatus Loan Fund XXXIII DAC Series 33X Class F2         | 11,28 % | 24.03.2038            | 1.265.890        | 0,12                         |
| 3.000.000   | Deer Park CLO DAC Series 1X Class ER                          | 9,05 %  | 15.10.2034            | 3.194.905        | 0,30                         |
| 3.750.000   | Euro-Galaxy VI CLO DAC Series 2018-6X Class F                 | 9,12 %  | 11.04.2031            | 3.915.509        | 0,37                         |
| 2.008.000   | Euro-Galaxy VII CLO DAC Series 2019-7X Class DR               | 6,59 %  | 25.07.2035            | 2.099.627        | 0,20                         |
| 3.000.000   | Euro-Galaxy VII CLO DAC Series 2019-7X Class ER               | 9,29 %  | 25.07.2035            | 3.168.552        | 0,30                         |
| 1.850.000   | Fair Oaks Loan Funding I DAC Series 1X Class ER               | 8,88 %  | 15.04.2034            | 1.952.954        | 0,18                         |
| 1.080.000   | Fair Oaks Loan Funding II DAC Series 2X Class DR              | 5,84 %  | 15.04.2034            | 1.128.568        | 0,11                         |
| 5.485.739   | Fair Oaks Loan Funding III DAC Series 3X Class ER             | 8,90 %  | 15.10.2034            | 5.803.475        | 0,54                         |
| 1.500.000   | Fair Oaks Loan Funding V DAC Series 5X Class E                | 9,48 %  | 15.10.2036            | 1.583.788        | 0,15                         |
| 2.000.000   | Fernhill Park CLO DAC Series 1X Class E                       | 9,47 %  | 15.04.2037            | 2.112.586        | 0,20                         |
| 2.000.000   | Fernhill Park CLO DAC Series 1X Class F                       | 11,27 % | 15.04.2037            | 2.097.577        | 0,20                         |
| 1.500.000   | Fidelity Grand Harbour CLO 2019-1 DAC Series 2019-1X Class DR | 5,95 %  | 15.01.2038            | 1.554.027        | 0,14                         |
| 3.500.000   | Fidelity Grand Harbour CLO 2022-1 DAC Series 2022-1X Class ER | 9,63 %  | 15.04.2037            | 3.697.229        | 0,35                         |
| 2.200.000   | Fidelity Grand Harbour CLO 2023-2 DAC Series 2023-2X Class E  | 9,43 %  | 15.04.2038            | 2.303.137        | 0,21                         |
| 1.300.000   | Fidelity Grand Harbour CLO 2023-2 DAC Series 2023-2X Class F  | 11,03 % | 15.04.2038            | 1.359.304        | 0,13                         |
| 2.000.000   | Fidelity Grand Harbour CLO 2024-1 DAC Series 2024-1X Class D  | 6,67 %  | 15.04.2038            | 2.108.299        | 0,20                         |
| 2.350.000   | Fidelity Grand Harbour CLO 2024-1 DAC Series 2024-1X Class E  | 9,38 %  | 15.04.2038            | 2.494.226        | 0,23                         |
| 1.500.000   | Fidelity Grand Harbour CLO 2024-1 DAC Series 2024-1X Class F  | 11,56 % | 15.04.2038            | 1.599.213        | 0,15                         |
| 2.750.000   | GoldenTree Loan Management EUR CLO 4 DAC Series 4X Class ER   | 9,29 %  | 20.07.2034            | 2.902.343        | 0,27                         |
| 6.000.000   | GoldenTree Loan Management EUR CLO 5 DAC Series 5X Class E    | 8,47 %  | 20.04.2034            | 6.280.335        | 0,59                         |

## CLO Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag  | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|---|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 87,21 % (31. Dezember 2023: 86,02 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 1.250.000   | GoldenTree Loan Management EUR CLO 6 DAC Series 6X Class DR           | 6,52 %  | 20.07.2037            | 1.325.021        | 0,12                         |
| 2.500.000   | GoldenTree Loan Management EUR CLO 6 DAC Series 6X Class ER           | 9,49 %  | 20.07.2037            | 2.650.449        | 0,25                         |
| 3.000.000   | GoldenTree Loan Management EUR CLO 7 DAC Series 7X Class E            | 9,91 %  | 20.07.2037            | 3.143.353        | 0,29                         |
| 5.000.000   | GoldenTree Loan Management EUR CLO 7 DAC Series 7X Class F            | 10,97 % | 20.07.2037            | 5.264.520        | 0,49                         |
| 3.000.000   | GoldenTree Loan Management EUR CLO Series 8X Class D                  | 5,88 %  | 20.01.2039            | 3.108.053        | 0,29                         |
| 3.000.000   | GoldenTree Loan Management EUR CLO Series 8X Class E                  | 8,53 %  | 20.01.2039            | 3.108.053        | 0,29                         |
| 5.500.000   | Harvest CLO XXIV DAC Series 24X Class ER                              | 8,91 %  | 15.07.2034            | 5.786.682        | 0,54                         |
| 3.090.000   | Harvest CLO XXIX DAC Series 29X Class ER                              | 9,06 %  | 15.07.2037            | 3.292.313        | 0,31                         |
| 3.500.000   | Harvest CLO XXVIII DAC Series 28X Class ER                            | 10,04 % | 25.10.2034            | 3.719.533        | 0,35                         |
| 2.500.000   | Harvest CLO XXVIII DAC Series 28X Class F                             | 12,69 % | 25.10.2034            | 2.632.454        | 0,25                         |
| 3.250.000   | Harvest CLO XXXII DAC Series 32X Class E                              | 10,32 % | 25.07.2037            | 3.410.504        | 0,32                         |
| 1.850.000   | Harvest CLO XXXII DAC Series 32X Class F                              | 11,94 % | 25.07.2037            | 1.912.866        | 0,18                         |
| 4.600.000   | Harvest CLO XXXIII DAC Series 33X Class E                             | 9,24 %  | 15.10.2037            | 4.872.339        | 0,45                         |
| 1.900.000   | Harvest CLO XXXIII DAC Series 33X Class F                             | 11,62 % | 15.10.2037            | 1.930.319        | 0,18                         |
| 2.000.000   | Henley CLO IV DAC Series 4X Class E                                   | 8,34 %  | 25.04.2034            | 2.090.515        | 0,19                         |
| 2.200.000   | Henley CLO XII DAC Series 12X Class E                                 | 8,68 %  | 15.01.2038            | 2.308.072        | 0,22                         |
| 2.000.000   | Margay CLO I DAC Series 1X Class ER                                   | 8,79 %  | 15.01.2038            | 2.072.035        | 0,19                         |
| 3.000.000   | Margay CLO I DAC Series 1X Class FR                                   | 11,72 % | 15.01.2038            | 2.997.772        | 0,28                         |
| 2.250.000   | Margay CLO II DAC Series 2X Class E                                   | 9,28 %  | 15.07.2037            | 2.358.574        | 0,22                         |
| 2.000.000   | Margay CLO II DAC Series 2X Class F                                   | 11,25 % | 15.07.2037            | 2.068.325        | 0,19                         |
| 2.800.000   | OAK Hill European Credit Partners V DAC Series 2016-5X Class ER       | 9,59 %  | 21.01.2035            | 2.998.222        | 0,28                         |
| 3.095.000   | OAK Hill European Credit Partners VIII DAC Series 2021-8X Class F     | 11,34 % | 18.04.2035            | 3.210.339        | 0,30                         |
| 1.100.000   | OCP Euro 2017-1 DAC Series 2017-1X Class ER                           | 9,13 %  | 15.07.2032            | 1.161.496        | 0,11                         |
| 4.000.000   | OCP Euro CLO 2017-2 DAC Series 2017-2X Class ER                       | 9,90 %  | 15.04.2037            | 4.240.247        | 0,40                         |
| 2.774.000   | OCP Euro CLO 2019-3 DAC Series 2019-3X Class ER                       | 9,24 %  | 20.04.2033            | 2.931.378        | 0,27                         |
| 3.100.000   | OCP Euro CLO 2019-3 DAC Series 2019-3X Class FR                       | 11,81 % | 20.04.2033            | 3.263.189        | 0,30                         |
| 5.715.000   | OCP Euro CLO 2022-5 DAC Series 2022-5X Class E                        | 9,69 %  | 20.04.2035            | 6.052.297        | 0,56                         |
| 2.500.000   | OCP Euro CLO 2024-10 DAC Series 2024-10X Class D                      | 6,83 %  | 20.10.2037            | 2.638.695        | 0,25                         |
| 4.000.000   | OCP Euro CLO 2024-10 DAC Series 2024-10X Class E                      | 9,54 %  | 20.10.2037            | 4.280.181        | 0,40                         |
| 3.000.000   | OCP Euro CLO 2024-10 DAC Series 2024-10X Class F                      | 11,98 % | 20.10.2037            | 3.113.978        | 0,29                         |
| 4.000.000   | OCP Euro CLO 2024-11 DAC Series 2024-11X Class E                      | 8,78 %  | 18.10.2037            | 4.231.152        | 0,39                         |
| 2.250.000   | OCP Euro CLO 2024-11 DAC Series 2024-11X Class F                      | 11,29 % | 18.10.2037            | 2.308.520        | 0,22                         |
| 1.485.000   | Otranto Park CLO DAC Series 1X Class E                                | 10,07 % | 15.05.2035            | 1.542.762        | 0,14                         |
| 1.150.000   | Otranto Park CLO DAC Series 1X Class F                                | 12,07 % | 15.05.2035            | 1.200.192        | 0,11                         |
| 1.000.000   | Palmer Square European CLO 2022-1 DAC Series 2022-1X Class F          | 12,07 % | 21.01.2035            | 1.048.465        | 0,10                         |
| 1.500.000   | Palmer Square European CLO 2024-1 DAC Series 2024-1X Class D          | 6,77 %  | 15.05.2037            | 1.567.071        | 0,15                         |
| 3.250.000   | Palmer Square European CLO 2024-1 DAC Series 2024-1X Class E          | 9,70 %  | 15.05.2037            | 3.406.955        | 0,32                         |
| 3.000.000   | Palmer Square European CLO 2024-2 DAC Series 2024-2X Class D          | 6,75 %  | 15.10.2037            | 3.169.706        | 0,30                         |
| 4.000.000   | Palmer Square European CLO 2024-2 DAC Series 2024-2X Class E          | 9,46 %  | 15.10.2037            | 4.247.944        | 0,40                         |
| 2.800.000   | Palmer Square European Loan Funding 2024-3 DAC Series 2024-3X Class E | 8,49 %  | 15.05.2034            | 2.927.166        | 0,27                         |

## CLO Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag  | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|---|---|---------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 87,21 % (31. Dezember 2023: 86,02 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                    |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                    |                              |
| 2.400.000   | Providus CLO VII DAC Series 7X Class DR                       | 6,04 %  | 15.07.2038            | 2.523.785          | 0,24                         |
| 3.000.000   | Providus CLO VII DAC Series 7X Class ER                       | 9,21 %  | 15.07.2038            | 3.163.342          | 0,30                         |
| 1.250.000   | Providus CLO X DAC Series 10X Class E                         | 9,75 %  | 18.11.2038            | 1.311.312          | 0,12                         |
| 5.000.000   | Providus CLO XI DAC Series 11X Class E                        | 8,45 %  | 20.01.2038            | 5.180.089          | 0,48                         |
| 800.000   | Providus CLO XI DAC Series 11X Class F2                       | 11,40 % | 20.01.2038            | 803.548            | 0,07                         |
| 4.000.000   | RRE 11 Loan Management DAC Series 11X Class D                 | 9,39 %  | 31.03.2035            | 4.269.885          | 0,40                         |
| 4.000.000   | RRE 22 Loan Management DAC Series 22X Class D                 | 9,28 %  | 15.01.2038            | 4.240.285          | 0,40                         |
| 4.000.000   | RRE 5 Loan Management DAC Series 5X Class DR                  | 9,14 %  | 15.01.2037            | 4.246.469          | 0,40                         |
| 3.000.000   | Sound Point Euro CLO 12 Funding DAC Series 12X Class D        | 5,92 %  | 20.01.2039            | 3.142.953          | 0,29                         |
| 3.400.000   | Sound Point Euro CLO 12 Funding DAC Series 12X Class E        | 8,52 %  | 20.01.2039            | 3.568.645          | 0,33                         |
| 1.600.000   | Sound Point Euro CLO I Funding DAC Series 1X Class ER         | 8,71 %  | 25.05.2034            | 1.697.063          | 0,16                         |
| 1.000.000   | Sound Point Euro CLO II Funding DAC Series 2X Class ER        | 9,56 %  | 26.01.2036            | 1.064.656          | 0,10                         |
| 4.000.000   | Sound Point Euro CLO V Funding DAC Series 5X Class E          | 8,93 %  | 25.07.2035            | 4.251.148          | 0,40                         |
| 1.230.000   | Sound Point Euro CLO VII Funding DAC Series 7X Class D        | 6,29 %  | 25.01.2035            | 1.287.804          | 0,12                         |
| 1.050.000   | Sound Point Euro CLO XI Funding DAC Series 11X Class E        | 9,38 %  | 05.09.2037            | 1.119.051          | 0,10                         |
| 2.900.000   | Sutton Park CLO DAC Series 1X Class E                         | 9,95 %  | 15.11.2031            | 3.050.212          | 0,28                         |
| 2.800.000   | Texas Debt Capital Euro CLO 2024-1 DAC Series 2024-1X Class E | 9,33 %  | 16.07.2038            | 2.938.393          | 0,27                         |
| 3.800.000   | Trinitas Euro CLO II DAC Series 2X Class ERR                  | 9,43 %  | 20.10.2038            | 4.085.960          | 0,38                         |
| 1.000.000   | Trinitas Euro CLO II DAC Series 2X Class FRR                  | 11,67 % | 20.10.2038            | 1.023.213          | 0,10                         |
| 2.500.000   | Trinitas Euro CLO III DAC Series 3X Class ER                  | 9,34 %  | 20.07.2038            | 2.646.949          | 0,25                         |
| 2.200.000   | Trinitas Euro CLO III DAC Series 3X Class FR                  | 11,47 % | 20.07.2038            | 2.300.654          | 0,21                         |
| 3.250.000   | Trinitas Euro CLO IV DAC Series 4X Class ER                   | 9,17 %  | 15.11.2038            | 3.465.848          | 0,32                         |
| 1.700.000   | Trinitas Euro CLO IV DAC Series 4X Class FR                   | 11,42 % | 15.11.2038            | 1.752.488          | 0,16                         |
| 1.662.000   | Trinitas Euro CLO VII DAC Series 7X Class D                   | 7,40 %  | 25.07.2037            | 1.746.230          | 0,16                         |
| 6.000.000   | Trinitas Euro CLO VII DAC Series 7X Class E                   | 10,20 % | 25.07.2037            | 6.338.801          | 0,59                         |
| 2.750.000   | Trinitas Euro CLO VII DAC Series 7X Class F                   | 11,88 % | 25.07.2037            | 2.852.842          | 0,27                         |
| 3.800.000   | Trinitas Euro CLO VIII DAC Series 8X Class E                  | 8,28 %  | 15.01.2038            | 3.964.412          | 0,37                         |
| 1.200.000   | Trinitas Euro CLO VIII DAC Series 8X Class F                  | 11,05 % | 15.01.2038            | 1.223.961          | 0,11                         |
| 1.500.000   | Tymon Park CLO DAC Series 1X Class CRR                        | 6,42 %  | 21.07.2034            | 1.569.916          | 0,15                         |
| 1.650.000   | Vesey Park CLO DAC Series 1X Class E                          | 12,89 % | 16.11.2032            | 1.752.672          | 0,16                         |
| 1.800.000   | Voya Euro CLO I DAC Series 1X Class ER                        | 8,96 %  | 15.10.2037            | 1.907.030          | 0,18                         |
| 1.000.000   | Voya Euro CLO IV DAC Series 4X Class ER                       | 9,34 %  | 15.10.2034            | 1.059.138          | 0,10                         |
| 1.300.000   | Voya Euro CLO IV DAC Series 4X Class FR                       | 11,93 % | 15.10.2034            | 1.367.891          | 0,13                         |
| 3.600.000   | Voya Euro CLO V DAC Series 5X Class E                         | 8,60 %  | 15.04.2035            | 3.827.782          | 0,36                         |
| 6.000.000   | Waterstown Park CLO DAC Series 2024-1X Class E                | 8,41 %  | 25.01.2038            | 6.216.106          | 0,58                         |
| 3.000.000   | Waterstown Park CLO DAC Series 2024-1X Class F                | 11,06 % | 25.01.2038            | 3.059.902          | 0,29                         |
| <b>Euro insgesamt</b>   |   |         |                       | <b>513.677.981</b> | <b>47,96</b>                 |
| <b>US-Dollar</b>  |   |         |                       |                    |                              |
| 3.200.000   | 1988 CLO 5 Ltd Series 2024-5X Class D1                        | 7,60 %  | 15.07.2037            | 3.266.959          | 0,30                         |

## CLO Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag  | Wertpapierbezeichnung                                       | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|---|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 87,21 % (31. Dezember 2023: 86,02 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>  |   |         |                       |                  |                              |
| 5.100.000   | 1988 CLO 5 Ltd Series 2024-5X Class E                       | 10,60 % | 15.07.2037            | 5.256.090        | 0,49                         |
| 4.000.000   | 522 Funding CLO 2018-3A Ltd Series 2018-3X Class E          | 10,70 % | 20.10.2031            | 4.024.415        | 0,38                         |
| 2.000.000   | AB BSL CLO 1 Ltd Series 2020-1X Class ER                    | 11,16 % | 15.01.2035            | 2.023.691        | 0,19                         |
| 1.000.000   | AB BSL CLO 3 Ltd Series 2021-3A Class E                     | 11,83 % | 20.10.2034            | 1.010.479        | 0,09                         |
| 1.000.000   | AB BSL CLO 3 Ltd Series 2021-3X Class E                     | 11,50 % | 20.10.2034            | 1.010.479        | 0,09                         |
| 2.500.000   | AB BSL CLO 4 Ltd Series 2023-4X Class E                     | 12,45 % | 20.04.2036            | 2.562.302        | 0,24                         |
| 1.000.000   | AGL CLO 25 Ltd Series 2023-25X Class E                      | 12,95 % | 21.07.2036            | 1.037.442        | 0,10                         |
| 3.500.000   | AGL CLO 33 Ltd Series 2024-33X Class E                      | 10,71 % | 21.07.2037            | 3.582.605        | 0,33                         |
| 5.000.000   | AGL CLO 34 Ltd Series 2024-34X Class D1                     | 7,51 %  | 22.01.2038            | 5.103.747        | 0,48                         |
| 4.000.000   | AGL CLO 34 Ltd Series 2024-34X Class E                      | 9,86 %  | 22.01.2038            | 4.077.770        | 0,38                         |
| 3.000.000   | AGL CLO 35 Ltd Series 2024-35X Class D1                     | 7,36 %  | 21.01.2038            | 3.062.089        | 0,29                         |
| 4.000.000   | AGL CLO 35 Ltd Series 2024-35X Class E                      | 9,66 %  | 21.01.2038            | 4.070.276        | 0,38                         |
| 7.500.000   | AGL CLO 37 Ltd Series 2024-37X Class E                      | 9,29 %  | 22.04.2038            | 7.537.500        | 0,70                         |
| 1.250.000   | Aimco CLO 16 Ltd Series 2021-16X Class ER                   | 9,90 %  | 17.07.2037            | 1.272.263        | 0,12                         |
| 4.500.000   | Aimco CLO 18 Ltd Series 2022-18X Class D1R                  | 7,14 %  | 20.07.2037            | 4.592.422        | 0,43                         |
| 1.550.000   | Aimco CLO 19 Ltd Series 2024-19X Class D1                   | 7,41 %  | 20.10.2037            | 1.582.913        | 0,15                         |
| 1.500.000   | Aimco CLO Series 2017-A Series 2017-AX Class FR             | 13,09 % | 20.04.2034            | 1.502.417        | 0,14                         |
| 3.000.000   | Apidos CLO L Series 2024-50X Class D1                       | 7,31 %  | 20.01.2038            | 3.063.800        | 0,29                         |
| 2.000.000   | Apidos CLO L Series 2024-50X Class E                        | 9,61 %  | 20.01.2038            | 2.033.033        | 0,19                         |
| 5.000.000   | Apidos CLO LI Ltd Series 2024-51X Class E                   | 9,34 %  | 20.01.2038            | 5.025.000        | 0,47                         |
| 3.675.000   | Apidos CLO XLI Ltd Series 2022-41X Class ER                 | 9,94 %  | 20.10.2037            | 3.756.101        | 0,35                         |
| 3.000.000   | Apidos CLO XLIX Ltd Series 2024-49X Class E                 | 10,15 % | 24.10.2037            | 3.062.066        | 0,29                         |
| 4.000.000   | Apidos CLO XLVIII Ltd Series 2024-48X Class E               | 11,07 % | 25.07.2037            | 4.101.570        | 0,38                         |
| 2.000.000   | Ares XXXVII CLO Ltd Series 2015-4X Class DR                 | 10,71 % | 15.10.2030            | 2.017.537        | 0,19                         |
| 2.000.000   | Bain Capital Credit CLO 2022-6 Ltd Series 2022-6X Class D1R | 7,52 %  | 22.01.2038            | 2.049.128        | 0,19                         |
| 3.000.000   | Bain Capital Credit CLO 2022-6 Ltd Series 2022-6X Class ER  | 10,77 % | 22.01.2038            | 3.104.512        | 0,29                         |
| 1.000.000   | Bain Capital Credit CLO 2023-2 Ltd Series 2023-2X Class E   | 12,77 % | 18.07.2036            | 1.035.934        | 0,10                         |
| 1.500.000   | Bain Capital Credit CLO 2023-4 Ltd Series 2023-4X Class E   | 12,78 % | 21.10.2036            | 1.562.715        | 0,15                         |
| 1.000.000   | Bain Capital Credit CLO 2024-1 Ltd Series 2024-1X Class E   | 11,11 % | 16.04.2037            | 1.032.976        | 0,10                         |
| 4.000.000   | Bain Capital Credit CLO 2024-3 Ltd Series 2024-3X Class D1  | 7,51 %  | 16.07.2037            | 4.083.480        | 0,38                         |
| 2.000.000   | Bain Capital Credit CLO 2024-3 Ltd Series 2024-3X Class E   | 10,56 % | 16.07.2037            | 2.060.508        | 0,19                         |
| 6.150.000   | Bain Capital Credit CLO 2024-4 Ltd Series 2024-4X Class D1  | 7,97 %  | 23.10.2037            | 6.278.236        | 0,59                         |
| 5.000.000   | Bain Capital Credit CLO 2024-4 Ltd Series 2024-4X Class E   | 10,87 % | 23.10.2037            | 5.154.097        | 0,48                         |
| 2.000.000   | Bain Capital Credit CLO 2024-5 Ltd Series 2024-5X Class D1  | 7,71 %  | 21.10.2037            | 2.044.071        | 0,19                         |
| 1.250.000   | Bain Capital Credit CLO 2024-5 Ltd Series 2024-5X Class E   | 10,76 % | 21.10.2037            | 1.288.085        | 0,12                         |
| 4.000.000   | Bain Capital Credit CLO 2024-6 Ltd Series 2024-6X Class E   | 9,62 %  | 21.01.2038            | 4.026.380        | 0,38                         |
| 4.350.000   | Ballyrock CLO 14 Ltd Series 2020-14X Class DR               | 11,15 % | 20.07.2037            | 4.439.073        | 0,41                         |
| 2.825.000   | Ballyrock CLO 2018-1 Ltd Series 2018-1X Class D             | 10,35 % | 20.04.2031            | 2.844.007        | 0,27                         |
| 3.000.000   | Ballyrock CLO 21 Ltd Series 2022-21X Class DR               | 10,29 % | 20.10.2037            | 3.087.179        | 0,29                         |
| 4.000.000   | Ballyrock CLO 26 Ltd Series 2024-26X Class D                | 11,43 % | 25.07.2037            | 4.017.696        | 0,37                         |

## CLO Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag  | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|---|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 87,21 % (31. Dezember 2023: 86,02 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>  |   |         |                       |                  |                              |
| 2.000.000   | Ballyrock CLO 27 Ltd Series 2024-27X Class C1                     | 7,76 %  | 25.10.2037            | 2.041.388        | 0,19                         |
| 4.530.000   | Ballyrock CLO 28 Ltd Series 2024-28X Class D                      | 9,33 %  | 20.01.2038            | 4.618.818        | 0,43                         |
| 3.000.000   | Bayswater Park CLO Ltd Series 2023-1X Class E                     | 11,70 % | 20.01.2037            | 3.134.927        | 0,29                         |
| 2.250.000   | Benefit Street Partners CLO XVI Ltd Series 2018-16X Class D1R2    | 7,02 %  | 17.01.2038            | 2.258.438        | 0,21                         |
| 6.000.000   | Benefit Street Partners CLO XVI Ltd Series 2018-16X Class ER2     | 9,22 %  | 17.01.2038            | 6.030.000        | 0,56                         |
| 2.500.000   | Benefit Street Partners CLO XVII Ltd Series 2019-17X Class D1R2   | 7,45 %  | 15.10.2037            | 2.561.324        | 0,24                         |
| 4.000.000   | Benefit Street Partners CLO XVII Ltd Series 2019-17X Class ER2    | 10,45 % | 15.10.2037            | 4.062.425        | 0,38                         |
| 2.200.000   | Benefit Street Partners CLO XXXIII Ltd Series 2023-33X Class E    | 11,61 % | 25.01.2036            | 2.233.767        | 0,21                         |
| 2.500.000   | Canyon Capital CLO 2023-1 Ltd Series 2023-1X Class E              | 12,28 % | 15.10.2036            | 2.608.454        | 0,24                         |
| 4.875.000   | Canyon CLO 2023-2 Ltd Series 2023-2X Class E                      | 10,95 % | 15.05.2037            | 5.070.313        | 0,47                         |
| 4.000.000   | Canyon CLO 2024-2 Ltd Series 2024-2X Class D1                     | 7,43 %  | 15.01.2038            | 4.103.316        | 0,38                         |
| 1.250.000   | Canyon CLO 2024-2 Ltd Series 2024-2X Class E                      | 10,08 % | 15.01.2038            | 1.263.489        | 0,12                         |
| 3.500.000   | Captree Park CLO Ltd Series 2024-1X Class E                       | 10,29 % | 20.07.2037            | 3.592.027        | 0,34                         |
| 3.000.000   | Carlyle Global Market Strategies Series 2014-2RX Class D          | 10,14 % | 15.05.2031            | 3.000.305        | 0,28                         |
| 3.000.000   | Dryden 60 CLO Ltd Series 2018-60X Class E                         | 10,16 % | 15.07.2031            | 3.004.798        | 0,28                         |
| 1.250.000   | Eaton Vance CLO 2015-1 Ltd Series 2015-1X Class ER                | 10,15 % | 20.01.2030            | 1.241.360        | 0,12                         |
| 3.500.000   | Flatiron CLO 20 Ltd Series 2020-1X Class DR                       | 7,97 %  | 20.05.2036            | 3.534.152        | 0,33                         |
| 1.500.000   | Flatiron CLO 20 Ltd Series 2020-1X Class ER                       | 10,97 % | 20.05.2036            | 1.531.788        | 0,14                         |
| 3.000.000   | Flatiron CLO 25 Ltd Series 2024-2X Class E                        | 9,52 %  | 17.10.2037            | 3.054.456        | 0,28                         |
| 2.000.000   | Flatiron RR CLO 27 Ltd Series 2024-3X Class E                     | 9,65 %  | 18.10.2037            | 2.020.529        | 0,19                         |
| 1.905.000   | Galaxy XXVI CLO Ltd Series 2018-26X Class E                       | 10,63 % | 22.11.2031            | 1.915.299        | 0,18                         |
| 1.000.000   | GoldenTree Loan Management US CLO 10 Ltd Series 2021-10X Class DR | 7,72 %  | 20.10.2037            | 1.019.634        | 0,09                         |
| 2.900.000   | GoldenTree Loan Management US CLO 10 Ltd Series 2021-10X Class ER | 10,62 % | 20.10.2037            | 2.978.551        | 0,28                         |
| 5.500.000   | GoldenTree Loan Management US CLO 12 Ltd Series 2022-12X Class DR | 7,29 %  | 20.07.2037            | 5.610.529        | 0,52                         |
| 3.000.000   | GoldenTree Loan Management US CLO 18 Ltd Series 2023-18X Class E  | 11,87 % | 20.01.2037            | 3.125.047        | 0,29                         |
| 3.750.000   | GoldenTree Loan Management US CLO 20 Ltd Series 2024-20X Class E  | 10,19 % | 20.07.2037            | 3.835.808        | 0,36                         |
| 1.400.000   | GoldenTree Loan Management US CLO 21 Ltd Series 2024-21X Class D  | 7,34 %  | 20.07.2037            | 1.428.186        | 0,13                         |
| 2.000.000   | GoldenTree Loan Management US CLO 21 Ltd Series 2024-21X Class E  | 9,99 %  | 20.07.2037            | 2.038.482        | 0,19                         |
| 3.000.000   | GoldenTree Loan Management US CLO 21 Ltd Series 2024-21X Class F  | 12,12 % | 20.07.2037            | 3.016.087        | 0,28                         |
| 3.000.000   | GoldenTree Loan Management US CLO 22 Ltd Series 2024-22X Class E  | 9,86 %  | 20.10.2037            | 3.050.046        | 0,28                         |
| 5.000.000   | GoldenTree Loan Management US CLO 23 Ltd Series 2024-23X Class D  | 6,93 %  | 20.01.2039            | 5.019.700        | 0,47                         |
| 5.000.000   | GoldenTree Loan Management US CLO 23 Ltd Series 2024-23X Class E  | 9,33 %  | 20.01.2039            | 5.026.000        | 0,47                         |
| 1.400.000   | GoldenTree Loan Management US CLO 5 Ltd Series 2019-5X Class F    | 11,12 % | 20.10.2032            | 1.350.341        | 0,13                         |
| 3.000.000   | GoldenTree Loan Management US CLO 9 Ltd Series 2021-9X Class ER   | 10,59 % | 20.04.2037            | 3.083.728        | 0,29                         |
| 1.000.000   | GoldenTree Loan Management US CLO 9 Ltd Series 2021-9X Class FR   | 12,75 % | 20.04.2037            | 1.009.177        | 0,09                         |
| 3.000.000   | Hartwick Park CLO Ltd Series 2023-1X Class DR                     | 7,09 %  | 20.01.2037            | 3.011.820        | 0,28                         |
| 5.000.000   | Invesco US CLO 2024-1 Ltd Series 2024-1RX Class ER                | 11,70 % | 15.04.2037            | 5.124.117        | 0,48                         |
| 3.000.000   | Invesco US CLO 2024-2 Ltd Series 2024-2X Class E                  | 10,95 % | 15.07.2037            | 3.116.393        | 0,29                         |
| 4.000.000   | Invesco US CLO 2024-3 Ltd Series 2024-3X Class E                  | 10,79 % | 20.07.2037            | 4.135.701        | 0,39                         |
| 2.000.000   | Invesco US CLO 2024-4 Ltd Series 2024-4X Class E                  | 9,42 %  | 15.01.2038            | 2.010.400        | 0,19                         |

## CLO Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag  | Wertpapierbezeichnung                                  | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|---|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 87,21 % (31. Dezember 2023: 86,02 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>  |  |         |                       |                  |                              |
| 3.500.000   | Juniper Valley Park CLO Ltd Series 2023-1X Class ER    | 9,79 %  | 20.07.2036            | 3.548.195        | 0,33                         |
| 2.000.000   | Katayma CLO II Ltd Series 2024-2X Class E              | 11,62 % | 20.04.2037            | 2.079.544        | 0,19                         |
| 1.500.000   | MidOcean Credit CLO XIV Ltd Series 2024-14X Class E1   | 10,86 % | 15.04.2037            | 1.533.104        | 0,14                         |
| 2.000.000   | Midocean Credit CLO XV Ltd Series 2024-15X Class E     | 10,54 % | 21.07.2037            | 2.027.236        | 0,19                         |
| 4.000.000   | MidOcean Credit CLO XVI Series 2024-16X Class E        | 10,80 % | 20.10.2037            | 4.051.045        | 0,38                         |
| 2.000.000   | MidOcean Credit CLO XVII Ltd Series 2024-17X Class E   | 10,49 % | 20.01.2038            | 2.022.279        | 0,19                         |
| 4.000.000   | Oaktree CLO 2024-26 Ltd Series 2024-26X Class E        | 10,79 % | 20.04.2037            | 4.123.898        | 0,38                         |
| 3.000.000   | Oaktree CLO 2024-27 Ltd Series 2024-27X Class D1       | 7,78 %  | 22.10.2037            | 3.062.344        | 0,29                         |
| 1.950.000   | Oaktree CLO 2024-27 Ltd Series 2024-27X Class E        | 10,38 % | 22.10.2037            | 1.995.885        | 0,19                         |
| 3.000.000   | Oaktree CLO 2024-28 Ltd Series 2024-28X Class D1       | 7,13 %  | 15.01.2038            | 3.073.657        | 0,29                         |
| 6.000.000   | Oaktree CLO 2024-28 Ltd Series 2024-28X Class E        | 9,68 %  | 15.01.2038            | 6.065.461        | 0,57                         |
| 4.500.000   | Ocean Trails CLO XVI Ltd Series 2024-16X Class E       | 11,25 % | 20.01.2038            | 4.545.105        | 0,42                         |
| 4.000.000   | OCP CLO 2024-35 Ltd Series 2024-35X Class D1           | 7,66 %  | 25.10.2037            | 4.083.427        | 0,38                         |
| 1.000.000   | OCP CLO 2024-36 Ltd Series 2024-36X Class D1           | 7,51 %  | 16.10.2037            | 1.021.697        | 0,10                         |
| 4.875.000   | OCP CLO 2024-37 Ltd Series 2024-37X Class E            | 10,07 % | 15.10.2037            | 4.993.922        | 0,47                         |
| 2.500.000   | OCP CLO 2024-38 Ltd Series 2024-38X Class D1           | 7,15 %  | 21.01.2038            | 2.509.845        | 0,23                         |
| 6.000.000   | OCP CLO 2024-38 Ltd Series 2024-38X Class E            | 9,50 %  | 21.01.2038            | 6.031.188        | 0,56                         |
| 2.250.000   | OHA Credit Funding 18 Ltd Series 2024-18X Class E      | 10,69 % | 20.04.2037            | 2.316.191        | 0,22                         |
| 1.250.000   | OHA Credit Funding 19 Ltd Series 2024-19X Class E      | 9,89 %  | 20.07.2037            | 1.279.197        | 0,12                         |
| 3.000.000   | Onex CLO Subsidiary 2024-3 Ltd Series 2024-33X Class E | 10,29 % | 20.07.2037            | 3.076.543        | 0,29                         |
| 4.000.000   | Palmer Square CLO 2022-3 Ltd Series 2022-3X Class ER   | 10,79 % | 20.07.2037            | 4.153.920        | 0,39                         |
| 2.500.000   | Peebles Park CLO Ltd Series 2024-1X Class E            | 10,74 % | 21.04.2037            | 2.575.420        | 0,24                         |
| 2.000.000   | PPM CLO 7 Ltd Series 2024-7X Class D1A                 | 7,89 %  | 20.07.2037            | 2.048.537        | 0,19                         |
| 1.500.000   | RR 28 Ltd Series 2024-28RX Class DR                    | 11,30 % | 15.04.2037            | 1.544.938        | 0,14                         |
| 2.700.000   | RR 8 Ltd Series 2020-8X Class DR                       | 10,55 % | 15.07.2037            | 2.743.629        | 0,26                         |
| 2.425.000   | Sixth Street CLO 27 Ltd Series 2024-27X Class D1       | 7,16 %  | 17.01.2038            | 2.475.080        | 0,23                         |
| 6.000.000   | Sixth Street CLO 27 Ltd Series 2024-27X Class E        | 9,61 %  | 17.01.2038            | 6.117.532        | 0,57                         |
| 2.200.000   | Symphony CLO 35 Ltd Series 2022-35X Class ER           | 12,13 % | 24.10.2036            | 2.277.444        | 0,21                         |
| 3.000.000   | Symphony CLO 37 Ltd Series 2022-37X Class ER           | 12,24 % | 20.01.2037            | 3.140.972        | 0,29                         |
| 4.000.000   | Symphony CLO 38 Ltd Series 2023-38X Class E            | 10,63 % | 24.04.2036            | 4.065.732        | 0,38                         |
| 1.000.000   | Symphony CLO 39 Ltd Series 2023-39X Class D1R          | 7,30 %  | 25.01.2038            | 1.020.104        | 0,10                         |
| 6.000.000   | Symphony CLO 39 Ltd Series 2023-39X Class ER           | 10,05 % | 25.01.2038            | 6.158.276        | 0,57                         |
| 2.000.000   | Symphony CLO 40 Ltd Series 2023-40X Class ER           | 9,67 %  | 05.01.2038            | 2.010.406        | 0,19                         |
| 3.250.000   | Symphony CLO 41 Ltd Series 2024-41X Class E            | 10,09 % | 20.07.2037            | 3.335.814        | 0,31                         |
| 3.500.000   | Symphony CLO 43 Ltd Series 2024-43X Class E            | 11,05 % | 15.04.2037            | 3.642.759        | 0,34                         |
| 5.500.000   | Symphony CLO 45 Ltd Series 2024-45X Class E            | 10,62 % | 15.10.2037            | 5.644.801        | 0,53                         |
| 6.000.000   | Symphony CLO 46 Ltd Series 2024-46X Class E            | 10,09 % | 20.01.2038            | 6.173.281        | 0,58                         |
| 5.000.000   | Symphony CLO XXXIII Ltd Series 2022-33X Class D1R      | 6,88 %  | 24.01.2038            | 5.018.750        | 0,47                         |
| 3.000.000   | Trestles CLO 2017-1 Ltd Series 2017-1X Class FRR       | 12,38 % | 25.07.2037            | 2.943.352        | 0,27                         |
| 4.000.000   | Trestles CLO II Ltd Series 2018-2X Class ER            | 11,23 % | 25.07.2037            | 4.148.698        | 0,39                         |

## CLO Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag  | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$     | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|---|---|---------|-----------------------|----------------------|------------------------------|
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 87,21 % (31. Dezember 2023: 86,02 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                      |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>  |   |         |                       |                      |                              |
| 4.000.000   | Trestles CLO II Ltd Series 2018-2X Class FR                       | 12,03 % | 25.07.2037            | 3.912.546            | 0,37                         |
| 3.000.000   | Trestles CLO VII Ltd Series 2024-7X Class D1                      | 7,92 %  | 25.10.2037            | 3.060.724            | 0,29                         |
| 6.000.000   | Trestles CLO VII Ltd Series 2024-7X Class E                       | 10,42 % | 25.10.2037            | 6.135.074            | 0,57                         |
| 2.500.000   | Trestles CLO VII Ltd Series 2024-7X Class F                       | 12,65 % | 25.10.2037            | 2.477.937            | 0,23                         |
| 5.000.000   | Trinitas CLO XXXI Ltd Series 2024-31X Class D1                    | 7,38 %  | 22.01.2038            | 5.128.859            | 0,48                         |
| 2.000.000   | Voya CLO 2022-3 Ltd Series 2022-3X Class ER                       | 12,29 % | 20.10.2036            | 2.080.141            | 0,19                         |
| 3.000.000   | Voya CLO 2024-7 Ltd Series 2024-7X Class D1                       | 7,14 %  | 20.01.2038            | 3.011.823            | 0,28                         |
| 4.000.000   | Voya CLO 2024-7 Ltd Series 2024-7X Class E                        | 9,54 %  | 20.01.2038            | 4.020.804            | 0,38                         |
| 1.600.000   | Wellington Management CLO 1 Ltd Series 2023-1X Class E            | 11,95 % | 20.10.2036            | 1.658.426            | 0,15                         |
| 1.750.000   | Wellington Management CLO 2 Ltd Series 2024-2X Class E            | 11,19 % | 20.04.2037            | 1.828.130            | 0,17                         |
| 2.750.000   | Wellington Management CLO 3 Ltd Series 2024-3X Class E            | 9,58 %  | 18.07.2037            | 2.833.164            | 0,26                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>  |   |         |                       | <b>420.440.999</b>   | <b>39,25</b>                 |
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) insgesamt **</b>                                       |   |         |                       | <b>934.118.980</b>   | <b>87,21</b>                 |
| <b>Pensionsgeschäfte 7,89 % (31. Dezember 2023: 0,00 %)</b>   |   |         |                       |                      |                              |
| <b>US-Dollar</b>  |   |         |                       |                      |                              |
| 84.500.000  | State Street Bank and Trust Co, repurchase value US\$ 84,520,796^ | 4,43 %  | 02.01.2025            | 84.500.000           | 7,89                         |
| <b>Pensionsgeschäfte insgesamt †</b>  |   |         |                       | <b>84.500.000</b>    | <b>7,89</b>                  |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  |   |         |                       | <b>1.098.664.423</b> | <b>102,57</b>                |

^ Besichert über US-Schatz-/Staatsanleihen mit einem Wert von insgesamt USD 86.190.114.

### Devisenterminkontrakte 2,68 % (31. Dezember 2023: 1,26 %)

| Geforderter<br>Betrag  | Zu zahlender<br>Betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|------------------------|-----------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------------|------------------------------|
| 34.741.159 US\$  | 32.750.000 €           | 16.01.2025            | Citibank NA                    | 7         | 810.508                              | 0,08                         |
| 6.107.524 US\$   | 5.750.000 €            | 16.01.2025            | Goldman Sachs International    | 1         | 150.234                              | 0,01                         |
| 346.762.408 US\$   | 310.512.543 €          | 16.01.2025            | State Street Bank and Trust Co | 2         | 25.055.760                           | 2,34                         |
| 76.667.645 US\$  | 72.500.000 €           | 16.01.2025            | Westpac Banking Corp           | 9         | 1.553.990                            | 0,14                         |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>                                      |                        |                       |                                |           |                                      |                              |
| 7.323.572 US\$   | 6.835.320 €            | 16.01.2025            | Westpac Banking Corp           | 5         | 241.836                              | 0,02                         |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>                                      |                        |                       |                                |           |                                      |                              |
| 128 £  | 160 US\$               | 16.01.2025            | Westpac Banking Corp           | 1         | 0                                    | 0,00                         |
| 18.893.280 US\$  | 14.421.504 £           | 16.01.2025            | State Street Bank and Trust Co | 1         | 833.849                              | 0,08                         |
| <i>Abgesicherte Klassen JPY</i>                                      |                        |                       |                                |           |                                      |                              |
| 45.780.000 ¥   | 291.271 US\$           | 16.01.2025            | Westpac Banking Corp           | 1         | 483                                  | 0,00                         |
| 89.547 US\$  | 13.251.676 ¥           | 16.01.2025            | State Street Bank and Trust Co | 1         | 5.095                                | 0,00                         |
| 139.452 US\$   | 20.480.000 ¥           | 16.01.2025            | Westpac Banking Corp           | 1         | 8.934                                | 0,00                         |
| <i>Abgesicherte Klassen SEK</i>                                      |                        |                       |                                |           |                                      |                              |
| 579.442 US\$   | 5.967.481 SEK          | 16.01.2025            | Westpac Banking Corp           | 1         | 38.988                               | 0,01                         |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ∞</b> |                        |                       |                                |           | <b>28.699.677</b>                    | <b>2,68</b>                  |

## CLO Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

|  | Zeitwert<br>US\$     | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|----------------------|------------------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> | <b>1.127.364.100</b> | <b>105,25</b>                |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (0,75 %) (31. Dezember 2023: (1,38 %))

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettövermögens |
|--|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 1.244.022 €  | 1.393.286 US\$      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | (104.416)                       | (0,01)               |
| 84.927.448 €   | 93.585.301 US\$     | 16.01.2025       | UBS AG                         | 3         | (5.596.184)                     | (0,53)               |
| 16.321.903 €   | 17.863.164 US\$     | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 6         | (952.849)                       | (0,09)               |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>  |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 14.445.485 £   | 18.924.698 US\$     | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (835.235)                       | (0,08)               |
| 166 £  | 211 US\$            | 16.01.2025       | UBS AG                         | 1         | (3)                             | (0,00)               |
| 580 £  | 769 US\$            | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 2         | (44)                            | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen JPY</i>  |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 9.563.746 ¥  | 63.075 US\$         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 2         | (2.126)                         | (0,00)               |
| 799.153.371 ¥  | 5.460.241 US\$      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 2         | (367.263)                       | (0,03)               |
| 349.980.000 ¥  | 2.324.434 US\$      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 3         | (94.023)                        | (0,01)               |
| <i>Abgesicherte Klassen SEK</i>  |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 96.274 SEK   | 8.843 US\$          | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | (124)                           | (0,00)               |
| 118.643 SEK  | 11.773 US\$         | 16.01.2025       | UBS AG                         | 1         | (1.027)                         | (0,00)               |
| 22.541.755 SEK   | 2.188.550 US\$      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 2         | (147.022)                       | (0,01)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                                |           | <b>(8.100.316)</b>              | <b>(0,76)</b>        |

### Total Return Swap-Kontrakte (0,02 %) (31. Dezember 2023: (0,00 %))

| Nominalwert   | Datum der Schließung | Variabler Zinssatz | Referenzunternehmen                            | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettövermögens |               |
|---|----------------------|--------------------|--|---------------------------------|----------------------|---------------|
| USD 5.000.000   | 20.03.2025           | 4,27 <sup>1</sup>  | iBoxx USD Liquid High Yield Index <sup>2</sup> | (51.565)                        | (0,01)               |               |
| USD 14.000.000  | 20.03.2025           | 4,27 <sup>1</sup>  | iBoxx USD Liquid High Yield Index <sup>3</sup> | (142.724)                       | (0,01)               |               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Total Return Swap-Kontrakten <sup>∞</sup></b> |                      |                    |  |                                 | <b>(194.289)</b>     | <b>(0,02)</b> |

<sup>1</sup> Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist die USD Secured Overnight Financing Rate.

<sup>2</sup> Die Gegenpartei für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist Goldman Sachs International.

<sup>3</sup> Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist die JPMorgan Chase Bank.

|   | Zeitwert<br>US\$     | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|---|----------------------|------------------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(8.294.605)</b>   | <b>(0,78)</b>                |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>1.119.069.495</b> | <b>104,47</b>                |
| <b>Sonstige Nettverbindlichkeiten</b>   | <b>(47.931.990)</b>  | <b>(4,47)</b>                |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>1.071.137.505</b> | <b>100,00</b>                |

## CLO Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

| Portfolioanalyse   | US\$                 | % des<br>Gesamtver-<br>mögens |
|--|----------------------|-------------------------------|
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden | 1.014.164.423        | 87,48                         |
| † Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente   | 84.500.000           | 7,29                          |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente  | 20.405.072           | 1,76                          |
| <b>Anlagen insgesamt</b>   | <b>1.119.069.495</b> | <b>96,53</b>                  |

## Commodities - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                    | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Schatzwechsel 30,70 % (31. Dezember 2023: 28,60 %)</b>        |  |        |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |  |        |                       |                   |                              |
| 15.000.000   | United States Treasury Bill              | 0,00 % | 27.02.2025            | 14.901.825        | 9,61                         |
| 33.000.000   | United States Treasury Bill              | 0,00 % | 18.03.2025            | 32.714.168        | 21,09                        |
| <b>Schatzwechsel insgesamt **</b>                                |  |        |                       | <b>47.615.993</b> | <b>30,70</b>                 |
| <b>Unternehmensanleihen 54,97 % (31. Dezember 2023: 50,14 %)</b> |  |        |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |  |        |                       |                   |                              |
| 2.980.000  | American Express Co**                    | 5,19 % | 04.11.2026            | 2.982.358         | 1,92                         |
| 2.166.000  | Amgen Inc**                              | 5,25 % | 02.03.2025            | 2.167.343         | 1,40                         |
| 1.555.000  | AT&T Inc*                                | 1,70 % | 25.03.2026            | 1.499.887         | 0,97                         |
| 945.000  | Bank of America Corp**                   | 1,20 % | 24.10.2026            | 918.397           | 0,59                         |
| 1.872.000  | Bank of America Corp*                    | 4,00 % | 22.01.2025            | 1.871.122         | 1,21                         |
| 1.115.000  | Bank of New York Mellon Corp*            | 3,00 % | 24.02.2025            | 1.112.337         | 0,72                         |
| 1.505.000  | Bristol-Myers Squibb Co**                | 4,96 % | 20.02.2026            | 1.508.956         | 0,97                         |
| 1.545.000  | Broadcom Inc**                           | 3,15 % | 15.11.2025            | 1.525.457         | 0,98                         |
| 996.000  | Capital One Financial Corp*              | 3,20 % | 05.02.2025            | 995.806           | 0,64                         |
| 1.080.000  | Capital One Financial Corp**             | 4,99 % | 24.07.2026            | 1.079.464         | 0,70                         |
| 3.070.000  | Caterpillar Financial Services Corp**    | 5,01 % | 14.05.2027            | 3.073.195         | 1,98                         |
| 2.820.000  | Citibank NA**                            | 5,19 % | 19.11.2027            | 2.825.858         | 1,82                         |
| 1.590.000  | Comcast Corp**                           | 3,38 % | 15.08.2025            | 1.576.803         | 1,02                         |
| 590.000  | Comcast Corp**                           | 3,95 % | 15.10.2025            | 587.166           | 0,38                         |
| 710.000  | Consolidated Edison Co of New York Inc** | 5,00 % | 18.11.2027            | 714.379           | 0,46                         |
| 1.260.000  | Corebridge Global Funding**              | 5,70 % | 25.09.2026            | 1.272.936         | 0,82                         |
| 1.200.000  | CVS Health Corp*                         | 3,88 % | 20.07.2025            | 1.192.657         | 0,77                         |
| 335.000  | Enbridge Energy Partners LP*             | 5,88 % | 15.10.2025            | 336.838           | 0,22                         |
| 1.620.000  | General Electric Co**                    | 5,20 % | 05.05.2026            | 1.623.185         | 1,05                         |
| 1.875.000  | Georgia Power Co**                       | 5,26 % | 08.05.2025            | 1.879.131         | 1,21                         |
| 2.095.000  | Goldman Sachs Bank USA**                 | 5,22 % | 21.05.2027            | 2.100.450         | 1,35                         |
| 2.645.000  | Home Depot Inc**                         | 4,73 % | 24.12.2025            | 2.650.659         | 1,71                         |
| 1.735.000  | Intel Corp**                             | 3,40 % | 25.03.2025            | 1.729.190         | 1,11                         |
| 2.820.000  | John Deere Capital Corp**                | 4,89 % | 06.03.2026            | 2.823.748         | 1,82                         |
| 2.055.000  | JPMorgan Chase & Co**                    | 5,16 % | 22.09.2027            | 2.065.946         | 1,33                         |
| 2.065.000  | Lowe's Cos Inc*                          | 4,00 % | 15.04.2025            | 2.061.018         | 1,33                         |
| 1.175.000  | Marsh & McLennan Cos Inc**               | 5,21 % | 08.11.2027            | 1.184.477         | 0,76                         |
| 2.815.000  | Morgan Stanley**                         | 5,43 % | 18.02.2026            | 2.818.176         | 1,82                         |
| 1.315.000  | New York Life Global Funding**           | 5,03 % | 28.08.2026            | 1.320.342         | 0,85                         |
| 1.220.000  | Nordea Bank Abp**                        | 5,14 % | 19.03.2027            | 1.226.504         | 0,79                         |
| 1.780.000  | Oracle Corp*                             | 2,50 % | 01.04.2025            | 1.769.956         | 1,14                         |
| 750.000  | PepsiCo Inc**                            | 4,89 % | 13.02.2026            | 751.773           | 0,48                         |
| 1.900.000  | Pepsico Singapore Financing I Pte Ltd**  | 5,04 % | 16.02.2027            | 1.907.604         | 1,23                         |

## Commodities - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                              | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|--------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 54,97 % (31. Dezember 2023: 50,14 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |        |                       |                    |                              |
| 2.165.000  | Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd <sup>†</sup> | 4,65 % | 19.05.2025            | 2.166.236          | 1,40                         |
| 1.779.000  | PNC Bank NA <sup>*</sup>                           | 2,95 % | 23.02.2025            | 1.774.358          | 1,14                         |
| 605.000  | PNC Bank NA <sup>**</sup>                          | 4,87 % | 15.01.2027            | 605.344            | 0,39                         |
| 2.000.000  | Protective Life Global Funding <sup>**</sup>       | 5,38 % | 28.03.2025            | 2.003.886          | 1,29                         |
| 1.729.000  | Royal Bank of Canada <sup>**</sup>                 | 5,05 % | 21.01.2025            | 1.729.202          | 1,12                         |
| 1.289.000  | RTX Corp <sup>*</sup>                              | 3,95 % | 16.08.2025            | 1.283.363          | 0,83                         |
| 2.895.000  | Simon Property Group LP <sup>*</sup>               | 3,50 % | 01.09.2025            | 2.875.394          | 1,85                         |
| 2.005.000  | Spectra Energy Partners LP <sup>*</sup>            | 3,50 % | 15.03.2025            | 1.998.599          | 1,29                         |
| 1.490.000  | State Street Corp <sup>**</sup>                    | 5,17 % | 22.10.2027            | 1.493.996          | 0,96                         |
| 380.000  | State Street Corp <sup>**</sup>                    | 5,38 % | 03.08.2026            | 382.846            | 0,25                         |
| 1.460.000  | T-Mobile USA Inc <sup>*</sup>                      | 3,50 % | 15.04.2025            | 1.453.617          | 0,94                         |
| 530.000  | Toyota Motor Credit Corp <sup>**</sup>             | 5,10 % | 10.04.2026            | 530.366            | 0,34                         |
| 1.550.000  | Toyota Motor Credit Corp <sup>**</sup>             | 5,28 % | 07.08.2026            | 1.560.365          | 1,01                         |
| 1.360.000  | Truist Financial Corp <sup>*</sup>                 | 1,20 % | 05.08.2025            | 1.332.985          | 0,86                         |
| 690.000  | UBS Group AG <sup>**</sup>                         | 1,31 % | 02.02.2027            | 663.345            | 0,43                         |
| 1.505.000  | UBS Group AG <sup>**</sup>                         | 2,19 % | 05.06.2026            | 1.487.339          | 0,96                         |
| 1.897.000  | UnitedHealth Group Inc <sup>**</sup>               | 5,14 % | 15.07.2026            | 1.903.609          | 1,23                         |
| 2.070.000  | US Bank NA <sup>**</sup>                           | 5,30 % | 22.10.2027            | 2.069.970          | 1,33                         |
| 2.765.000  | Wells Fargo Bank NA <sup>**</sup>                  | 5,49 % | 11.12.2026            | 2.796.398          | 1,80                         |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>85.264.336</b>  | <b>54,97</b>                 |
| <b>Anlagen insgesamt</b>   |  |        |                       | <b>132.880.329</b> | <b>85,67</b>                 |

Devisenterminkontrakte 0,21 % (31. Dezember 2023: 1,02 %)

| Geforderter<br>Betrag  | Zu zahlender<br>Betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens          |
|--|------------------------|-----------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------------|---------------------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>  |                        |                       |                                |           |                                      |                                       |
| 6.117 £  | 7.656 US\$             | 16.01.2025            | Westpac Banking Corp           | 1         | 4                                    | 0,00                                  |
| 1.057.332 US\$   | 820.946 £              | 16.01.2025            | Standard Chartered Bank        | 4         | 29.296                               | 0,02                                  |
| 2.735.598 US\$   | 2.119.249 £            | 16.01.2025            | State Street Bank and Trust Co | 7         | 81.753                               | 0,05                                  |
| 6.327.338 US\$   | 4.878.492 £            | 16.01.2025            | Westpac Banking Corp           | 43        | 218.212                              | 0,14                                  |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>                        |                        |                       |                                |           | <b>329.265</b>                       | <b>0,21</b>                           |
|  |                        |                       |                                |           | <b>Zeitwert<br/>US\$</b>             | <b>% des<br/>Nettöver-<br/>mögens</b> |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |                        |                       |                                |           | <b>133.209.594</b>                   | <b>85,88</b>                          |

## Commodities - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (1,04 %) (31. Dezember 2023: (0,14 %))

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens         |
|---|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|------------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>   |                     |                  |                                |           |                                 |                              |
| 141.319 £   | 184.781 US\$        | 16.01.2025       | Standard Chartered Bank        | 1         | (7.813)                         | (0,01)                       |
| 26.911.258 £  | 35.212.075 US\$     | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 9         | (1.512.260)                     | (0,97)                       |
| 2.792.646 £   | 3.594.318 US\$      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 72        | (97.211)                        | (0,06)                       |
| 21.941 US\$   | 17.540 £            | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 1         | (23)                            | (0,00)                       |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>                          |                     |                  |                                |           | <b>(1.617.307)</b>              | <b>(1,04)</b>                |
|   |                     |                  |                                |           | <b>Zeitwert US\$</b>            | <b>% des Nettovermögens</b>  |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> |                     |                  |                                |           | <b>(1.617.307)</b>              | <b>(1,04)</b>                |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              |                     |                  |                                |           | <b>131.592.287</b>              | <b>84,84</b>                 |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  |                     |                  |                                |           | <b>23.516.303</b>               | <b>15,16</b>                 |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   |                     |                  |                                |           | <b>155.108.590</b>              | <b>100,00</b>                |
| <b>Portfolioanalyse</b>   |                     |                  |                                |           | <b>US\$</b>                     | <b>% des Gesamtvermögens</b> |
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind   |                     |                  |                                |           | 23.724.173                      | 15,02                        |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden              |                     |                  |                                |           | 109.156.156                     | 69,12                        |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente   |                     |                  |                                |           | (1.288.042)                     | (0,82)                       |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  |                     |                  |                                |           | <b>131.592.287</b>              | <b>83,32</b>                 |

## Corporate Hybrid Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                  | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|-----------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 92,52 % (31. Dezember 2023: 93,25 %)</b> |  |        |                       |                 |                              |
| <b>Euro</b>  |  |        |                       |                 |                              |
| 15.000.000   | Abertis Infraestructuras Finance BV*   | 4,87 % | 31.12.2149            | 15.385.256      | 0,66                         |
| 200.000  | Alliander NV*                          | 1,63 % | 31.12.2149            | 198.135         | 0,01                         |
| 42.000.000   | APA Infrastructure Ltd*                | 7,13 % | 09.11.2083            | 46.308.413      | 1,98                         |
| 5.700.000  | Arkema SA*                             | 1,50 % | 31.12.2149            | 5.548.914       | 0,24                         |
| 36.900.000   | Arkema SA*                             | 4,80 % | 31.12.2149            | 38.070.284      | 1,62                         |
| 48.104.000   | AusNet Services Holdings Pty Ltd*      | 1,63 % | 11.03.2081            | 46.467.502      | 1,98                         |
| 5.000.000  | Bayer AG*                              | 3,13 % | 12.11.2079            | 4.721.794       | 0,20                         |
| 2.000.000  | Bayer AG*                              | 6,63 % | 25.09.2083            | 2.075.602       | 0,09                         |
| 21.169.000   | BP Capital Markets Plc*                | 3,25 % | 31.12.2149            | 21.089.299      | 0,90                         |
| 54.080.000   | BP Capital Markets Plc*                | 3,63 % | 31.12.2149            | 53.304.763      | 2,27                         |
| 25.000.000   | British Telecommunications Plc*        | 5,13 % | 03.10.2054            | 25.949.844      | 1,11                         |
| 16.000.000   | EDP SA*                                | 4,63 % | 16.09.2054            | 16.313.760      | 0,70                         |
| 700.000  | EDP SA*                                | 4,75 % | 29.05.2054            | 717.150         | 0,03                         |
| 3.000.000  | Electricite de France SA*              | 2,63 % | 31.12.2149            | 2.844.679       | 0,12                         |
| 3.000.000  | Electricite de France SA*              | 5,63 % | 31.12.2149            | 3.107.160       | 0,13                         |
| 15.000.000   | Electricite de France SA*              | 7,50 % | 31.12.2149            | 16.583.104      | 0,71                         |
| 59.500.000   | Elia Group SA*                         | 5,85 % | 31.12.2149            | 62.528.401      | 2,67                         |
| 6.500.000  | ELM BV for Firmenich International SA* | 3,75 % | 31.12.2149            | 6.501.462       | 0,28                         |
| 53.500.000   | EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG*    | 5,25 % | 23.01.2084            | 56.417.649      | 2,41                         |
| 15.000.000   | Enel SpA*                              | 4,75 % | 31.12.2149            | 15.385.987      | 0,66                         |
| 26.600.000   | Enel SpA*                              | 6,38 % | 31.12.2149            | 28.586.947      | 1,22                         |
| 43.500.000   | Engie SA*                              | 5,13 % | 31.12.2149            | 45.543.619      | 1,94                         |
| 100.000  | Eni SpA*                               | 3,38 % | 31.12.2149            | 97.138          | 0,00                         |
| 16.215.000   | Fastighets AB Balder*                  | 2,87 % | 02.06.2081            | 15.814.956      | 0,67                         |
| 3.000.000  | Grand City Properties SA*              | 1,50 % | 31.12.2149            | 2.874.089       | 0,12                         |
| 43.371.000   | Heimstaden Bostad AB*                  | 2,63 % | 31.12.2149            | 40.289.003      | 1,72                         |
| 3.000.000  | Heimstaden Bostad AB*                  | 3,00 % | 31.12.2149            | 2.755.391       | 0,12                         |
| 8.714.000  | Heimstaden Bostad AB*                  | 3,38 % | 31.12.2149            | 8.482.306       | 0,36                         |
| 18.000.000   | Heimstaden Bostad AB*                  | 3,63 % | 31.12.2149            | 17.231.171      | 0,74                         |
| 36.100.000   | Heimstaden Bostad AB*                  | 6,25 % | 31.12.2149            | 36.422.373      | 1,55                         |
| 10.500.000   | Iberdrola Finanzas SA*                 | 4,25 % | 31.12.2149            | 10.653.860      | 0,45                         |
| 42.300.000   | Iberdrola Finanzas SA*                 | 4,87 % | 31.12.2149            | 44.291.960      | 1,89                         |
| 20.500.000   | Iberdrola Finanzas SA*                 | 4,88 % | 31.12.2149            | 21.195.462      | 0,90                         |
| 100.000  | Infineon Technologies AG*              | 3,63 % | 31.12.2149            | 99.427          | 0,00                         |
| 300.000  | Koninklijke KPN NV*                    | 4,88 % | 31.12.2149            | 311.858         | 0,01                         |
| 300.000  | Merck KGaA*                            | 3,88 % | 27.08.2054            | 302.691         | 0,01                         |
| 12.100.000   | Orange SA*                             | 4,50 % | 31.12.2149            | 12.422.768      | 0,53                         |
| 29.000.000   | Orange SA*                             | 5,38 % | 31.12.2149            | 30.902.763      | 1,32                         |
| 28.000.000   | Orsted AS*                             | 5,13 % | 14.03.3024            | 29.102.850      | 1,24                         |

## Corporate Hybrid Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR      | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--------------------------------------|--------|-----------------------|----------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 92,52 % (31. Dezember 2023: 93,25 %) (Fortsetzung)</b> |                                      |        |                       |                      |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |                                      |        |                       |                      |                              |
| 21.337.000   | Orsted AS*                           | 5,25 % | 08.12.2022            | 22.138.471           | 0,94                         |
| 65.000.000   | Proximus SADP*                       | 4,75 % | 31.12.2149            | 64.878.125           | 2,77                         |
| 100.000  | Redeia Corp SA*                      | 4,63 % | 31.12.2149            | 102.938              | 0,00                         |
| 25.000.000   | Repsol International Finance BV*     | 3,75 % | 31.12.2149            | 25.033.875           | 1,07                         |
| 5.000.000  | Repsol International Finance BV*     | 4,25 % | 31.12.2149            | 5.085.466            | 0,22                         |
| 7.000.000  | Roquette Freres SA*                  | 5,49 % | 31.12.2149            | 7.147.455            | 0,30                         |
| 8.000.000  | SES SA*                              | 5,50 % | 12.09.2054            | 7.360.864            | 0,31                         |
| 12.000.000   | SES SA*                              | 6,00 % | 12.09.2054            | 10.960.962           | 0,47                         |
| 200.000  | Snam SpA*                            | 4,50 % | 31.12.2149            | 204.495              | 0,01                         |
| 104.973.000  | Southern Co*                         | 1,88 % | 15.09.2081            | 98.665.435           | 4,21                         |
| 19.358.000   | SSE Plc*                             | 3,13 % | 31.12.2149            | 19.111.863           | 0,82                         |
| 41.405.000   | SSE Plc*                             | 4,00 % | 31.12.2149            | 41.646.750           | 1,78                         |
| 14.875.000   | Stedin Holding NV*                   | 1,50 % | 31.12.2149            | 14.249.010           | 0,61                         |
| 5.000.000  | Telefonica Europe BV*                | 5,75 % | 31.12.2149            | 5.358.660            | 0,23                         |
| 15.000.000   | Telefonica Europe BV*                | 7,13 % | 31.12.2149            | 16.555.875           | 0,71                         |
| 100.000  | Telia Co AB*                         | 1,38 % | 11.05.2081            | 97.287               | 0,00                         |
| 37.000.000   | TenneT Holding BV*                   | 4,63 % | 31.12.2149            | 37.860.602           | 1,62                         |
| 29.000.000   | TenneT Holding BV*                   | 4,88 % | 31.12.2149            | 30.143.615           | 1,29                         |
| 100.000  | Terna - Rete Elettrica Nazionale*    | 2,38 % | 31.12.2149            | 96.125               | 0,00                         |
| 22.400.000   | TotalEnergies SE*                    | 4,12 % | 31.12.2149            | 22.668.856           | 0,97                         |
| 59.000.000   | Unibail-Rodamco-Westfield SE*        | 7,25 % | 31.12.2149            | 64.587.005           | 2,76                         |
| 33.800.000   | Veolia Environnement SA*             | 2,25 % | 31.12.2149            | 33.178.376           | 1,42                         |
| 30.100.000   | Veolia Environnement SA*             | 5,99 % | 31.12.2149            | 32.239.192           | 1,38                         |
| 38.000.000   | Vodafone Group Plc*                  | 6,50 % | 30.08.2084            | 41.833.820           | 1,79                         |
| 20.000.000   | Volkswagen International Finance NV* | 3,88 % | 31.12.2149            | 19.535.600           | 0,83                         |
| 83.700.000   | Volkswagen International Finance NV* | 7,50 % | 31.12.2149            | 90.157.130           | 3,85                         |
| 5.000.000  | Volkswagen International Finance NV* | 7,88 % | 31.12.2149            | 5.584.375            | 0,24                         |
| <b>Euro insgesamt</b>  |                                      |        |                       | <b>1.503.382.017</b> | <b>64,16</b>                 |
| <b>Britisches Pfund</b>  |                                      |        |                       |                      |                              |
| 23.993.000   | BP Capital Markets Plc*              | 4,25 % | 31.12.2149            | 28.019.702           | 1,20                         |
| 46.600.000   | British Telecommunications Plc*      | 8,38 % | 20.12.2083            | 60.315.099           | 2,57                         |
| 55.700.000   | Centrica Plc*                        | 6,50 % | 21.05.2055            | 68.388.598           | 2,92                         |
| 63.600.000   | Electricite de France SA*            | 6,00 % | 31.12.2149            | 76.777.681           | 3,28                         |
| 22.700.000   | Electricite de France SA*            | 7,38 % | 31.12.2149            | 27.953.961           | 1,19                         |
| 66.587.000   | NGG Finance Plc*                     | 5,63 % | 18.06.2073            | 80.454.043           | 3,43                         |
| 10.000.000   | Orsted AS*                           | 2,50 % | 18.02.2021            | 8.935.444            | 0,38                         |
| 10.000.000   | Vattenfall AB*                       | 2,50 % | 29.06.2083            | 10.791.956           | 0,46                         |
| 32.500.000   | Vattenfall AB*                       | 6,88 % | 17.08.2083            | 40.356.240           | 1,72                         |
| <b>Britisches Pfund insgesamt</b>  |                                      |        |                       | <b>401.992.724</b>   | <b>17,15</b>                 |

## Corporate Hybrid Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR      | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|--------|-----------------------|----------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 92,52 % (31. Dezember 2023: 93,25 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                      |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |   |        |                       |                      |                              |
| 18.750.000   | British Telecommunications Plc <sup>*</sup>                                   | 4,25 % | 23.11.2081            | 17.582.678           | 0,75                         |
| 13.400.000   | CenterPoint Energy Inc <sup>**</sup>  | 6,70 % | 15.05.2055            | 12.901.339           | 0,55                         |
| 8.000.000  | CVS Health Corp <sup>**</sup>   | 6,75 % | 10.12.2054            | 7.594.693            | 0,32                         |
| 20.000.000   | CVS Health Corp <sup>**</sup>   | 7,00 % | 10.03.2055            | 19.427.432           | 0,83                         |
| 64.090.000   | Enbridge Inc <sup>**</sup>  | 5,50 % | 15.07.2077            | 59.433.965           | 2,54                         |
| 7.000.000  | Enbridge Inc <sup>**</sup>  | 6,00 % | 15.01.2077            | 6.706.905            | 0,29                         |
| 20.000.000   | Enbridge Inc <sup>**</sup>  | 7,38 % | 15.01.2083            | 19.527.146           | 0,83                         |
| 20.000.000   | Enbridge Inc <sup>**</sup>  | 8,25 % | 15.01.2084            | 20.244.075           | 0,86                         |
| 7.500.000  | NextEra Energy Capital Holdings Inc <sup>**</sup>                             | 6,64 % | 01.10.2066            | 7.196.079            | 0,31                         |
| 4.000.000  | NextEra Energy Capital Holdings Inc <sup>**</sup>                             | 6,70 % | 01.09.2054            | 3.941.260            | 0,17                         |
| 2.000.000  | NextEra Energy Capital Holdings Inc <sup>**</sup>                             | 6,75 % | 15.06.2067            | 1.909.103            | 0,08                         |
| 23.749.000   | PPL Capital Funding Inc <sup>*</sup>  | 7,25 % | 30.03.2067            | 22.974.259           | 0,98                         |
| 9.455.000  | Rogers Communications Inc <sup>**</sup>                                       | 5,25 % | 15.03.2082            | 8.885.404            | 0,38                         |
| 25.000.000   | Sempra <sup>**</sup>  | 6,40 % | 01.10.2054            | 23.998.692           | 1,03                         |
| 29.000.000   | Transcanada Trust <sup>**</sup>   | 5,88 % | 15.08.2076            | 27.702.581           | 1,18                         |
| 3.500.000  | Vodafone Group Plc <sup>**</sup>  | 5,13 % | 04.06.2081            | 2.584.971            | 0,11                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |   |        |                       | <b>262.610.582</b>   | <b>11,21</b>                 |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>  |   |        |                       | <b>2.167.985.323</b> | <b>92,52</b>                 |
| <b>Pensionsgeschäfte 0,60 % (31. Dezember 2023: 0,00 %)</b>                    |   |        |                       |                      |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |   |        |                       |                      |                              |
| 14.500.000   | State Street Bank and Trust Co, repurchase value US\$ 14,503,569 <sup>^</sup> | 4,43 % | 02.01.2025            | 14.002.897           | 0,60                         |
| <b>Pensionsgeschäfte insgesamt<sup>†</sup></b>                                 |   |        |                       | <b>14.002.897</b>    | <b>0,60</b>                  |

<sup>^</sup> Besichert über US-Schatz-/Staatsanleihen mit einem Wert von insgesamt USD 14.790.076.

| Anzahl der<br>Anteile                                     | Wertpapierbezeichnung                                | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|---|--|------------------|------------------------------|
| <b>Investmentfonds 0,52 % (31. Dezember 2023: 0,59 %)</b> |  |                  |                              |
| <b>US-Dollar</b>  |  |                  |                              |
| 1.300.000   | Neuberger Berman Global Investment Grade Credit Fund | 12.265.572       | 0,52                         |
| <b>Investmentfonds insgesamt<sup>‡</sup></b>              |  |                  | <b>12.265.572</b>            |
| <b>Anlagen insgesamt</b>                                  |  |                  | <b>2.194.253.792</b>         |

**Devisenterminkontrakte 0,82 % (31. Dezember 2023: 0,64 %)**

| Geforderter<br>Betrag           | Zu zahlender<br>Betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn EUR | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|---------------------------------|------------------------|-----------------------|-----------------------------|-----------|-------------------------------------|------------------------------|
| 24.372.260 €                    | 29.143.041 €           | 16.01.2025            | Westpac Banking Corp        | 2         | 315.288                             | 0,01                         |
| 2.958.645 US\$                  | 2.719.253 €            | 16.01.2025            | Westpac Banking Corp        | 1         | 136.441                             | 0,01                         |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> |                        |                       |                             |           |                                     |                              |
| 29.948 €                        | 48.948 AUD             | 16.01.2025            | Goldman Sachs International | 1         | 696                                 | 0,00                         |

## Corporate Hybrid Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 0,82 % (31. Dezember 2023: 0,64 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn EUR | % des Nettovermögens        |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|-------------------------------|-----------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen AUD (Fortsetzung)</i>  |                     |                  |                             |           |                               |                             |
| 27.361 €   | 43.934 AUD          | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | 1.105                         | 0,00                        |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i>  |                     |                  |                             |           |                               |                             |
| 26.245 CHF   | 27.969 €            | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 2         | 25                            | 0,00                        |
| 340.216 €  | 317.953 CHF         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | 1.072                         | 0,00                        |
| 5.143.642 €  | 4.806.064 CHF       | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | 17.266                        | 0,00                        |
| 1.060.402 €  | 988.046 CHF         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 29        | 6.505                         | 0,00                        |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>  |                     |                  |                             |           |                               |                             |
| 45.907 €   | 37.919 £            | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 4         | 75                            | 0,00                        |
| 1.115.958 £  | 1.336.794 €         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 2         | 12.045                        | 0,00                        |
| 21.820.633 £   | 25.950.604 €        | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 40        | 423.620                       | 0,02                        |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>  |                     |                  |                             |           |                               |                             |
| 717.549 €  | 1.007.668 SGD       | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 2         | 4.199                         | 0,00                        |
| 7.923.650 SGD  | 5.539.502 €         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 23        | 69.828                        | 0,00                        |
| <i>Abgesicherte Klassen USD</i>  |                     |                  |                             |           |                               |                             |
| 271.297.872 US\$   | 246.160.698 €       | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 2         | 15.696.945                    | 0,67                        |
| 67.658.616 US\$  | 62.756.138 €        | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 64        | 2.548.193                     | 0,11                        |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>sm</sup></b>                       |                     |                  |                             |           | <b>19.233.303</b>             | <b>0,82</b>                 |
|  |                     |                  |                             |           | <b>Zeitwert EUR</b>           | <b>% des Nettovermögens</b> |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |                     |                  |                             |           | <b>2.213.487.095</b>          | <b>94,46</b>                |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (1,18 %) (31. Dezember 2023: (0,41 %))

| Geforderter Betrag              | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust EUR | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 4.251.665 €                     | 4.633.949 US\$      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (221.039)                      | (0,01)               |
| 2.318.311 €                     | 1.936.367 £         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (22.142)                       | (0,00)               |
| 266.376.389 €                   | 296.371.946 US\$    | 16.01.2025       | UBS AG                      | 4         | (19.682.836)                   | (0,84)               |
| 17.505.549 €                    | 19.120.209 US\$     | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 2         | (949.342)                      | (0,04)               |
| 464.966.673 €                   | 388.983.749 £       | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 2         | (5.191.252)                    | (0,22)               |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 7.911.540 AUD                   | 4.837.090 €         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (109.018)                      | (0,01)               |
| 104.707 AUD                     | 64.953 €            | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | (2.379)                        | (0,00)               |
| 1.100.000 AUD                   | 678.540 €           | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 2         | (21.161)                       | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i> |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 55.429.263 CHF                  | 59.322.605 €        | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | (199.130)                      | (0,01)               |
| 2.810.598 CHF                   | 3.018.984 €         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 36        | (21.066)                       | (0,00)               |
| 5.057 €                         | 4.744 CHF           | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 2         | (3)                            | (0,00)               |

## Corporate Hybrid Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (1,18 %) (31. Dezember 2023: (0,41 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust EUR | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 1.276.848 €  | 1.065.145 £         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (10.575)                       | (0,00)               |
| 8.845.260 €  | 7.402.469 £         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 43        | (101.980)                      | (0,00)               |
| 22.102 £   | 26.724 €            | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 3         | (9)                            | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 38.050 €   | 54.567 SGD          | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 4         | (579)                          | (0,00)               |
| 2.500 SGD  | 1.772 €             | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 3         | (2)                            | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen USD</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 15.570.456 €   | 17.165.198 US\$     | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (997.452)                      | (0,04)               |
| 4.958.483 €  | 5.329.080 US\$      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 34        | (185.166)                      | (0,01)               |
| 1.462.950 US\$   | 1.412.102 €         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | (57)                           | (0,00)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>(27.715.188)</b>            | <b>(1,18)</b>        |

|   | Zeitwert EUR         | % des Nettovermögens |
|---|----------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(27.715.188)</b>  | <b>(1,18)</b>        |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>2.185.771.907</b> | <b>93,28</b>         |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>157.519.365</b>   | <b>6,72</b>          |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>2.343.291.272</b> | <b>100,00</b>        |

| Portfolioanalyse  | EUR                  | % des Gesamtvermögens |
|---|----------------------|-----------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 1.945.931.678        | 81,91                 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden            | 222.053.645          | 9,35                  |
| † Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente  | 14.002.897           | 0,59                  |
| µ Investmentfonds   | 12.265.572           | 0,52                  |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente   | (8.481.885)          | (0,36)                |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>2.185.771.907</b> | <b>92,01</b>          |

## Developed Market FMP – 2027 - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung  | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 98,66 % (31. Dezember 2023: 98,78 %)</b> |  |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |  |        |                       |                  |                              |
| 3.650.000  | AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust <sup>*</sup> | 2,45 % | 29.10.2026            | 3.496.812        | 2,75                         |
| 3.600.000  | Air Lease Corp <sup>*</sup>  | 3,63 % | 01.04.2027            | 3.480.722        | 2,73                         |
| 560.000  | Ally Financial Inc <sup>*</sup>                                      | 5,75 % | 20.11.2025            | 563.148          | 0,44                         |
| 1.062.500  | American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd <sup>**</sup>        | 5,50 % | 20.04.2026            | 1.061.012        | 0,83                         |
| 2.800.000  | American Tower Corp <sup>*</sup>                                     | 3,65 % | 15.03.2027            | 2.734.369        | 2,15                         |
| 1.285.000  | Amsted Industries Inc <sup>**</sup>                                  | 5,63 % | 01.07.2027            | 1.279.006        | 1,00                         |
| 1.000.000  | AT&T Inc <sup>**</sup>   | 3,80 % | 15.02.2027            | 981.367          | 0,77                         |
| 2.795.000  | Bank of America Corp <sup>*</sup>                                    | 4,25 % | 22.10.2026            | 2.773.292        | 2,18                         |
| 1.750.000  | BAT Capital Corp <sup>*</sup>  | 4,70 % | 02.04.2027            | 1.743.382        | 1,37                         |
| 355.000  | Bath & Body Works Inc <sup>*</sup>                                   | 6,69 % | 15.01.2027            | 363.991          | 0,29                         |
| 420.000  | Berry Global Inc <sup>**</sup>                                       | 5,63 % | 15.07.2027            | 419.723          | 0,33                         |
| 3.000.000  | BNP Paribas SA <sup>**</sup>   | 1,68 % | 30.06.2027            | 2.858.102        | 2,24                         |
| 2.100.000  | Boeing Co <sup>*</sup>   | 5,04 % | 01.05.2027            | 2.106.265        | 1,65                         |
| 3.500.000  | BPCE SA <sup>**</sup>  | 4,88 % | 01.04.2026            | 3.489.372        | 2,74                         |
| 580.000  | Buckeye Partners LP <sup>**</sup>                                    | 3,95 % | 01.12.2026            | 560.391          | 0,44                         |
| 3.600.000  | Capital One Financial Corp <sup>*</sup>                              | 3,65 % | 11.05.2027            | 3.505.377        | 2,75                         |
| 920.000  | Carnival Corp <sup>**</sup>  | 7,63 % | 01.03.2026            | 922.044          | 0,72                         |
| 1.225.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp <sup>**</sup>             | 5,13 % | 01.05.2027            | 1.204.745        | 0,95                         |
| 700.000  | CNH Industrial Capital LLC <sup>*</sup>                              | 1,45 % | 15.07.2026            | 666.126          | 0,52                         |
| 910.000  | Corebridge Financial Inc <sup>**</sup>                               | 3,65 % | 05.04.2027            | 884.920          | 0,69                         |
| 2.215.000  | Crown Castle Inc <sup>*</sup>  | 2,90 % | 15.03.2027            | 2.128.583        | 1,67                         |
| 630.000  | CSC Holdings LLC <sup>**</sup>                                       | 5,50 % | 15.04.2027            | 564.555          | 0,44                         |
| 2.125.000  | Dell International LLC/EMC Corp <sup>**</sup>                        | 4,90 % | 01.10.2026            | 2.132.755        | 1,67                         |
| 2.650.000  | Energy Transfer LP <sup>*</sup>                                      | 4,20 % | 15.04.2027            | 2.615.567        | 2,05                         |
| 835.000  | Energy Transfer LP <sup>**</sup>                                     | 5,63 % | 01.05.2027            | 837.208          | 0,66                         |
| 1.255.000  | EQM Midstream Partners LP <sup>**</sup>                              | 7,50 % | 01.06.2027            | 1.280.673        | 1,01                         |
| 3.075.000  | Ford Motor Credit Co LLC <sup>*</sup>                                | 6,95 % | 10.06.2026            | 3.146.620        | 2,47                         |
| 3.250.000  | General Motors Financial Co Inc <sup>*</sup>                         | 5,00 % | 09.04.2027            | 3.254.398        | 2,56                         |
| 193.000  | Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp <sup>*</sup>           | 8,00 % | 15.01.2027            | 196.546          | 0,15                         |
| 3.000.000  | Global Payments Inc <sup>*</sup>                                     | 2,15 % | 15.01.2027            | 2.845.172        | 2,23                         |
| 2.650.000  | HCA Inc <sup>*</sup>   | 4,50 % | 15.02.2027            | 2.625.895        | 2,06                         |
| 1.725.000  | Hess Corp <sup>*</sup>   | 4,30 % | 01.04.2027            | 1.707.872        | 1,34                         |
| 1.850.000  | HP Inc <sup>*</sup>  | 3,00 % | 17.06.2027            | 1.772.035        | 1,39                         |
| 3.000.000  | Imperial Brands Finance Plc <sup>*</sup>                             | 6,13 % | 27.07.2027            | 3.080.922        | 2,42                         |
| 3.250.000  | Lloyds Banking Group Plc <sup>*</sup>                                | 3,75 % | 11.01.2027            | 3.177.932        | 2,49                         |
| 1.070.000  | Mauser Packaging Solutions Holding Co <sup>**</sup>                  | 7,88 % | 15.04.2027            | 1.092.962        | 0,86                         |
| 3.300.000  | Micron Technology Inc <sup>**</sup>                                  | 4,19 % | 15.02.2027            | 3.255.676        | 2,56                         |
| 3.400.000  | Morgan Stanley <sup>*</sup>  | 3,95 % | 23.04.2027            | 3.333.016        | 2,62                         |
| 2.075.000  | MPLX LP <sup>*</sup>   | 4,13 % | 01.03.2027            | 2.044.761        | 1,61                         |

## Developed Market FMP – 2027 - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                    | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|--------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 98,66 % (31. Dezember 2023: 98,78 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |        |                       |                    |                              |
| 3.300.000  | Nationwide Building Society*                             | 4,00 % | 14.09.2026            | 3.238.906          | 2,54                         |
| 2.675.000  | NatWest Group Plc*                                       | 1,64 % | 14.06.2027            | 2.553.203          | 2,00                         |
| 1.100.000  | NiSource Inc*  | 3,49 % | 15.05.2027            | 1.071.036          | 0,84                         |
| 1.010.000  | NOVA Chemicals Corp**                                    | 5,25 % | 01.06.2027            | 982.189            | 0,77                         |
| 725.000  | OneMain Finance Corp**                                   | 7,13 % | 15.03.2026            | 738.566            | 0,58                         |
| 1.400.000  | Oracle Corp*   | 2,80 % | 01.04.2027            | 1.344.542          | 1,06                         |
| 3.400.000  | Paramount Global**                                       | 2,90 % | 15.01.2027            | 3.254.936          | 2,56                         |
| 1.635.000  | Penn Entertainment Inc**                                 | 5,63 % | 15.01.2027            | 1.610.689          | 1,26                         |
| 2.650.000  | Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp**       | 4,50 % | 15.12.2026            | 2.639.240          | 2,07                         |
| 2.970.000  | Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc** | 5,75 % | 15.04.2026            | 2.971.009          | 2,33                         |
| 2.775.000  | Rogers Communications Inc**                              | 3,20 % | 15.03.2027            | 2.681.341          | 2,11                         |
| 1.035.000  | Royal Caribbean Cruises Ltd**                            | 5,50 % | 31.08.2026            | 1.034.737          | 0,81                         |
| 3.800.000  | Santander UK Group Holdings Plc*                         | 1,67 % | 14.06.2027            | 3.619.156          | 2,84                         |
| 1.330.000  | SCIL IV LLC/SCIL USA Holdings LLC**                      | 5,38 % | 01.11.2026            | 1.304.115          | 1,02                         |
| 800.000  | Sempra*  | 3,25 % | 15.06.2027            | 770.531            | 0,61                         |
| 1.330.000  | Six Flags Entertainment Corp**                           | 5,50 % | 15.04.2027            | 1.322.606          | 1,04                         |
| 3.000.000  | Stellantis Finance US Inc**                              | 1,71 % | 29.01.2027            | 2.798.914          | 2,20                         |
| 955.000  | TK Elevator US Newco Inc**                               | 5,25 % | 15.07.2027            | 935.679            | 0,73                         |
| 1.250.000  | T-Mobile USA Inc**                                       | 3,75 % | 15.04.2027            | 1.221.556          | 0,96                         |
| 3.200.000  | UBS Group AG*  | 4,55 % | 17.04.2026            | 3.190.372          | 2,50                         |
| 3.500.000  | Viatis Inc**   | 2,30 % | 22.06.2027            | 3.282.822          | 2,58                         |
| 1.640.000  | Vistra Operations Co LLC**                               | 5,63 % | 15.02.2027            | 1.638.358          | 1,29                         |
| 3.080.000  | Warnermedia Holdings Inc**                               | 3,76 % | 15.03.2027            | 2.967.894          | 2,33                         |
| 1.355.000  | William Carter Co**                                      | 5,63 % | 15.03.2027            | 1.344.716          | 1,06                         |
| 1.000.000  | Williams Cos Inc*  | 3,75 % | 15.06.2027            | 975.023            | 0,77                         |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>125.679.450</b> | <b>98,66</b>                 |
| <b>Anlagen insgesamt</b>   |  |        |                       | <b>125.679.450</b> | <b>98,66</b>                 |

### Devisenterminkontrakte 0,00 % (31. Dezember 2023: 0,03 %)

| Geforderter<br>Betrag  | Zu zahlender<br>Betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei          | Kontrakte | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens          |
|--|------------------------|-----------------------|----------------------|-----------|--------------------------------------|---------------------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                        |                       |                      |           |                                      |                                       |
| 11.445 US\$  | 10.696 €               | 16.01.2025            | UBS AG               | 2         | 364                                  | 0,00                                  |
| 5.684 US\$   | 5.240 €                | 16.01.2025            | Westpac Banking Corp | 1         | 255                                  | 0,00                                  |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>                        |                        |                       |                      |           | <b>619</b>                           | <b>0,00</b>                           |
|  |                        |                       |                      |           | <b>Zeitwert<br/>US\$</b>             | <b>% des<br/>Nettöver-<br/>mögens</b> |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |                        |                       |                      |           | <b>125.680.069</b>                   | <b>98,66</b>                          |

## Developed Market FMP – 2027 - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (0,06 %) (31. Dezember 2023: (0,00 %))

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 7.794 €  | 8.729 US\$          | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (654)                           | (0,00)               |
| 1.036.321 €  | 1.142.473 US\$      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | (68.793)                        | (0,06)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>(69.447)</b>                 | <b>(0,06)</b>        |

|   | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens |
|---|--------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(69.447)</b>    | <b>(0,06)</b>        |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>125.610.622</b> | <b>98,60</b>         |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>1.778.571</b>   | <b>1,40</b>          |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>127.389.193</b> | <b>100,00</b>        |

| Portfolioanalyse  | US\$               | % des Gesamtvermögens |
|---|--------------------|-----------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 70.125.572         | 54,96                 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden            | 55.553.878         | 43,55                 |
| <sup>∞</sup> OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente  | (68.828)           | (0,05)                |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>125.610.622</b> | <b>98,46</b>          |

## EMD Corporate – Social and Environmental Transition - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 92,44 % (31. Dezember 2023: 85,35 %)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 368.000  | Abu Dhabi Commercial Bank PJSC <sup>*</sup>   | 4,50 %  | 14.09.2027            | 364.162          | 0,32                         |
| 250.000  | Abu Dhabi Commercial Bank PJSC <sup>*</sup>   | 5,38 %  | 18.07.2028            | 253.090          | 0,22                         |
| 330.000  | Abu Dhabi Commercial Bank PJSC <sup>*</sup>   | 5,50 %  | 12.01.2029            | 337.126          | 0,30                         |
| 205.000  | Abu Dhabi Commercial Bank PJSC <sup>**</sup>  | 8,00 %  | 31.12.2149            | 219.337          | 0,19                         |
| 400.000  | Access Bank Plc <sup>*</sup>  | 6,13 %  | 21.09.2026            | 383.297          | 0,34                         |
| 200.000  | Access Bank Plc <sup>*</sup>  | 9,13 %  | 31.12.2149            | 197.637          | 0,17                         |
| 600.000  | Adani Ports & Special Economic Zone Ltd <sup>*</sup>  | 4,20 %  | 04.08.2027            | 543.139          | 0,48                         |
| 600.000  | Aegea Finance Sarl <sup>**</sup>  | 9,00 %  | 20.01.2031            | 612.730          | 0,54                         |
| 217.000  | Africa Finance Corp <sup>*</sup>  | 2,88 %  | 28.04.2028            | 198.837          | 0,17                         |
| 303.000  | AIA Group Ltd <sup>**</sup>   | 2,70 %  | 31.12.2149            | 292.298          | 0,26                         |
| 250.000  | AIA Group Ltd <sup>**</sup>   | 5,38 %  | 05.04.2034            | 248.681          | 0,22                         |
| 295.000  | AIA Group Ltd <sup>**</sup>   | 5,40 %  | 30.09.2054            | 273.646          | 0,24                         |
| 240.000  | Akbank TAS <sup>**</sup>  | 7,50 %  | 20.01.2030            | 243.045          | 0,21                         |
| 400.000  | Akbank TAS <sup>**</sup>  | 9,37 %  | 31.12.2149            | 407.561          | 0,36                         |
| 320.000  | Aldar Investment Properties Sukuk Ltd <sup>*</sup>  | 4,88 %  | 24.05.2033            | 312.247          | 0,27                         |
| 300.000  | Aldar Investment Properties Sukuk Ltd <sup>*</sup>  | 5,50 %  | 16.05.2034            | 304.436          | 0,27                         |
| 450.000  | Alfa SAB de CV <sup>**</sup>  | 6,88 %  | 25.03.2044            | 470.077          | 0,41                         |
| 264.000  | Almarai Co JSC <sup>*</sup>   | 5,23 %  | 25.07.2033            | 267.561          | 0,23                         |
| 1.000.000  | Ambipar Lux Sarl <sup>**</sup>  | 9,88 %  | 06.02.2031            | 999.042          | 0,88                         |
| 300.000  | America Movil SAB de CV <sup>*</sup>  | 3,63 %  | 22.04.2029            | 282.336          | 0,25                         |
| 300.000  | America Movil SAB de CV <sup>*</sup>  | 4,70 %  | 21.07.2032            | 286.718          | 0,25                         |
| 460.000  | AngloGold Ashanti Holdings Plc <sup>*</sup>   | 3,75 %  | 01.10.2030            | 416.330          | 0,37                         |
| 388.000  | Antofagasta Plc <sup>*</sup>  | 5,63 %  | 13.05.2032            | 384.473          | 0,34                         |
| 240.000  | Aragvi Finance International DAC <sup>**</sup>  | 11,13 % | 20.11.2029            | 237.814          | 0,21                         |
| 300.000  | Axis Bank Ltd <sup>*</sup>  | 4,10 %  | 31.12.2149            | 287.323          | 0,25                         |
| 278.000  | Banco BTG Pactual SA <sup>**</sup>  | 6,25 %  | 08.04.2029            | 278.603          | 0,24                         |
| 400.000  | Banco Davivienda SA <sup>**</sup>   | 6,65 %  | 31.12.2149            | 344.174          | 0,30                         |
| 200.000  | Banco de Credito del Peru SA <sup>**</sup>  | 3,13 %  | 01.07.2030            | 196.241          | 0,17                         |
| 424.000  | Banco de Credito e Inversiones SA <sup>**</sup>   | 7,50 %  | 31.12.2149            | 413.938          | 0,36                         |
| 505.000  | Banco de Credito e Inversiones SA <sup>**</sup>   | 8,75 %  | 31.12.2149            | 528.608          | 0,46                         |
| 200.000  | Banco Mercantil del Norte SA <sup>**</sup>  | 5,88 %  | 31.12.2149            | 191.077          | 0,17                         |
| 200.000  | Banco Mercantil del Norte SA <sup>*</sup>   | 7,50 %  | 31.12.2149            | 193.679          | 0,17                         |
| 241.000  | Banco Santander Chile <sup>**</sup>   | 3,18 %  | 26.10.2031            | 211.168          | 0,19                         |
| 200.000  | Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand <sup>*</sup> | 5,62 %  | 10.12.2029            | 199.500          | 0,18                         |
| 325.000  | Bancolombia SA <sup>*</sup>   | 8,63 %  | 24.12.2034            | 340.595          | 0,30                         |
| 600.000  | Bangkok Bank PCL <sup>**</sup>  | 3,73 %  | 25.09.2034            | 544.248          | 0,48                         |
| 225.000  | Bangkok Bank PCL <sup>**</sup>  | 5,00 %  | 31.12.2149            | 223.279          | 0,20                         |

## EMD Corporate – Social and Environmental Transition - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 92,44 % (31. Dezember 2023: 85,35 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 250.000  | Bank Hapoalim BM*   | 3,26 %  | 21.01.2032            | 235.573          | 0,21                         |
| 285.000  | Bank Leumi Le-Israel BM**   | 3,28 %  | 29.01.2031            | 275.003          | 0,24                         |
| 333.000  | Bank Muscat SAOG*   | 4,75 %  | 17.03.2026            | 328.881          | 0,29                         |
| 400.000  | Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT*   | 4,30 %  | 31.12.2149            | 382.479          | 0,34                         |
| 450.000  | Bank of East Asia Ltd**   | 6,75 %  | 27.06.2034            | 450.221          | 0,40                         |
| 400.000  | BBVA Bancomer SA**  | 5,13 %  | 18.01.2033            | 372.375          | 0,33                         |
| 269.000  | BBVA Bancomer SA**  | 8,13 %  | 08.01.2039            | 274.620          | 0,24                         |
| 389.000  | Bimbo Bakeries USA Inc**  | 5,38 %  | 09.01.2036            | 375.499          | 0,33                         |
| 700.000  | BOC Aviation Ltd*   | 3,00 %  | 11.09.2029            | 643.325          | 0,57                         |
| 405.000  | BOC Aviation Ltd**  | 3,50 %  | 18.09.2027            | 391.802          | 0,34                         |
| 240.000  | BOC Aviation Ltd*   | 4,50 %  | 23.05.2028            | 236.728          | 0,21                         |
| 200.000  | BOC Aviation USA Corp**   | 4,88 %  | 03.05.2033            | 196.012          | 0,17                         |
| 208.125  | Borr IHC Ltd/Borr Finance LLC**   | 10,00 % | 15.11.2028            | 207.964          | 0,18                         |
| 260.000  | Braskem Idesa SAPI**  | 6,99 %  | 20.02.2032            | 191.373          | 0,17                         |
| 200.000  | Braskem Netherlands Finance BV**  | 4,50 %  | 31.01.2030            | 169.479          | 0,15                         |
| 600.000  | Braskem Netherlands Finance BV**  | 8,50 %  | 12.01.2031            | 602.035          | 0,53                         |
| 385.000  | BSF Finance*  | 5,50 %  | 23.11.2027            | 390.144          | 0,34                         |
| 400.000  | Buffalo Energy Mexico Holdings/Buffalo Energy Infrastructure/Buffalo Energy** | 7,88 %  | 15.02.2039            | 412.870          | 0,36                         |
| 400.000  | CAS Capital No 1 Ltd*   | 4,00 %  | 31.12.2149            | 383.387          | 0,34                         |
| 391.000  | Cathaylife Singapore Pte Ltd**  | 5,95 %  | 05.07.2034            | 403.818          | 0,35                         |
| 321.000  | CBQ Finance Ltd*  | 2,00 %  | 12.05.2026            | 306.913          | 0,27                         |
| 300.000  | Celulosa Arauco y Constitucion SA**   | 5,15 %  | 29.01.2050            | 253.281          | 0,22                         |
| 400.000  | Cemex SAB de CV**   | 5,13 %  | 31.12.2149            | 392.141          | 0,34                         |
| 200.000  | Cemex SAB de CV**   | 9,13 %  | 31.12.2149            | 206.438          | 0,18                         |
| 284.000  | Cencosud SA**   | 5,95 %  | 28.05.2031            | 283.755          | 0,25                         |
| 535.000  | Central American Bottling Corp/CBC Bottling Holdco SL/Beliv Holdco SL**       | 5,25 %  | 27.04.2029            | 507.687          | 0,45                         |
| 200.000  | Champion Path Holdings Ltd**  | 4,85 %  | 27.01.2028            | 189.602          | 0,17                         |
| 200.000  | Chile Electricity Lux Mpc II Sarl**   | 5,58 %  | 20.10.2035            | 194.606          | 0,17                         |
| 200.000  | China Cinda Finance 2017 I Ltd*   | 4,75 %  | 08.02.2028            | 196.144          | 0,17                         |
| 200.000  | China Overseas Finance Cayman VI Ltd**  | 6,45 %  | 11.06.2034            | 210.323          | 0,18                         |
| 200.000  | China Overseas Grand Oceans Finance IV Cayman Ltd*                            | 2,45 %  | 09.02.2026            | 191.191          | 0,17                         |
| 300.000  | Cibanco SA Ibm/PLA Administradora Industrial S de RL de CV**                  | 4,96 %  | 18.07.2029            | 285.242          | 0,25                         |
| 200.000  | CK Hutchison International 21 Ltd*  | 2,50 %  | 15.04.2031            | 171.736          | 0,15                         |
| 400.000  | CK Hutchison International 23 Ltd*  | 4,88 %  | 21.04.2033            | 389.671          | 0,34                         |
| 288.000  | CK Hutchison International 24 Ltd**   | 5,50 %  | 26.04.2034            | 290.875          | 0,26                         |
| 200.000  | Colombia Telecomunicaciones SA ESP**  | 4,95 %  | 17.07.2030            | 168.127          | 0,15                         |
| 307.200  | Cometa Energia SA de CV**   | 6,38 %  | 24.04.2035            | 303.921          | 0,27                         |

## EMD Corporate – Social and Environmental Transition - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 92,44 % (31. Dezember 2023: 85,35 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 390.000  | Commercial Bank of Dubai PSC*   | 5,32 %  | 14.06.2028            | 392.795          | 0,35                         |
| 200.000  | Commercial Bank PSQC*   | 4,50 %  | 31.12.2149            | 195.295          | 0,17                         |
| 200.000  | Compania de Minas Buenaventura SAA**  | 5,50 %  | 23.07.2026            | 199.985          | 0,18                         |
| 802.000  | Consolidated Energy Finance SA**  | 12,00 % | 15.02.2031            | 770.751          | 0,68                         |
| 200.000  | Consortio Transmantaro SA**   | 4,70 %  | 16.04.2034            | 185.526          | 0,16                         |
| 390.900  | Continuum Green Energy India Pvt/Co-Issuers**                                 | 7,50 %  | 26.06.2033            | 404.242          | 0,36                         |
| 247.000  | Cosan Luxembourg SA**   | 7,25 %  | 27.06.2031            | 242.796          | 0,21                         |
| 400.000  | CSN Resources SA**  | 4,63 %  | 10.06.2031            | 310.935          | 0,27                         |
| 239.000  | CSN Resources SA**  | 5,88 %  | 08.04.2032            | 193.091          | 0,17                         |
| 250.000  | CT Trust**  | 5,13 %  | 03.02.2032            | 223.923          | 0,20                         |
| 300.000  | DBS Group Holdings Ltd**  | 1,82 %  | 10.03.2031            | 288.769          | 0,25                         |
| 323.000  | DIB Sukuk Ltd*  | 1,96 %  | 22.06.2026            | 307.936          | 0,27                         |
| 322.000  | DIB Sukuk Ltd*  | 4,80 %  | 16.08.2028            | 319.178          | 0,28                         |
| 308.000  | DIB Sukuk Ltd*  | 5,49 %  | 30.11.2027            | 311.766          | 0,27                         |
| 503.584  | Digicel Intermediate Holdings Ltd/Digicel International Finance Ltd/Difl US** | 12,00 % | 25.05.2027            | 498.485          | 0,44                         |
| 273.000  | Eastern & Southern African Trade & Development Bank*                          | 4,13 %  | 30.06.2028            | 245.358          | 0,22                         |
| 200.000  | Ecopetrol SA**  | 4,63 %  | 02.11.2031            | 166.016          | 0,15                         |
| 488.000  | Ecopetrol SA**  | 5,88 %  | 28.05.2045            | 336.572          | 0,30                         |
| 300.000  | Ecopetrol SA**  | 7,38 %  | 18.09.2043            | 254.679          | 0,22                         |
| 300.000  | Ecopetrol SA*   | 7,75 %  | 01.02.2032            | 291.373          | 0,26                         |
| 384.000  | Ecopetrol SA*   | 8,88 %  | 13.01.2033            | 391.591          | 0,34                         |
| 390.000  | EI Sukuk Co Ltd*  | 5,43 %  | 28.05.2029            | 398.281          | 0,35                         |
| 300.000  | EIG Pearl Holdings Sarl*  | 3,55 %  | 31.08.2036            | 257.042          | 0,23                         |
| 224.000  | EIG Pearl Holdings Sarl*  | 4,39 %  | 30.11.2046            | 174.085          | 0,15                         |
| 292.000  | Emaar Sukuk Ltd*  | 3,88 %  | 17.09.2029            | 277.664          | 0,24                         |
| 200.000  | Emirates NBD Bank PJSC**  | 4,25 %  | 31.12.2149            | 191.981          | 0,17                         |
| 312.000  | Emirates NBD Bank PJSC**  | 5,14 %  | 26.11.2029            | 315.335          | 0,28                         |
| 329.000  | Emirates NBD Bank PJSC*   | 5,63 %  | 21.10.2027            | 335.189          | 0,29                         |
| 200.000  | Emirates NBD Bank PJSC*   | 5,88 %  | 11.10.2028            | 206.312          | 0,18                         |
| 300.000  | Emirates NBD Bank PJSC*   | 6,13 %  | 31.12.2149            | 299.925          | 0,26                         |
| 200.000  | Energean Israel Finance Ltd**   | 4,88 %  | 30.03.2026            | 196.182          | 0,17                         |
| 100.000  | Energean Israel Finance Ltd**   | 5,88 %  | 30.03.2031            | 88.425           | 0,08                         |
| 200.000  | Energean Israel Finance Ltd**   | 8,50 %  | 30.09.2033            | 196.925          | 0,17                         |
| 300.000  | EnfraGen Energia Sur SA/EnfraGen Spain SA/Prime Energia SpA**                 | 5,38 %  | 30.12.2030            | 256.146          | 0,22                         |
| 414.000  | FIEMEX Energia - Banco Actinver SA Institucion de Banca Multiple**            | 7,25 %  | 31.01.2041            | 406.010          | 0,36                         |
| 390.000  | First Abu Dhabi Bank PJSC*  | 5,00 %  | 28.02.2029            | 391.554          | 0,34                         |
| 206.000  | First Abu Dhabi Bank PJSC*  | 5,13 %  | 13.10.2027            | 207.729          | 0,18                         |
| 233.000  | First Abu Dhabi Bank PJSC*  | 6,32 %  | 04.04.2034            | 239.082          | 0,21                         |

## EMD Corporate – Social and Environmental Transition - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                       | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 92,44 % (31. Dezember 2023: 85,35 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 900.000  | First Quantum Minerals Ltd**                | 8,63 % | 01.06.2031            | 927.580          | 0,82                         |
| 300.000  | Fortune Star BVI Ltd**                      | 5,00 % | 18.05.2026            | 288.493          | 0,25                         |
| 350.000  | Fortune Star BVI Ltd**                      | 5,05 % | 27.01.2027            | 329.319          | 0,29                         |
| 400.000  | Franshion Brilliant Ltd*                    | 4,25 % | 23.07.2029            | 340.094          | 0,30                         |
| 325.000  | FS Luxembourg Sarl*                         | 8,88 % | 12.02.2031            | 330.005          | 0,29                         |
| 227.000  | FWD Group Holdings Ltd**                    | 7,64 % | 02.07.2031            | 242.624          | 0,21                         |
| 500.000  | FWD Group Holdings Ltd**                    | 8,05 % | 31.12.2149            | 499.062          | 0,44                         |
| 300.000  | Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd*           | 2,63 % | 31.03.2036            | 244.760          | 0,21                         |
| 269.922  | Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd*           | 2,94 % | 30.09.2040            | 213.712          | 0,19                         |
| 600.000  | GC Treasury Center Co Ltd*                  | 2,98 % | 18.03.2031            | 511.690          | 0,45                         |
| 270.000  | GENM Capital Labuan Ltd*                    | 3,88 % | 19.04.2031            | 238.918          | 0,21                         |
| 360.000  | Globe Telecom Inc*                          | 4,20 % | 31.12.2149            | 351.730          | 0,31                         |
| 200.000  | GLP China Holdings Ltd**                    | 2,95 % | 29.03.2026            | 180.480          | 0,16                         |
| 200.000  | GLP Pte Ltd**                               | 3,88 % | 04.06.2025            | 193.052          | 0,17                         |
| 200.000  | GLP Pte Ltd**                               | 4,50 % | 31.12.2149            | 116.392          | 0,10                         |
| 358.000  | Greenko Dutch BV**                          | 3,85 % | 29.03.2026            | 348.250          | 0,30                         |
| 751.500  | Greenko Power II Ltd*                       | 4,30 % | 13.12.2028            | 708.379          | 0,63                         |
| 200.000  | Greensaif Pipelines Bidco Sarl*             | 6,51 % | 23.02.2042            | 203.236          | 0,18                         |
| 400.000  | Grupo Aeromexico SAB de CV**                | 8,25 % | 15.11.2029            | 394.952          | 0,35                         |
| 200.000  | Grupo Aval Ltd*                             | 4,38 % | 04.02.2030            | 176.317          | 0,15                         |
| 300.000  | Hanwha Life Insurance Co Ltd**              | 3,38 % | 04.02.2032            | 287.980          | 0,25                         |
| 445.000  | HDFC Bank Ltd**                             | 3,70 % | 31.12.2149            | 417.421          | 0,37                         |
| 203.000  | HPHT Finance 21 Ltd**                       | 2,00 % | 19.03.2026            | 195.983          | 0,17                         |
| 400.000  | Hunt Oil Co of Peru LLC Sucursal Del Peru** | 8,55 % | 18.09.2033            | 436.723          | 0,38                         |
| 300.000  | Hyundai Card Co Ltd*                        | 5,75 % | 24.04.2029            | 304.773          | 0,27                         |
| 250.000  | IHS Holding Ltd**                           | 6,25 % | 29.11.2028            | 236.860          | 0,21                         |
| 390.000  | IHS Holding Ltd**                           | 7,88 % | 29.05.2030            | 385.114          | 0,34                         |
| 216.000  | Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT**         | 3,40 % | 09.06.2031            | 191.631          | 0,17                         |
| 300.000  | InRetail Consumer**                         | 3,25 % | 22.03.2028            | 275.512          | 0,24                         |
| 400.000  | Investment Energy Resources Ltd*            | 6,25 % | 26.04.2029            | 385.667          | 0,34                         |
| 421.000  | IRB Infrastructure Developers Ltd**         | 7,11 % | 11.03.2032            | 426.226          | 0,37                         |
| 147.500  | JSW Hydro Energy Ltd*                       | 4,13 % | 18.05.2031            | 133.196          | 0,12                         |
| 200.000  | Kasikornbank PCL*                           | 3,34 % | 02.10.2031            | 191.529          | 0,17                         |
| 245.000  | Kasikornbank PCL*                           | 5,46 % | 07.03.2028            | 247.313          | 0,22                         |
| 300.000  | KazMunayGas National Co JSC*                | 3,50 % | 14.04.2033            | 249.036          | 0,22                         |
| 200.000  | KazMunayGas National Co JSC*                | 5,38 % | 24.04.2030            | 194.944          | 0,17                         |
| 550.000  | KazMunayGas National Co JSC*                | 5,75 % | 19.04.2047            | 475.758          | 0,42                         |
| 207.000  | Khazanah Capital Ltd*                       | 4,88 % | 01.06.2033            | 201.513          | 0,18                         |

## EMD Corporate – Social and Environmental Transition - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                       | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 92,44 % (31. Dezember 2023: 85,35 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 200.000  | Klabin Austria GmbH*                        | 7,00 % | 03.04.2049            | 202.688          | 0,18                         |
| 223.000  | Kookmin Bank**                              | 2,50 % | 04.11.2030            | 190.043          | 0,17                         |
| 200.000  | Kosmos Energy Ltd**                         | 7,50 % | 01.03.2028            | 189.614          | 0,17                         |
| 240.000  | Kosmos Energy Ltd**                         | 8,75 % | 01.10.2031            | 226.342          | 0,20                         |
| 450.000  | Las Vegas Sands Corp*                       | 3,90 % | 08.08.2029            | 418.630          | 0,37                         |
| 200.000  | Las Vegas Sands Corp*                       | 6,20 % | 15.08.2034            | 201.232          | 0,18                         |
| 325.000  | Latam Airlines Group SA**                   | 7,88 % | 15.04.2030            | 329.423          | 0,29                         |
| 262.000  | LD Celulose International GmbH**            | 7,95 % | 26.01.2032            | 262.921          | 0,23                         |
| 200.000  | Lenovo Group Ltd*                           | 3,42 % | 02.11.2030            | 179.829          | 0,16                         |
| 199.038  | Leviathan Bond Ltd*                         | 6,75 % | 30.06.2030            | 188.791          | 0,17                         |
| 229.000  | LG Chem Ltd*                                | 2,38 % | 07.07.2031            | 188.945          | 0,17                         |
| 200.000  | LG Energy Solution Ltd**                    | 5,75 % | 25.09.2028            | 202.603          | 0,18                         |
| 400.000  | Limak Cimento Sanayi ve Ticaret AS**        | 9,75 % | 25.07.2029            | 394.386          | 0,35                         |
| 200.000  | Longfor Group Holdings Ltd**                | 3,95 % | 16.09.2029            | 150.422          | 0,13                         |
| 200.000  | MAF Sukuk Ltd*                              | 4,64 % | 14.05.2029            | 195.936          | 0,17                         |
| 200.000  | MARB BondCo Plc*                            | 3,95 % | 29.01.2031            | 167.685          | 0,15                         |
| 327.000  | Masdar Abu Dhabi Future Energy Co*          | 4,88 % | 25.07.2029            | 325.502          | 0,29                         |
| 205.000  | Mashreqbank PSC**                           | 7,13 % | 31.12.2149            | 211.513          | 0,19                         |
| 719.945  | MC Brazil Downstream Trading Sarl**         | 7,25 % | 30.06.2031            | 598.881          | 0,53                         |
| 200.000  | Medco Bell Pte Ltd**                        | 6,38 % | 30.01.2027            | 200.049          | 0,18                         |
| 250.000  | Medco Maple Tree Pte Ltd**                  | 8,96 % | 27.04.2029            | 263.898          | 0,23                         |
| 560.000  | MEGlobal BV**                               | 2,63 % | 28.04.2028            | 507.396          | 0,45                         |
| 322.000  | MEGlobal Canada ULC*                        | 5,88 % | 18.05.2030            | 328.927          | 0,29                         |
| 750.000  | Melco Resorts Finance Ltd**                 | 5,63 % | 17.07.2027            | 726.558          | 0,64                         |
| 550.000  | Melco Resorts Finance Ltd*                  | 5,75 % | 21.07.2028            | 525.955          | 0,46                         |
| 200.000  | Melco Resorts Finance Ltd**                 | 7,63 % | 17.04.2032            | 201.016          | 0,18                         |
| 517.000  | Mersin Uluslararası Liman İşletmeciliği AS* | 8,25 % | 15.11.2028            | 536.153          | 0,47                         |
| 200.000  | Metinvest BV**                              | 7,75 % | 17.10.2029            | 141.034          | 0,12                         |
| 200.000  | MGM China Holdings Ltd**                    | 4,75 % | 01.02.2027            | 193.728          | 0,17                         |
| 200.000  | MGM China Holdings Ltd**                    | 7,13 % | 26.06.2031            | 202.897          | 0,18                         |
| 200.000  | MHP Lux SA*                                 | 6,95 % | 03.04.2026            | 186.125          | 0,16                         |
| 250.000  | Millicom International Cellular SA**        | 4,50 % | 27.04.2031            | 219.295          | 0,19                         |
| 315.000  | Millicom International Cellular SA*         | 6,25 % | 25.03.2029            | 310.162          | 0,27                         |
| 679.000  | Minera Mexico SA de CV**                    | 4,50 % | 26.01.2050            | 515.822          | 0,46                         |
| 294.000  | Minerva Luxembourg SA*                      | 4,38 % | 18.03.2031            | 246.936          | 0,22                         |
| 200.000  | Minerva Luxembourg SA**                     | 8,88 % | 13.09.2033            | 207.695          | 0,18                         |
| 500.000  | Minsur SA**                                 | 4,50 % | 28.10.2031            | 443.985          | 0,39                         |
| 300.000  | MTN Mauritius Investments Ltd*              | 6,50 % | 13.10.2026            | 303.269          | 0,27                         |

## EMD Corporate – Social and Environmental Transition - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung  | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 92,44 % (31. Dezember 2023: 85,35 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |        |                       |                  |                              |
| 225.630  | MV24 Capital BV <sup>*</sup>   | 6,75 % | 01.06.2034            | 214.150          | 0,19                         |
| 192.484  | Nakilat Inc <sup>**</sup>  | 6,07 % | 31.12.2033            | 201.044          | 0,18                         |
| 390.000  | Nanshan Life Pte Ltd <sup>**</sup>   | 5,45 % | 11.09.2034            | 378.293          | 0,33                         |
| 900.000  | National Bank of Ras Al-Khaimah PSC <sup>*</sup>                             | 5,38 % | 25.07.2029            | 913.176          | 0,80                         |
| 296.000  | Navoi Mining & Metallurgical Combinat <sup>*</sup>                           | 6,95 % | 17.10.2031            | 292.655          | 0,26                         |
| 388.000  | NBK SPC Ltd <sup>*</sup>   | 1,63 % | 15.09.2027            | 364.852          | 0,32                         |
| 200.000  | NBK SPC Ltd <sup>**</sup>  | 5,50 % | 06.06.2030            | 201.983          | 0,18                         |
| 559.000  | NBK Tier 1 Financing 2 Ltd <sup>*</sup>                                      | 4,50 % | 31.12.2149            | 550.758          | 0,48                         |
| 652.000  | NewCo Holding USD 20 Sarl <sup>**</sup>                                      | 9,38 % | 07.11.2029            | 650.044          | 0,57                         |
| 450.000  | Nexa Resources SA <sup>**</sup>  | 6,75 % | 09.04.2034            | 458.716          | 0,40                         |
| 408.000  | Niagara Energy SAC <sup>**</sup>   | 5,75 % | 03.10.2034            | 395.862          | 0,35                         |
| 200.000  | NWD Finance BVI Ltd <sup>*</sup>   | 5,25 % | 31.12.2149            | 88.223           | 0,08                         |
| 200.000  | NWD MTN Ltd <sup>**</sup>  | 4,13 % | 18.07.2029            | 121.633          | 0,11                         |
| 294.000  | Ooredoo International Finance Ltd <sup>*</sup>                               | 2,63 % | 08.04.2031            | 255.658          | 0,22                         |
| 200.000  | Ooredoo International Finance Ltd <sup>*</sup>                               | 4,63 % | 10.10.2034            | 191.296          | 0,17                         |
| 200.000  | Otel Sukuk Ltd <sup>*</sup>  | 5,38 % | 24.01.2031            | 199.331          | 0,18                         |
| 200.000  | Oversea-Chinese Banking Corp Ltd <sup>**</sup>                               | 1,83 % | 10.09.2030            | 195.365          | 0,17                         |
| 262.000  | Oversea-Chinese Banking Corp Ltd <sup>*</sup>                                | 4,60 % | 15.06.2032            | 259.503          | 0,23                         |
| 200.000  | Oversea-Chinese Banking Corp Ltd <sup>*</sup>                                | 5,52 % | 21.05.2034            | 201.840          | 0,18                         |
| 283.000  | Oztel Holdings SPC Ltd <sup>*</sup>  | 6,63 % | 24.04.2028            | 292.253          | 0,26                         |
| 440.000  | Pegasus Hava Tasimaciligi AS <sup>*</sup>                                    | 8,00 % | 11.09.2031            | 437.224          | 0,38                         |
| 1.250.000  | Petroleos Mexicanos <sup>**</sup>  | 6,70 % | 16.02.2032            | 1.088.393        | 0,96                         |
| 200.000  | Power Finance Corp Ltd <sup>*</sup>  | 3,95 % | 23.04.2030            | 186.327          | 0,16                         |
| 1.100.000  | Prosus NV <sup>*</sup>   | 3,68 % | 21.01.2030            | 993.035          | 0,87                         |
| 800.000  | Prosus NV <sup>*</sup>   | 3,83 % | 08.02.2051            | 517.720          | 0,45                         |
| 400.000  | Prosus NV <sup>*</sup>   | 4,19 % | 19.01.2032            | 357.050          | 0,31                         |
| 400.000  | Prudential Funding Asia Plc <sup>*</sup>                                     | 2,95 % | 03.11.2033            | 364.389          | 0,32                         |
| 240.000  | QNB Bank AS <sup>**</sup>  | 7,25 % | 21.05.2029            | 250.205          | 0,22                         |
| 367.000  | QNB Finance Ltd <sup>*</sup>   | 2,75 % | 12.02.2027            | 350.531          | 0,31                         |
| 300.000  | Raizen Fuels Finance SA <sup>**</sup>  | 5,70 % | 17.01.2035            | 277.950          | 0,24                         |
| 355.000  | Raizen Fuels Finance SA <sup>**</sup>  | 6,95 % | 05.03.2054            | 350.429          | 0,31                         |
| 390.000  | REC Ltd <sup>*</sup>   | 2,25 % | 01.09.2026            | 371.884          | 0,33                         |
| 450.000  | Reliance Industries Ltd <sup>*</sup>   | 2,88 % | 12.01.2032            | 382.770          | 0,34                         |
| 378.000  | Reliance Industries Ltd <sup>*</sup>   | 3,63 % | 12.01.2052            | 261.307          | 0,23                         |
| 850.000  | ReNew Wind Energy AP2/ReNew Power Pvt Ltd other 9 Subsidiaries <sup>**</sup> | 4,50 % | 14.07.2028            | 790.213          | 0,69                         |
| 337.000  | SABIC Capital I BV <sup>*</sup>  | 2,15 % | 14.09.2030            | 285.281          | 0,25                         |
| 285.000  | Sable International Finance Ltd <sup>**</sup>                                | 7,13 % | 15.10.2032            | 279.722          | 0,25                         |
| 1.030.004  | Samarco Mineracao SA <sup>**</sup>   | 9,00 % | 30.06.2031            | 1.008.034        | 0,89                         |

## EMD Corporate – Social and Environmental Transition - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 92,44 % (31. Dezember 2023: 85,35 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 400.000  | Sands China Ltd**   | 2,85 % | 08.03.2029            | 356.838          | 0,31                         |
| 200.000  | Sands China Ltd**   | 3,80 % | 08.01.2026            | 196.272          | 0,17                         |
| 950.000  | Sands China Ltd**   | 5,40 % | 08.08.2028            | 940.002          | 0,83                         |
| 875.000  | SEPLAT Energy Plc*  | 7,75 % | 01.04.2026            | 873.120          | 0,77                         |
| 232.000  | SF Holding Investment 2021 Ltd*                                 | 3,13 % | 17.11.2031            | 205.175          | 0,18                         |
| 600.000  | Shinhan Bank Co Ltd*  | 4,38 % | 13.04.2032            | 556.500          | 0,49                         |
| 350.000  | Shinhan Bank Co Ltd**   | 4,50 % | 12.04.2028            | 345.114          | 0,30                         |
| 300.000  | Shriram Finance Ltd**   | 6,15 % | 03.04.2028            | 296.514          | 0,26                         |
| 200.000  | Shriram Finance Ltd**   | 6,63 % | 22.04.2027            | 201.910          | 0,18                         |
| 200.000  | Siam Commercial Bank PCL**                                      | 4,40 % | 11.02.2029            | 194.645          | 0,17                         |
| 600.000  | SierraCol Energy Andina LLC**                                   | 6,00 % | 15.06.2028            | 542.437          | 0,48                         |
| 400.000  | SingTel Group Treasury Pte Ltd**                                | 1,88 % | 10.06.2030            | 344.367          | 0,30                         |
| 300.000  | Sisecam UK Plc**  | 8,63 % | 02.05.2032            | 298.494          | 0,26                         |
| 208.000  | SK Battery America Inc**  | 2,13 % | 26.01.2026            | 200.064          | 0,18                         |
| 566.000  | SK Hynix Inc*   | 2,38 % | 19.01.2031            | 474.833          | 0,42                         |
| 466.000  | SK Hynix Inc*   | 6,38 % | 17.01.2028            | 480.823          | 0,42                         |
| 225.000  | SK Hynix Inc**  | 6,50 % | 17.01.2033            | 237.935          | 0,21                         |
| 246.000  | SNB Sukuk Ltd*  | 2,34 % | 19.01.2027            | 233.313          | 0,20                         |
| 270.000  | St Marys Cement Inc Canada**                                    | 5,75 % | 02.04.2034            | 260.721          | 0,23                         |
| 200.000  | Standard Chartered Plc*   | 1,46 % | 14.01.2027            | 192.695          | 0,17                         |
| 400.000  | Standard Chartered Plc*   | 4,30 % | 31.12.2149            | 358.500          | 0,31                         |
| 483.000  | Standard Chartered Plc*   | 6,30 % | 06.07.2034            | 501.715          | 0,44                         |
| 300.000  | Standard Chartered Plc*   | 6,30 % | 09.01.2029            | 308.235          | 0,27                         |
| 200.000  | Standard Chartered Plc*   | 7,02 % | 08.02.2030            | 211.890          | 0,19                         |
| 200.000  | Star Energy Geothermal Darajat II/Star Energy Geothermal Salak* | 4,85 % | 14.10.2038            | 185.924          | 0,16                         |
| 200.000  | Stillwater Mining Co*   | 4,00 % | 16.11.2026            | 190.079          | 0,17                         |
| 400.000  | Studio City Finance Ltd*  | 6,50 % | 15.01.2028            | 390.368          | 0,34                         |
| 200.000  | Sun Hung Kai Properties Capital Market Ltd**                    | 3,75 % | 25.02.2029            | 190.041          | 0,17                         |
| 200.000  | Suzano Austria GmbH*  | 3,75 % | 15.01.2031            | 176.638          | 0,16                         |
| 276.000  | Suzano Austria GmbH**   | 7,00 % | 16.03.2047            | 290.651          | 0,26                         |
| 744.000  | Telecom Argentina SA**  | 9,50 % | 18.07.2031            | 765.576          | 0,67                         |
| 129.000  | Telecom Argentina SA 144A**                                     | 9,50 % | 18.07.2031            | 132.741          | 0,12                         |
| 224.000  | Telecommunications co Telekom Srbija AD Belgrade**              | 7,00 % | 28.10.2029            | 223.774          | 0,20                         |
| 400.000  | Telecomunicaciones Digitales SA**                               | 4,50 % | 30.01.2030            | 363.934          | 0,32                         |
| 359.000  | Telefonica Celular del Paraguay SA**                            | 5,88 % | 15.04.2027            | 356.162          | 0,31                         |
| 429.000  | Tengizchevroil Finance Co International Ltd**                   | 3,25 % | 15.08.2030            | 365.090          | 0,32                         |
| 500.000  | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV*                 | 3,15 % | 01.10.2026            | 480.881          | 0,42                         |
| 418.000  | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV*                 | 4,10 % | 01.10.2046            | 301.062          | 0,26                         |

## EMD Corporate – Social and Environmental Transition - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                            | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 92,44 % (31. Dezember 2023: 85,35 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 647.000  | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV** | 8,13 %  | 15.09.2031            | 723.934          | 0,64                         |
| 710.000  | Thaioil Treasury Center Co Ltd*                  | 3,75 %  | 18.06.2050            | 450.651          | 0,40                         |
| 173.454  | Tierra Mojada Luxembourg II Sarl**               | 5,75 %  | 01.12.2040            | 158.859          | 0,14                         |
| 800.000  | Trident Energy Finance Plc**                     | 12,50 % | 30.11.2029            | 840.726          | 0,74                         |
| 400.000  | Trust Fibra Uno**                                | 4,87 %  | 15.01.2030            | 362.681          | 0,32                         |
| 200.000  | Trust Fibra Uno**                                | 6,95 %  | 30.01.2044            | 173.152          | 0,15                         |
| 200.000  | Trust Fibra Uno**                                | 7,38 %  | 13.02.2034            | 199.797          | 0,18                         |
| 500.000  | TSMC Arizona Corp*                               | 1,75 %  | 25.10.2026            | 474.121          | 0,42                         |
| 400.000  | TSMC Arizona Corp*                               | 2,50 %  | 25.10.2031            | 342.549          | 0,30                         |
| 550.000  | TSMC Arizona Corp*                               | 3,25 %  | 25.10.2051            | 395.555          | 0,35                         |
| 893.000  | TSMC Arizona Corp*                               | 4,25 %  | 22.04.2032            | 856.245          | 0,75                         |
| 500.000  | TSMC Global Ltd*                                 | 1,75 %  | 23.04.2028            | 452.511          | 0,40                         |
| 1.000.000  | TSMC Global Ltd*                                 | 2,25 %  | 23.04.2031            | 852.831          | 0,75                         |
| 238.000  | Turk Telekomunikasyon AS**                       | 7,38 %  | 20.05.2029            | 242.688          | 0,21                         |
| 269.000  | Turkiye Garanti Bankasi AS*                      | 8,38 %  | 28.02.2034            | 274.611          | 0,24                         |
| 360.000  | Turkiye Is Bankasi AS**                          | 7,75 %  | 12.06.2029            | 371.486          | 0,33                         |
| 257.000  | Turkiye Vakiflar Bankasi TAO*                    | 5,50 %  | 01.10.2026            | 255.072          | 0,22                         |
| 361.000  | Turkiye Vakiflar Bankasi TAO*                    | 9,00 %  | 12.10.2028            | 385.410          | 0,34                         |
| 251.000  | TVF Varlik Kiralama AS*                          | 6,95 %  | 23.01.2030            | 252.631          | 0,22                         |
| 400.000  | United Overseas Bank Ltd*                        | 2,00 %  | 14.10.2031            | 379.236          | 0,33                         |
| 500.000  | United Overseas Bank Ltd*                        | 3,86 %  | 07.10.2032            | 484.853          | 0,43                         |
| 302.000  | Vale Overseas Ltd*                               | 6,13 %  | 12.06.2033            | 305.993          | 0,27                         |
| 200.000  | Vanke Real Estate Hong Kong Co Ltd*              | 3,98 %  | 09.11.2027            | 100.765          | 0,09                         |
| 760.000  | Vedanta Resources Finance II Plc**               | 10,88 % | 17.09.2029            | 787.086          | 0,69                         |
| 798.000  | Vista Energy Argentina SAU**                     | 7,63 %  | 10.12.2035            | 793.810          | 0,70                         |
| 300.000  | VTR Comunicaciones SpA**                         | 5,13 %  | 15.01.2028            | 280.602          | 0,25                         |
| 921.000  | VTR Finance NV**                                 | 6,38 %  | 15.07.2028            | 875.833          | 0,77                         |
| 480.000  | WE Soda Investments Holding Plc**                | 9,50 %  | 06.10.2028            | 494.160          | 0,43                         |
| 200.000  | Wharf REIC Finance BVI Ltd*                      | 3,50 %  | 17.01.2028            | 190.789          | 0,17                         |
| 200.000  | Woori Bank**                                     | 6,38 %  | 31.12.2149            | 202.818          | 0,18                         |
| 200.000  | Wynn Macau Ltd*                                  | 5,50 %  | 01.10.2027            | 194.797          | 0,17                         |
| 985.000  | Wynn Macau Ltd*                                  | 5,63 %  | 26.08.2028            | 949.541          | 0,83                         |
| 387.000  | XP Inc**   | 6,75 %  | 02.07.2029            | 385.069          | 0,34                         |
| 495.000  | Yapi ve Kredi Bankasi AS**                       | 9,25 %  | 16.10.2028            | 534.469          | 0,47                         |
| 300.000  | Yapi ve Kredi Bankasi AS**                       | 9,25 %  | 17.01.2034            | 312.824          | 0,27                         |
| 325.000  | Yapi ve Kredi Bankasi AS**                       | 9,74 %  | 31.12.2149            | 335.424          | 0,29                         |
| 550.000  | Yinson Boronia Production BV*                    | 8,95 %  | 31.07.2042            | 574.454          | 0,50                         |
| 483.000  | YPF Energia Electrica SA**                       | 7,88 %  | 16.10.2032            | 478.160          | 0,42                         |

## EMD Corporate – Social and Environmental Transition - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                               | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 92,44 % (31. Dezember 2023: 85,35 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                    |                              |
| 665.000  | YPF SA**  | 7,00 %  | 15.12.2047            | 588.808            | 0,52                         |
| 1.134.000  | YPF SA**  | 9,50 %  | 17.01.2031            | 1.213.957          | 1,07                         |
| 300.000  | Zorlu Enerji Elektrik Uretim AS*                    | 11,00 % | 23.04.2030            | 302.665            | 0,27                         |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>  |   |         |                       | <b>105.120.488</b> | <b>92,44</b>                 |
| <b>Staatsanleihen 5,96 % (31. Dezember 2023: 7,33 %)</b>                       |   |         |                       |                    |                              |
| <b>Euro</b>  |   |         |                       |                    |                              |
| 6.298  | Argentine Republic Government International Bond*   | 0,50 %  | 09.07.2029            | 5.023              | 0,00                         |
| 1.425.000  | Ivory Coast Government International Bond*          | 4,88 %  | 30.01.2032            | 1.304.992          | 1,15                         |
| 233.000  | Republic of Poland Government International Bond*   | 3,13 %  | 22.10.2031            | 243.414            | 0,21                         |
| <b>Euro insgesamt</b>  |   |         |                       | <b>1.553.429</b>   | <b>1,36</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>   |   |         |                       |                    |                              |
| 518.000  | Amazon Conservation DAC**                           | 6,03 %  | 16.01.2042            | 516.834            | 0,45                         |
| 556.083  | Argentine Republic Government International Bond*   | 0,75 %  | 09.07.2030            | 429.963            | 0,38                         |
| 452.025  | Argentine Republic Government International Bond*   | 3,50 %  | 09.07.2041            | 283.270            | 0,25                         |
| 400.000  | Argentine Republic Government International Bond*   | 4,13 %  | 09.07.2035            | 266.262            | 0,23                         |
| 565.685  | Argentine Republic Government International Bond*   | 5,00 %  | 09.01.2038            | 396.878            | 0,35                         |
| 401.000  | Chile Government International Bond*                | 4,95 %  | 05.01.2036            | 380.370            | 0,33                         |
| 300.000  | Colombia Government International Bond*             | 7,75 %  | 07.11.2036            | 293.820            | 0,26                         |
| 1.050.000  | Dominican Republic International Bond*              | 7,05 %  | 03.02.2031            | 1.077.825          | 0,95                         |
| 353.000  | El Salvador Government International Bond**         | 0,25 %  | 17.04.2030            | 7.174              | 0,01                         |
| 353.000  | El Salvador Government International Bond**         | 9,25 %  | 17.04.2030            | 374.621            | 0,33                         |
| 330.000  | Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS**            | 6,50 %  | 26.04.2030            | 326.604            | 0,29                         |
| 200.000  | Korea Mine Rehabilitation & Mineral Resources Corp* | 5,38 %  | 11.05.2028            | 201.648            | 0,18                         |
| 284.000  | Philippine Government International Bond*           | 5,50 %  | 17.01.2048            | 277.632            | 0,24                         |
| 5.415  | Ukraine Government International Bond*              | 0,00 %  | 01.02.2030            | 2.973              | 0,00                         |
| 20.236   | Ukraine Government International Bond*              | 0,00 %  | 01.02.2034            | 8.424              | 0,01                         |
| 17.101   | Ukraine Government International Bond*              | 0,00 %  | 01.02.2035            | 10.141             | 0,01                         |
| 14.250   | Ukraine Government International Bond*              | 0,00 %  | 01.02.2036            | 8.406              | 0,01                         |
| 400.000  | Ukraine Government International Bond*              | 0,00 %  | 01.08.2041            | 309.747            | 0,27                         |
| 49.568   | Ukraine Government International Bond*              | 1,75 %  | 01.02.2034            | 28.068             | 0,03                         |
| 24.784   | Ukraine Government International Bond*              | 1,75 %  | 01.02.2035            | 13.686             | 0,01                         |
| 24.784   | Ukraine Government International Bond*              | 1,75 %  | 01.02.2036            | 13.493             | 0,01                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |   |         |                       | <b>5.227.839</b>   | <b>4,60</b>                  |
| <b>Staatsanleihen insgesamt</b>  |   |         |                       | <b>6.781.268</b>   | <b>5,96</b>                  |
| <b>Anlagen insgesamt</b>   |   |         |                       | <b>111.901.756</b> | <b>98,40</b>                 |

## EMD Corporate – Social and Environmental Transition - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 0,24 % (31. Dezember 2023: 1,95 %)

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 119.408 US\$  | 865.136 CNY         | 19.03.2025       | Citibank NA                 | 1         | 1.362                          | 0,00                 |
| 2.932.187 US\$  | 2.782.457 €         | 04.02.2025       | HSBC Bank Plc               | 1         | 47.168                         | 0,04                 |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i>   |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 207.904 US\$  | 183.747 CHF         | 13.03.2025       | Goldman Sachs International | 1         | 3.595                          | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>   |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 4.510.526 US\$  | 4.246.633 €         | 13.03.2025       | Citibank NA                 | 1         | 99.952                         | 0,09                 |
| 4.510.532 US\$  | 4.246.633 €         | 13.03.2025       | UBS AG                      | 1         | 99.958                         | 0,09                 |
| 1.145.738 US\$  | 1.092.091 €         | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 2         | 11.487                         | 0,01                 |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>   |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 273.189 US\$  | 213.984 £           | 13.03.2025       | Citibank NA                 | 2         | 5.335                          | 0,01                 |
| <i>Abgesicherte Klassen SEK</i>   |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 100 SEK   | 9 US\$              | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | 0                              | 0,00                 |
| 1.209 US\$  | 13.278 SEK          | 13.03.2025       | Goldman Sachs International | 1         | 3                              | 0,00                 |
| 430 US\$  | 4.707 SEK           | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | 3                              | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>268.863</b>                 | <b>0,24</b>          |

### Futures-Kontrakte 0,10 % (31. Dezember 2023: 0,03 %)

| Anzahl Kontrakte   | Beschreibung                                     | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|--|--------------------------------|----------------------|
| (7)  | Euro-Bund Future March 2025                      | 20.803                         | 0,02                 |
| (55)   | US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2025 | 68.750                         | 0,06                 |
| (8)  | US Treasury Long Bond (CBT) Future March 2025    | 25.625                         | 0,02                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten <sup>±</sup></b> |  |                                | <b>115.178</b>       |

### Credit-Default-Swap-Kontrakten 0,11 % (31. Dezember 2023: 0,00 %)

| Nominalwert   | Fälligkeit | Gegenpartei                 | Referenzverbindlichkeit                | Zeitwert US\$  | % des Nettovermögens |
|---|------------|-----------------------------|--|----------------|----------------------|
| USD 4.000.000   | 20.12.2029 | ICE Clear U.S. <sup>1</sup> | Buying default protection on CDX.EM.42 | 125.331        | 0,11                 |
| <b>Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt <sup>±</sup></b> |            |                             |  | <b>125.331</b> | <b>0,11</b>          |

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

| Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens |
|---|--------------------|----------------------|
|   | <b>112.411.128</b> | <b>98,85</b>         |

## EMD Corporate – Social and Environmental Transition - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (2,20 %) (31. Dezember 2023: (0,24 %))

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 1.447.406 €  | 1.523.438 US\$      | 04.02.2025       | UBS AG                      | 2         | (22.680)                        | (0,02)               |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 303.920 CHF  | 349.644 US\$        | 13.03.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (11.715)                        | (0,01)               |
| 21.714.952 CHF   | 24.977.076 US\$     | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 4         | (832.155)                       | (0,73)               |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 69.302.097 €   | 73.602.686 US\$     | 13.03.2025       | Citibank NA                 | 3         | (1.625.186)                     | (1,43)               |
| 12.598 €   | 13.152 US\$         | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 2         | (67)                            | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 225.492 £  | 287.880 US\$        | 13.03.2025       | Citibank NA                 | 3         | (5.622)                         | (0,01)               |
| 93 US\$  | 74 £                | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | (0)                             | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen SEK</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 2.005.782 SEK  | 184.936 US\$        | 13.03.2025       | Goldman Sachs International | 5         | (2.726)                         | (0,00)               |
| 7 SEK  | 1 US\$              | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | (0)                             | (0,00)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>(2.500.151)</b>              | <b>(2,20)</b>        |

### Futures-Kontrakte (0,01 %) (31. Dezember 2023: (0,24 %))

| Anzahl Kontrakte  | Beschreibung                                    | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---|---------------------------------|----------------------|
| 20  | US Treasury 2-Year Note (CBT) Future March 2025 | (4.375)                         | (0,01)               |
| 5   | US Treasury 5-Year Note (CBT) Future March 2025 | (3.359)                         | (0,00)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten <sup>*</sup></b> |   | <b>(7.734)</b>                  | <b>(0,01)</b>        |

|   | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens |
|---|--------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(2.507.885)</b> | <b>(2,21)</b>        |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>109.903.243</b> | <b>96,64</b>         |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>3.817.385</b>   | <b>3,36</b>          |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>113.720.628</b> | <b>100,00</b>        |

| Portfolioanalyse  | US\$               | % des Gesamtvermögens |
|---|--------------------|-----------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 53.344.427         | 45,80                 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden            | 58.557.329         | 50,28                 |
| ± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden                          | 107.444            | 0,09                  |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente   | (2.105.957)        | (1,81)                |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>109.903.243</b> | <b>94,36</b>          |

## Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                      | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 27,43 % (31. Dezember 2023: 27,64 %)</b> |  |        |                       |                   |                              |
| <b>Euro</b>  |  |        |                       |                   |                              |
| 700.000  | Banque Ouest Africaine de Developpement*                   | 2,75 % | 22.01.2033            | 609.235           | 0,02                         |
| 8.012.647  | NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance Plc*               | 7,13 % | 19.07.2026            | 6.481.438         | 0,24                         |
| 20.129.000   | Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara* | 1,88 % | 05.11.2031            | 17.777.280        | 0,66                         |
| <b>Euro insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>24.867.953</b> | <b>0,92</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>   |  |        |                       |                   |                              |
| 2.072.000  | Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC*                          | 3,65 % | 02.11.2029            | 1.949.295         | 0,07                         |
| 21.027.000   | Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC*                          | 4,60 % | 02.11.2047            | 18.535.616        | 0,69                         |
| 5.628.000  | Abu Dhabi Developmental Holding Co PJSC*                   | 5,25 % | 02.10.2054            | 5.178.942         | 0,19                         |
| 3.684.000  | Abu Dhabi National Energy Co PJSC*                         | 4,70 % | 24.04.2033            | 3.559.103         | 0,13                         |
| 4.527.000  | Abu Dhabi Ports Co PJSC*                                   | 2,50 % | 06.05.2031            | 3.902.421         | 0,14                         |
| 6.086.000  | Adnoc Murban Rsc Ltd*                                      | 5,13 % | 11.09.2054            | 5.501.800         | 0,20                         |
| 5.620.000  | Aeropuerto Internacional de Tocumen SA**                   | 5,13 % | 11.08.2061            | 4.081.806         | 0,15                         |
| 3.195.000  | African Export-Import Bank*                                | 3,80 % | 17.05.2031            | 2.787.171         | 0,10                         |
| 3.962.176  | Alfa Desarrollo SpA**                                      | 4,55 % | 27.09.2051            | 2.923.535         | 0,11                         |
| 1.528.000  | AngloGold Ashanti Holdings Plc*                            | 3,75 % | 01.10.2030            | 1.382.939         | 0,05                         |
| 2.551.000  | Antofagasta Plc*   | 6,25 % | 02.05.2034            | 2.591.927         | 0,10                         |
| 3.283.000  | Banco Nacional de Panama*                                  | 2,50 % | 11.08.2030            | 2.614.989         | 0,10                         |
| 6.784.000  | Bancolombia SA*  | 8,63 % | 24.12.2034            | 7.109.520         | 0,26                         |
| 16.866.000   | Banque Ouest Africaine de Developpement*                   | 4,70 % | 22.10.2031            | 15.248.551        | 0,56                         |
| 12.145.000   | Banque Ouest Africaine de Developpement*                   | 5,00 % | 27.07.2027            | 11.825.738        | 0,44                         |
| 14.318.000   | Bapco Energies BSC Closed**                                | 7,50 % | 25.10.2027            | 14.756.976        | 0,55                         |
| 2.411.000  | Bidvest Group UK Plc*                                      | 3,63 % | 23.09.2026            | 2.317.417         | 0,09                         |
| 9.004.209  | Bioceanico Sovereign Certificate Ltd*                      | 0,00 % | 05.06.2034            | 6.960.254         | 0,26                         |
| 5.070.000  | Braskem Netherlands Finance BV**                           | 8,50 % | 12.01.2031            | 5.087.197         | 0,19                         |
| 5.334.800  | Brazil Minas SPE via State of Minas Gerais**               | 5,33 % | 15.02.2028            | 5.308.606         | 0,20                         |
| 556.000  | CAS Capital No 1 Ltd*                                      | 4,00 % | 31.12.2149            | 532.908           | 0,02                         |
| 3.254.000  | Cemex SAB de CV**  | 5,13 % | 31.12.2149            | 3.190.071         | 0,12                         |
| 7.156.000  | Cemex SAB de CV**  | 9,13 % | 31.12.2149            | 7.386.511         | 0,28                         |
| 3.016.000  | Cencosud SA*   | 4,38 % | 17.07.2027            | 2.949.071         | 0,11                         |
| 9.282.000  | Comision Federal de Electricidad*                          | 3,35 % | 09.02.2031            | 7.698.224         | 0,28                         |
| 8.419.000  | Comision Federal de Electricidad*                          | 4,69 % | 15.05.2029            | 7.912.232         | 0,29                         |
| 6.388.000  | Comision Federal de Electricidad**                         | 6,26 % | 15.02.2052            | 5.408.396         | 0,20                         |
| 4.489.000  | Comision Federal de Electricidad**                         | 6,45 % | 24.01.2035            | 4.241.956         | 0,16                         |
| 2.193.000  | Corp Nacional del Cobre de Chile*                          | 3,00 % | 30.09.2029            | 1.950.884         | 0,07                         |
| 6.749.000  | Corp Nacional del Cobre de Chile*                          | 3,15 % | 14.01.2030            | 6.011.956         | 0,23                         |
| 5.044.000  | Corp Nacional del Cobre de Chile*                          | 3,70 % | 30.01.2050            | 3.388.112         | 0,13                         |
| 1.373.000  | Corp Nacional del Cobre de Chile*                          | 4,38 % | 05.02.2049            | 1.039.797         | 0,04                         |
| 3.594.000  | Corp Nacional del Cobre de Chile*                          | 5,13 % | 02.02.2033            | 3.408.598         | 0,13                         |

## Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung  | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 27,43 % (31. Dezember 2023: 27,64 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |        |                       |                  |                              |
| 4.505.000  | Corp Nacional del Cobre de Chile*                                  | 5,95 % | 08.01.2034            | 4.483.818        | 0,17                         |
| 150.000  | Corp Nacional del Cobre de Chile*                                  | 6,15 % | 24.10.2036            | 149.885          | 0,01                         |
| 2.827.000  | Corp Nacional del Cobre de Chile*                                  | 6,30 % | 08.09.2053            | 2.771.461        | 0,10                         |
| 5.365.000  | Corp Nacional del Cobre de Chile**                                 | 6,44 % | 26.01.2036            | 5.478.675        | 0,20                         |
| 3.666.000  | CSN Resources SA**   | 4,63 % | 10.06.2031            | 2.849.721        | 0,11                         |
| 4.989.000  | CSN Resources SA**   | 8,88 % | 05.12.2030            | 4.972.547        | 0,18                         |
| 2.934.000  | CT Trust**   | 5,13 % | 03.02.2032            | 2.627.957        | 0,10                         |
| 7.200.000  | DP World Ltd*  | 6,85 % | 02.07.2037            | 7.850.203        | 0,29                         |
| 5.914.000  | Eastern & Southern African Trade & Development Bank*               | 4,13 % | 30.06.2028            | 5.315.192        | 0,20                         |
| 3.130.000  | Ecopetrol SA*  | 8,38 % | 19.01.2036            | 3.021.146        | 0,11                         |
| 5.395.000  | Ecopetrol SA*  | 8,88 % | 13.01.2033            | 5.501.650        | 0,20                         |
| 5.783.000  | Empresa de Transmision Electrica SA*                               | 5,13 % | 02.05.2049            | 4.133.775        | 0,15                         |
| 1.867.000  | Empresa Nacional del Petroleo**                                    | 3,45 % | 16.09.2031            | 1.606.087        | 0,06                         |
| 3.031.000  | Empresa Nacional del Petroleo**                                    | 4,50 % | 14.09.2047            | 2.350.702        | 0,09                         |
| 1.340.000  | Empresa Nacional del Petroleo*                                     | 4,50 % | 14.09.2047            | 1.039.241        | 0,04                         |
| 5.830.000  | Empresa Nacional del Petroleo*                                     | 5,25 % | 06.11.2029            | 5.757.183        | 0,21                         |
| 3.930.000  | Empresa Nacional del Petroleo**                                    | 5,95 % | 30.07.2034            | 3.912.307        | 0,14                         |
| 1.814.000  | Empresa Nacional del Petroleo*                                     | 6,15 % | 10.05.2033            | 1.833.767        | 0,07                         |
| 5.593.000  | FIEMEX Energia - Banco Actinver SA Institucion de Banca Multiple** | 7,25 % | 31.01.2041            | 5.485.055        | 0,20                         |
| 4.006.176  | Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd**                                 | 2,16 % | 31.03.2034            | 3.440.173        | 0,13                         |
| 8.304.000  | Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd*                                  | 2,63 % | 31.03.2036            | 6.774.945        | 0,25                         |
| 9.398.684  | Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd*                                  | 2,94 % | 30.09.2040            | 7.441.462        | 0,27                         |
| 7.940.850  | Greenko Power II Ltd*  | 4,30 % | 13.12.2028            | 7.485.210        | 0,28                         |
| 9.182.000  | Grupo Aval Ltd*  | 4,38 % | 04.02.2030            | 8.094.722        | 0,30                         |
| 2.633.000  | Kallpa Generacion SA*  | 4,13 % | 16.08.2027            | 2.559.117        | 0,09                         |
| 3.440.000  | KazMunayGas National Co JSC*                                       | 3,50 % | 14.04.2033            | 2.855.612        | 0,11                         |
| 28.427.000   | KazMunayGas National Co JSC*                                       | 5,38 % | 24.04.2030            | 27.708.401       | 1,02                         |
| 14.847.000   | KazMunayGas National Co JSC*                                       | 5,75 % | 19.04.2047            | 12.842.881       | 0,47                         |
| 11.634.000   | KazMunayGas National Co JSC*                                       | 6,38 % | 24.10.2048            | 10.833.145       | 0,40                         |
| 6.221.887  | Leviathan Bond Ltd*  | 6,75 % | 30.06.2030            | 5.901.578        | 0,22                         |
| 16.379.213   | MC Brazil Downstream Trading Sarl**                                | 7,25 % | 30.06.2031            | 13.624.936       | 0,50                         |
| 5.182.000  | Medco Bell Pte Ltd**   | 6,38 % | 30.01.2027            | 5.183.262        | 0,19                         |
| 2.334.000  | Meituan*   | 3,05 % | 28.10.2030            | 2.066.868        | 0,08                         |
| 3.734.000  | Mexico City Airport Trust*   | 5,50 % | 31.07.2047            | 3.017.945        | 0,11                         |
| 3.273.000  | MVM Energetika Zrt*  | 6,50 % | 13.03.2031            | 3.301.052        | 0,12                         |
| 4.865.000  | Navoi Mining & Metallurgical Combinat*                             | 6,95 % | 17.10.2031            | 4.810.015        | 0,18                         |
| 4.496.000  | NBK Tier 1 Financing 2 Ltd*  | 4,50 % | 31.12.2149            | 4.429.707        | 0,16                         |
| 3.167.000  | NWD MTN Ltd**  | 4,13 % | 18.07.2029            | 1.926.060        | 0,07                         |
| 2.675.000  | Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara*         | 4,38 % | 05.02.2050            | 2.005.224        | 0,07                         |

## Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung  | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|--------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 27,43 % (31. Dezember 2023: 27,64 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |        |                       |                    |                              |
| 8.423.000  | Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara <sup>*</sup> | 5,25 % | 15.05.2047            | 7.337.580          | 0,27                         |
| 15.682.000   | Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara <sup>*</sup> | 6,15 % | 21.05.2048            | 15.287.555         | 0,56                         |
| 11.455.000   | Petroleos de Venezuela SA <sup>*</sup>                                 | 5,38 % | 12.04.2027            | 1.248.595          | 0,05                         |
| 730.000  | Petroleos de Venezuela SA <sup>*</sup>                                 | 5,50 % | 12.04.2037            | 75.463             | 0,00                         |
| 38.698.964   | Petroleos de Venezuela SA <sup>*</sup>                                 | 6,00 % | 16.05.2024            | 4.064.911          | 0,15                         |
| 48.583.079   | Petroleos de Venezuela SA <sup>**</sup>                                | 6,00 % | 15.11.2026            | 5.103.132          | 0,19                         |
| 5.618.000  | Petroleos del Peru SA <sup>*</sup>                                     | 4,75 % | 19.06.2032            | 4.254.325          | 0,16                         |
| 25.851.000   | Petroleos del Peru SA <sup>*</sup>                                     | 5,63 % | 19.06.2047            | 16.591.498         | 0,61                         |
| 11.080.000   | Petroleos Mexicanos <sup>**</sup>                                      | 6,75 % | 21.09.2047            | 7.625.453          | 0,28                         |
| 10.255.000   | Petroleos Mexicanos <sup>**</sup>                                      | 6,95 % | 28.01.2060            | 7.049.180          | 0,26                         |
| 103.010.000  | Petroleos Mexicanos <sup>**</sup>                                      | 7,69 % | 23.01.2050            | 77.794.182         | 2,88                         |
| 3.706.000  | Power Finance Corp Ltd <sup>*</sup>                                    | 3,95 % | 23.04.2030            | 3.452.644          | 0,13                         |
| 4.096.000  | QatarEnergy <sup>*</sup>   | 3,30 % | 12.07.2051            | 2.807.857          | 0,10                         |
| 3.147.000  | QNB Finance Ltd <sup>*</sup>   | 2,75 % | 12.02.2027            | 3.005.778          | 0,11                         |
| 11.597.000   | Reliance Industries Ltd <sup>*</sup>                                   | 2,88 % | 12.01.2032            | 9.864.398          | 0,36                         |
| 3.611.000  | Reliance Industries Ltd <sup>*</sup>                                   | 3,63 % | 12.01.2052            | 2.496.245          | 0,09                         |
| 7.607.963  | Samarco Mineracao SA <sup>**</sup>                                     | 9,00 % | 30.06.2031            | 7.445.682          | 0,28                         |
| 10.610.000   | Sasol Financing USA LLC <sup>*</sup>                                   | 6,50 % | 27.09.2028            | 10.228.973         | 0,38                         |
| 5.969.000  | Sasol Financing USA LLC <sup>*</sup>                                   | 8,75 % | 03.05.2029            | 6.063.668          | 0,22                         |
| 6.794.000  | Saudi Arabian Oil Co <sup>*</sup>                                      | 4,25 % | 16.04.2039            | 5.827.917          | 0,22                         |
| 9.834.000  | Saudi Arabian Oil Co <sup>*</sup>                                      | 5,88 % | 17.07.2064            | 9.187.058          | 0,34                         |
| 47.692.000   | Southern Gas Corridor CJSC <sup>*</sup>                                | 6,88 % | 24.03.2026            | 48.364.338         | 1,79                         |
| 25.171.000   | State Oil Co of the Azerbaijan Republic <sup>*</sup>                   | 6,95 % | 18.03.2030            | 26.040.803         | 0,96                         |
| 4.484.000  | Suzano Austria GmbH <sup>**</sup>                                      | 7,00 % | 16.03.2047            | 4.722.028          | 0,18                         |
| 3.390.000  | Telecommunications co Telekom Srbija AD Belgrade <sup>**</sup>         | 7,00 % | 28.10.2029            | 3.386.576          | 0,12                         |
| 1.876.000  | Telecomunicaciones Digitales SA <sup>**</sup>                          | 4,50 % | 30.01.2030            | 1.706.853          | 0,06                         |
| 5.803.000  | Tencent Holdings Ltd <sup>*</sup>                                      | 3,24 % | 03.06.2050            | 3.855.913          | 0,14                         |
| 1.900.000  | Tengizchevroil Finance Co International Ltd <sup>**</sup>              | 2,63 % | 15.08.2025            | 1.861.465          | 0,07                         |
| 8.829.000  | Tengizchevroil Finance Co International Ltd <sup>**</sup>              | 3,25 % | 15.08.2030            | 7.513.709          | 0,28                         |
| 4.752.000  | Turkiye Vakiflar Bankasi TAO <sup>*</sup>                              | 6,50 % | 08.01.2026            | 4.798.130          | 0,18                         |
| 6.352.000  | Turkiye Vakiflar Bankasi TAO <sup>*</sup>                              | 9,00 % | 12.10.2028            | 6.781.516          | 0,25                         |
| 1.720.000  | Turkiye Varlik Fonu Yonetimi AS <sup>**</sup>                          | 8,25 % | 14.02.2029            | 1.791.649          | 0,07                         |
| 5.094.000  | TVF Varlik Kiralama AS <sup>*</sup>                                    | 6,95 % | 23.01.2030            | 5.127.111          | 0,19                         |
| 14.250   | Ukreximbank Via Biz Finance Plc <sup>**</sup>                          | 9,75 % | 22.01.2025            | 13.835             | 0,00                         |
| 450.000  | Vnesheconombank Via VEB Finance Plc <sup>*</sup>                       | 6,80 % | 22.11.2025            | 18.082             | 0,00                         |
| 7.434.000  | YPF SA <sup>**</sup>   | 9,50 % | 17.01.2031            | 7.958.164          | 0,29                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |  |        |                       | <b>716.937.472</b> | <b>26,51</b>                 |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>741.805.425</b> | <b>27,43</b>                 |

## Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                             | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|--------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 67,07 % (31. Dezember 2023: 67,71 %)</b> |   |        |                       |                    |                              |
| <b>Euro</b>  |   |        |                       |                    |                              |
| 9.836.300  | Argentine Republic Government International Bond* | 0,13 % | 09.07.2030            | 7.593.363          | 0,28                         |
| 1.008.000  | Bank Gospodarstwa Krajowego*                      | 0,50 % | 08.07.2031            | 876.099            | 0,03                         |
| 10.976.000   | Bank Gospodarstwa Krajowego*                      | 5,13 % | 22.02.2033            | 12.573.248         | 0,46                         |
| 1.825.000  | Benin Government International Bond*              | 4,88 % | 19.01.2032            | 1.718.456          | 0,06                         |
| 9.957.000  | Benin Government International Bond*              | 4,95 % | 22.01.2035            | 8.757.755          | 0,32                         |
| 1.367.000  | Benin Government International Bond*              | 6,88 % | 19.01.2052            | 1.194.014          | 0,04                         |
| 10.101.000   | Chile Government International Bond*              | 3,88 % | 09.07.2031            | 10.637.830         | 0,39                         |
| 10.344.000   | Egypt Government International Bond*              | 5,63 % | 16.04.2030            | 9.380.230          | 0,35                         |
| 30.743.000   | Egypt Government International Bond*              | 6,38 % | 11.04.2031            | 28.180.032         | 1,04                         |
| 600.000  | Indonesia Government International Bond*          | 1,00 % | 28.07.2029            | 559.573            | 0,02                         |
| 26.431.000   | Indonesia Government International Bond*          | 1,40 % | 30.10.2031            | 23.875.855         | 0,88                         |
| 5.886.000  | Indonesia Government International Bond*          | 3,65 % | 10.09.2032            | 6.121.893          | 0,23                         |
| 12.030.000   | Ivory Coast Government International Bond*        | 4,88 % | 30.01.2032            | 11.016.879         | 0,41                         |
| 19.259.000   | Ivory Coast Government International Bond*        | 5,25 % | 22.03.2030            | 18.910.386         | 0,70                         |
| 6.400.000  | Ivory Coast Government International Bond*        | 5,88 % | 17.10.2031            | 6.231.946          | 0,23                         |
| 22.372.000   | Ivory Coast Government International Bond*        | 6,63 % | 22.03.2048            | 18.767.871         | 0,69                         |
| 38.131.000   | Ivory Coast Government International Bond*        | 6,88 % | 17.10.2040            | 34.309.837         | 1,27                         |
| 4.371.000  | Magyar Export-Import Bank Zrt*                    | 4,50 % | 27.11.2031            | 4.599.917          | 0,17                         |
| 3.764.000  | Magyar Export-Import Bank Zrt*                    | 6,00 % | 16.05.2029            | 4.222.491          | 0,16                         |
| 26.275.000   | Peruvian Government International Bond*           | 1,25 % | 11.03.2033            | 22.215.138         | 0,82                         |
| 16.490.000   | Peruvian Government International Bond*           | 1,95 % | 17.11.2036            | 13.659.462         | 0,51                         |
| 6.862.000  | Peruvian Government International Bond*           | 3,75 % | 01.03.2030            | 7.177.041          | 0,27                         |
| 9.245.000  | Philippine Government International Bond*         | 1,75 % | 28.04.2041            | 6.929.320          | 0,26                         |
| 14.067.000   | Republic of Cameroon International Bond*          | 5,95 % | 07.07.2032            | 11.830.936         | 0,44                         |
| 6.642.000  | Republic of Poland Government International Bond* | 3,13 % | 22.10.2031            | 6.938.881          | 0,26                         |
| 2.314.000  | Romanian Government International Bond*           | 2,00 % | 28.01.2032            | 1.913.343          | 0,07                         |
| 14.163.000   | Romanian Government International Bond*           | 2,00 % | 14.04.2033            | 11.181.579         | 0,41                         |
| 817.000  | Romanian Government International Bond*           | 2,12 % | 16.07.2031            | 703.525            | 0,03                         |
| 955.000  | Romanian Government International Bond*           | 3,62 % | 26.05.2030            | 931.455            | 0,03                         |
| 36.654.000   | Romanian Government International Bond*           | 3,75 % | 07.02.2034            | 32.677.615         | 1,21                         |
| 20.041.000   | Romanian Government International Bond*           | 3,88 % | 29.10.2035            | 17.240.453         | 0,64                         |
| 6.262.000  | Romanian Government International Bond*           | 6,38 % | 18.09.2033            | 6.769.210          | 0,25                         |
| 6.507.000  | Senegal Government International Bond*            | 4,75 % | 13.03.2028            | 6.214.313          | 0,23                         |
| 6.660.000  | Senegal Government International Bond*            | 5,38 % | 08.06.2037            | 4.899.607          | 0,18                         |
| 17.389.000   | Serbia International Bond*                        | 1,65 % | 03.03.2033            | 14.492.261         | 0,54                         |
| 6.273.000  | Serbia International Bond*                        | 2,05 % | 23.09.2036            | 4.955.563          | 0,18                         |
| 11.251.000   | Turkiye Government International Bond*            | 5,88 % | 21.05.2030            | 12.252.870         | 0,45                         |
| <b>Euro insgesamt</b>                                      |   |        |                       | <b>392.510.247</b> | <b>14,51</b>                 |

## Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 67,07 % (31. Dezember 2023: 67,71 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 5.924.000  | Abu Dhabi Government International Bond <sup>†</sup>          | 2,70 % | 02.09.2070            | 3.241.591        | 0,12                         |
| 4.643.000  | Angolan Government International Bond <sup>†</sup>            | 8,25 % | 09.05.2028            | 4.375.186        | 0,16                         |
| 14.327.000   | Angolan Government International Bond <sup>†</sup>            | 8,75 % | 14.04.2032            | 12.694.707       | 0,47                         |
| 17.043.000   | Angolan Government International Bond <sup>†</sup>            | 9,38 % | 08.05.2048            | 14.022.980       | 0,52                         |
| 43.385.486   | Argentine Republic Government International Bond <sup>†</sup> | 0,75 % | 09.07.2030            | 33.545.658       | 1,24                         |
| 10.590.000   | Argentine Republic Government International Bond <sup>†</sup> | 1,00 % | 09.07.2029            | 8.625.555        | 0,32                         |
| 35.356.000   | Argentine Republic Government International Bond <sup>†</sup> | 3,50 % | 09.07.2041            | 22.156.485       | 0,82                         |
| 38.562.658   | Argentine Republic Government International Bond <sup>†</sup> | 4,13 % | 09.07.2035            | 25.669.451       | 0,95                         |
| 37.010.000   | Argentine Republic Government International Bond <sup>†</sup> | 4,13 % | 09.07.2046            | 24.647.661       | 0,91                         |
| 8.896.619  | Avenir Issuer III Ireland DAC <sup>*</sup>                    | 6,00 % | 22.03.2027            | 8.599.835        | 0,32                         |
| 12.307.000   | Bahamas Government International Bond <sup>†</sup>            | 6,00 % | 21.11.2028            | 11.783.953       | 0,44                         |
| 2.451.000  | Bahamas Government International Bond <sup>†</sup>            | 8,95 % | 15.10.2032            | 2.541.792        | 0,09                         |
| 4.706.000  | Bank Gospodarstwa Krajowego <sup>*</sup>                      | 5,38 % | 22.05.2033            | 4.599.162        | 0,17                         |
| 4.185.000  | Bank Gospodarstwa Krajowego <sup>**</sup>                     | 5,75 % | 09.07.2034            | 4.163.824        | 0,15                         |
| 1.807.000  | Bank Gospodarstwa Krajowego <sup>*</sup>                      | 6,25 % | 31.10.2028            | 1.880.464        | 0,07                         |
| 5.147.000  | Bank Gospodarstwa Krajowego <sup>**</sup>                     | 6,25 % | 09.07.2054            | 5.054.066        | 0,19                         |
| 1.674.000  | Bermuda Government International Bond <sup>†</sup>            | 2,38 % | 20.08.2030            | 1.428.759        | 0,05                         |
| 8.898.000  | Bermuda Government International Bond <sup>†</sup>            | 4,75 % | 15.02.2029            | 8.713.367        | 0,32                         |
| 11.244.000   | Bermuda Government International Bond <sup>†</sup>            | 5,00 % | 15.07.2032            | 10.872.948       | 0,40                         |
| 8.178.000  | Brazilian Government International Bond <sup>†</sup>          | 5,63 % | 07.01.2041            | 6.887.820        | 0,25                         |
| 5.586.000  | Brazilian Government International Bond <sup>†</sup>          | 5,63 % | 21.02.2047            | 4.399.721        | 0,16                         |
| 16.873.000   | Brazilian Government International Bond <sup>†</sup>          | 6,00 % | 20.10.2033            | 15.781.750       | 0,58                         |
| 11.920.000   | Brazilian Government International Bond <sup>†</sup>          | 6,13 % | 22.01.2032            | 11.425.103       | 0,42                         |
| 4.538.000  | Bulgaria Government International Bond <sup>†</sup>           | 5,00 % | 05.03.2037            | 4.274.433        | 0,16                         |
| 6.492.000  | Chile Government International Bond <sup>†</sup>              | 3,25 % | 21.09.2071            | 3.843.927        | 0,14                         |
| 19.146.000   | Colombia Government International Bond <sup>†</sup>           | 3,00 % | 30.01.2030            | 15.905.539       | 0,59                         |
| 14.003.000   | Colombia Government International Bond <sup>†</sup>           | 5,00 % | 15.06.2045            | 9.480.031        | 0,35                         |
| 4.348.000  | Colombia Government International Bond <sup>†</sup>           | 5,20 % | 15.05.2049            | 2.931.639        | 0,11                         |
| 7.245.000  | Colombia Government International Bond <sup>†</sup>           | 6,13 % | 18.01.2041            | 5.936.046        | 0,22                         |
| 34.697.000   | Colombia Government International Bond <sup>†</sup>           | 7,50 % | 02.02.2034            | 34.228.590       | 1,27                         |
| 8.673.000  | Colombia Government International Bond <sup>†</sup>           | 7,75 % | 07.11.2036            | 8.494.336        | 0,31                         |
| 8.603.000  | Colombia Government International Bond <sup>†</sup>           | 8,00 % | 20.04.2033            | 8.811.623        | 0,33                         |
| 4.876.000  | Colombia Government International Bond <sup>**</sup>          | 8,00 % | 14.11.2035            | 4.915.008        | 0,18                         |
| 7.347.000  | Colombia Government International Bond <sup>†</sup>           | 8,38 % | 07.11.2054            | 7.140.549        | 0,26                         |
| 3.615.000  | Colombia Government International Bond <sup>†</sup>           | 8,75 % | 14.11.2053            | 3.664.309        | 0,14                         |
| 1.043.000  | Corp Financiera de Desarrollo SA <sup>*</sup>                 | 2,40 % | 28.09.2027            | 966.334          | 0,04                         |
| 9.225.000  | Costa Rica Government International Bond <sup>†</sup>         | 6,55 % | 03.04.2034            | 9.396.815        | 0,35                         |
| 2.809.000  | Costa Rica Government International Bond <sup>†</sup>         | 7,00 % | 04.04.2044            | 2.898.186        | 0,11                         |
| 671.000  | Costa Rica Government International Bond <sup>†</sup>         | 7,16 % | 12.03.2045            | 692.472          | 0,03                         |
| 14.099.000   | Costa Rica Government International Bond <sup>†</sup>         | 7,30 % | 13.11.2054            | 14.638.287       | 0,54                         |

## Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                            | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 67,07 % (31. Dezember 2023: 67,71 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 3.677.000  | Development Bank of Kazakhstan JSC**             | 5,25 %  | 23.10.2029            | 3.661.367        | 0,14                         |
| 5.000.000  | Development Bank of Mongolia LLC*                | 11,00 % | 07.03.2026            | 5.206.250        | 0,19                         |
| 11.910.000   | Dominican Republic International Bond*           | 4,88 %  | 23.09.2032            | 10.659.450       | 0,39                         |
| 38.427.000   | Dominican Republic International Bond*           | 5,88 %  | 30.01.2060            | 32.595.702       | 1,21                         |
| 6.800.000  | Dominican Republic International Bond*           | 6,00 %  | 19.07.2028            | 6.752.400        | 0,25                         |
| 3.357.000  | Dominican Republic International Bond*           | 6,00 %  | 22.02.2033            | 3.232.791        | 0,12                         |
| 3.189.000  | Dominican Republic International Bond*           | 6,60 %  | 01.06.2036            | 3.171.461        | 0,12                         |
| 6.302.000  | Dominican Republic International Bond*           | 7,05 %  | 03.02.2031            | 6.469.003        | 0,24                         |
| 6.407.540  | Ecuador Government International Bond*           | 0,00 %  | 31.07.2030            | 3.517.896        | 0,13                         |
| 18.883.223   | Ecuador Government International Bond*           | 5,00 %  | 31.07.2040            | 9.744.121        | 0,36                         |
| 55.706.784   | Ecuador Government International Bond*           | 5,50 %  | 31.07.2035            | 31.778.119       | 1,17                         |
| 11.738.786   | Ecuador Government International Bond*           | 6,90 %  | 31.07.2030            | 8.204.083        | 0,30                         |
| 3.501.000  | Egypt Government International Bond*             | 7,90 %  | 21.02.2048            | 2.577.324        | 0,09                         |
| 36.350.000   | Egypt Government International Bond*             | 8,50 %  | 31.01.2047            | 28.293.768       | 1,05                         |
| 5.113.000  | Egypt Government International Bond*             | 8,70 %  | 01.03.2049            | 4.034.684        | 0,15                         |
| 24.194.000   | Egypt Government International Bond*             | 8,88 %  | 29.05.2050            | 19.372.045       | 0,72                         |
| 1.395.000  | El Salvador Government International Bond*       | 7,63 %  | 01.02.2041            | 1.299.966        | 0,05                         |
| 14.129.000   | El Salvador Government International Bond*       | 7,65 %  | 15.06.2035            | 13.694.533       | 0,51                         |
| 7.536.000  | El Salvador Government International Bond**      | 9,25 %  | 17.04.2030            | 7.997.580        | 0,30                         |
| 42.474.000   | El Salvador Government International Bond*       | 9,50 %  | 15.07.2052            | 44.421.433       | 1,64                         |
| 1.021.000  | El Salvador Government International Bond*       | 9,65 %  | 21.11.2054            | 1.078.176        | 0,04                         |
| 4.130.000  | Emirate of Dubai Government International Bonds* | 3,90 %  | 09.09.2050            | 3.005.928        | 0,11                         |
| 14.800.000   | Ethiopia International Bond*                     | 6,63 %  | 11.12.2024            | 11.806.996       | 0,44                         |
| 3.221.056  | Ghana Government International Bond*             | 0,00 %  | 03.07.2026            | 3.001.294        | 0,11                         |
| 4.177.497  | Ghana Government International Bond*             | 0,00 %  | 03.01.2030            | 3.246.479        | 0,12                         |
| 25.459.236   | Ghana Government International Bond*             | 5,00 %  | 03.07.2029            | 22.050.976       | 0,81                         |
| 35.028.984   | Ghana Government International Bond*             | 5,00 %  | 03.07.2035            | 24.717.940       | 0,91                         |
| 5.237.000  | Guatemala Government Bond*                       | 3,70 %  | 07.10.2033            | 4.246.552        | 0,16                         |
| 4.785.000  | Guatemala Government Bond*                       | 5,25 %  | 10.08.2029            | 4.609.151        | 0,17                         |
| 3.990.000  | Guatemala Government Bond*                       | 5,38 %  | 24.04.2032            | 3.774.540        | 0,14                         |
| 3.537.000  | Guatemala Government Bond**                      | 6,05 %  | 06.08.2031            | 3.464.492        | 0,13                         |
| 2.095.000  | Guatemala Government Bond**                      | 6,55 %  | 06.02.2037            | 2.061.480        | 0,08                         |
| 25.676.000   | Guatemala Government Bond*                       | 6,60 %  | 13.06.2036            | 25.444.916       | 0,94                         |
| 598.000  | Guatemala Government Bond*                       | 7,05 %  | 04.10.2032            | 619.902          | 0,02                         |
| 4.405.000  | Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS**         | 6,50 %  | 26.04.2030            | 4.359.671        | 0,16                         |
| 5.435.000  | Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS*          | 8,51 %  | 14.01.2029            | 5.808.783        | 0,21                         |
| 2.614.000  | Honduras Government International Bond*          | 5,63 %  | 24.06.2030            | 2.342.144        | 0,09                         |
| 468.000  | Honduras Government International Bond*          | 6,25 %  | 19.01.2027            | 455.072          | 0,02                         |
| 4.549.000  | Honduras Government International Bond**         | 8,63 %  | 27.11.2034            | 4.525.118        | 0,17                         |
| 3.602.375  | Iraq International Bond*                         | 5,80 %  | 15.01.2028            | 3.510.172        | 0,13                         |

## Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                           | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 67,07 % (31. Dezember 2023: 67,71 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 10.691.000   | Israel Government International Bond*           | 5,50 %  | 12.03.2034            | 10.483.702       | 0,39                         |
| 6.026.000  | Israel Government International Bond*           | 5,75 %  | 12.03.2054            | 5.520.566        | 0,20                         |
| 2.935.000  | Istanbul Metropolitan Municipality*             | 10,50 % | 06.12.2028            | 3.186.186        | 0,12                         |
| 986.322  | Ivory Coast Government International Bond*      | 5,75 %  | 31.12.2032            | 936.520          | 0,03                         |
| 45.992.000   | Lebanon Government International Bond*          | 6,38 %  | 09.03.2020            | 5.967.473        | 0,22                         |
| 14.872.000   | Lebanon Government International Bond*          | 6,65 %  | 26.02.2030            | 1.938.695        | 0,07                         |
| 6.112.000  | Lebanon Government International Bond*          | 6,85 %  | 25.05.2029            | 793.452          | 0,03                         |
| 83.325.000   | Lebanon Government International Bond*          | 8,25 %  | 17.05.2034            | 10.838.083       | 0,40                         |
| 31.170.000   | Mexico Government International Bond*           | 5,75 %  | 12.10.2110            | 23.972.861       | 0,89                         |
| 10.171.000   | Mongolia Government International Bond*         | 3,50 %  | 07.07.2027            | 9.504.207        | 0,35                         |
| 11.319.000   | Mongolia Government International Bond*         | 8,65 %  | 19.01.2028            | 11.921.737       | 0,44                         |
| 7.320.000  | Morocco Government International Bond*          | 3,00 %  | 15.12.2032            | 5.985.571        | 0,22                         |
| 4.201.000  | Morocco Government International Bond*          | 6,50 %  | 08.09.2033            | 4.338.698        | 0,16                         |
| 328.000  | Nigeria Government International Bond*          | 7,63 %  | 21.11.2025            | 327.180          | 0,01                         |
| 14.957.000   | Nigeria Government International Bond*          | 7,70 %  | 23.02.2038            | 12.222.644       | 0,45                         |
| 20.701.000   | Nigeria Government International Bond*          | 7,88 %  | 16.02.2032            | 18.666.790       | 0,69                         |
| 12.163.000   | Nigeria Government International Bond*          | 8,25 %  | 28.09.2051            | 9.723.072        | 0,36                         |
| 1.326.000  | Nigeria Government International Bond*          | 8,38 %  | 24.03.2029            | 1.290.828        | 0,05                         |
| 10.975.000   | Nigeria Government International Bond*          | 8,75 %  | 21.01.2031            | 10.582.633       | 0,39                         |
| 11.520.000   | Nigeria Government International Bond*          | 9,25 %  | 21.01.2049            | 10.452.473       | 0,39                         |
| 2.168.000  | Nigeria Government International Bond*          | 9,63 %  | 09.06.2031            | 2.166.360        | 0,08                         |
| 4.594.000  | Nigeria Government International Bond*          | 10,38 % | 09.12.2034            | 4.694.806        | 0,17                         |
| 34.538.000   | Oman Government International Bond*             | 6,75 %  | 17.01.2048            | 35.044.672       | 1,30                         |
| 8.165.000  | Oman Government International Bond*             | 7,00 %  | 25.01.2051            | 8.569.539        | 0,32                         |
| 7.835.000  | Panama Government International Bond*           | 2,25 %  | 29.09.2032            | 5.495.772        | 0,20                         |
| 2.425.000  | Panama Government International Bond*           | 3,87 %  | 23.07.2060            | 1.275.408        | 0,05                         |
| 748.000  | Panama Government International Bond*           | 4,50 %  | 16.04.2050            | 463.757          | 0,02                         |
| 15.513.000   | Panama Government International Bond*           | 4,50 %  | 01.04.2056            | 9.178.759        | 0,34                         |
| 1.893.000  | Panama Government International Bond*           | 4,50 %  | 19.01.2063            | 1.114.490        | 0,04                         |
| 15.238.000   | Panama Government International Bond*           | 6,40 %  | 14.02.2035            | 13.871.870       | 0,51                         |
| 6.728.000  | Panama Government International Bond*           | 6,70 %  | 26.01.2036            | 6.258.533        | 0,23                         |
| 3.389.000  | Panama Government International Bond**          | 7,50 %  | 01.03.2031            | 3.441.849        | 0,13                         |
| 5.015.000  | Panama Government International Bond**          | 8,00 %  | 01.03.2038            | 5.039.588        | 0,19                         |
| 8.224.000  | Papua New Guinea Government International Bond* | 8,38 %  | 04.10.2028            | 8.162.016        | 0,30                         |
| 4.730.000  | Paraguay Government International Bond*         | 3,85 %  | 28.06.2033            | 4.102.093        | 0,15                         |
| 4.175.000  | Paraguay Government International Bond*         | 5,40 %  | 30.03.2050            | 3.549.794        | 0,13                         |
| 11.692.000   | Paraguay Government International Bond*         | 5,60 %  | 13.03.2048            | 10.227.577       | 0,38                         |
| 3.740.000  | Paraguay Government International Bond*         | 6,10 %  | 11.08.2044            | 3.540.845        | 0,13                         |
| 6.425.878  | Provincia de Buenos Aires*                      | 6,63 %  | 01.09.2037            | 4.300.519        | 0,16                         |
| 216.003  | Provincia de Cordoba*                           | 6,88 %  | 10.12.2025            | 213.424          | 0,01                         |

## Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$     | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|--------|-----------------------|----------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 67,07 % (31. Dezember 2023: 67,71 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                      |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |        |                       |                      |                              |
| 23.857.000   | Qatar Government International Bond*                    | 4,82 % | 14.03.2049            | 21.606.468           | 0,80                         |
| 12.855.000   | Republic of Armenia International Bond*                 | 3,60 % | 02.02.2031            | 10.622.495           | 0,39                         |
| 4.360.000  | Republic of Azerbaijan International Bond*              | 3,50 % | 01.09.2032            | 3.699.778            | 0,14                         |
| 12.238.000   | Republic of Poland Government International Bond*       | 5,13 % | 18.09.2034            | 11.869.208           | 0,44                         |
| 6.102.000  | Republic of Poland Government International Bond*       | 5,50 % | 18.03.2054            | 5.625.269            | 0,21                         |
| 17.946.000   | Republic of South Africa Government International Bond* | 5,75 % | 30.09.2049            | 13.473.498           | 0,50                         |
| 12.477.000   | Republic of South Africa Government International Bond* | 7,10 % | 19.11.2036            | 12.180.549           | 0,45                         |
| 36.186.000   | Republic of South Africa Government International Bond* | 7,30 % | 20.04.2052            | 32.862.497           | 1,21                         |
| 5.596.000  | Republic of South Africa Government International Bond* | 7,95 % | 19.11.2054            | 5.375.948            | 0,20                         |
| 5.156.000  | Romanian Government International Bond*                 | 5,75 % | 24.03.2035            | 4.608.477            | 0,17                         |
| 4.750.000  | Serbia International Bond*                              | 2,13 % | 01.12.2030            | 3.865.869            | 0,14                         |
| 13.949.944   | Sri Lanka Government International Bond*                | 3,10 % | 15.01.2030            | 11.578.454           | 0,43                         |
| 27.362.578   | Sri Lanka Government International Bond*                | 3,35 % | 15.03.2033            | 20.831.131           | 0,77                         |
| 18.476.035   | Sri Lanka Government International Bond*                | 3,60 % | 15.06.2035            | 13.395.125           | 0,49                         |
| 12.822.796   | Sri Lanka Government International Bond*                | 3,60 % | 15.05.2036            | 9.777.382            | 0,36                         |
| 25.656.372   | Sri Lanka Government International Bond*                | 3,60 % | 15.02.2038            | 19.660.478           | 0,73                         |
| 17.116.285   | Sri Lanka Government International Bond*                | 4,00 % | 15.04.2028            | 16.068.769           | 0,59                         |
| 13.620.000   | Turkiye Government International Bond*                  | 6,50 % | 03.01.2035            | 12.756.969           | 0,47                         |
| 10.603.000   | Turkiye Government International Bond*                  | 7,63 % | 15.05.2034            | 10.788.155           | 0,40                         |
| 16.411.000   | Turkiye Government International Bond*                  | 9,13 % | 13.07.2030            | 18.172.187           | 0,67                         |
| 6.063.000  | Turkiye Government International Bond*                  | 9,38 % | 14.03.2029            | 6.697.220            | 0,25                         |
| 3.324.000  | Turkiye Ihracat Kredi Bankasi AS**                      | 7,50 % | 06.02.2028            | 3.391.040            | 0,13                         |
| 4.502.000  | Turkiye Ihracat Kredi Bankasi AS*                       | 9,38 % | 31.01.2026            | 4.684.867            | 0,17                         |
| 1.912.034  | Ukraine Government International Bond*                  | 0,00 % | 01.02.2030            | 1.049.707            | 0,04                         |
| 7.144.987  | Ukraine Government International Bond*                  | 0,00 % | 01.02.2034            | 2.974.235            | 0,11                         |
| 6.038.017  | Ukraine Government International Bond*                  | 0,00 % | 01.02.2035            | 3.580.431            | 0,13                         |
| 8.831.678  | Ukraine Government International Bond*                  | 0,00 % | 01.02.2036            | 5.209.961            | 0,19                         |
| 11.887.000   | Ukraine Government International Bond*                  | 0,00 % | 01.08.2041            | 9.204.906            | 0,34                         |
| 2.663.618  | Ukraine Government International Bond*                  | 1,75 % | 01.02.2029            | 1.858.316            | 0,07                         |
| 12.710.538   | Ukraine Government International Bond*                  | 1,75 % | 01.02.2034            | 7.197.342            | 0,27                         |
| 11.465.385   | Ukraine Government International Bond*                  | 1,75 % | 01.02.2035            | 6.331.541            | 0,23                         |
| 9.323.472  | Ukraine Government International Bond*                  | 1,75 % | 01.02.2036            | 5.075.791            | 0,19                         |
| 10.314.000   | Uzbekneftegaz JSC*                                      | 4,75 % | 16.11.2028            | 9.087.339            | 0,34                         |
| 32.118.500   | Venezuela Government International Bond*                | 8,25 % | 13.10.2024            | 4.536.738            | 0,17                         |
| 25.134.185   | Zambia Government International Bond*                   | 0,50 % | 31.12.2053            | 14.427.870           | 0,53                         |
| 24.662.162   | Zambia Government International Bond*                   | 5,75 % | 30.06.2033            | 21.683.127           | 0,80                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |   |        |                       | <b>1.421.317.899</b> | <b>52,56</b>                 |
| <b>Staatsanleihen insgesamt</b>  |   |        |                       | <b>1.813.828.146</b> | <b>67,07</b>                 |

## Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag  | Wertpapierbezeichnung   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$     | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|---|---|--------|-----------------------|----------------------|------------------------------|
| <b>Pensionsgeschäfte 2,22 % (31. Dezember 2023: 0,00 %)</b> |   |        |                       |                      |                              |
| <b>US-Dollar</b>  |   |        |                       |                      |                              |
| 60.000.000  | State Street Bank and Trust Co, repurchase value US\$ 60,014,767^ | 4,43 % | 02.01.2025            | 60.000.000           | 2,22                         |
| <b>Pensionsgeschäfte insgesamt <sup>†</sup></b>             |   |        |                       | <b>60.000.000</b>    | <b>2,22</b>                  |
| <b>Anlagen insgesamt</b>                                    |   |        |                       | <b>2.615.633.571</b> | <b>96,72</b>                 |

^ Besichert über US-Schatz-/Staatsanleihen mit einem Wert von insgesamt USD 61.200.145.

### Devisenterminkontrakte 0,33 % (31. Dezember 2023: 0,94 %)

| Geforderter<br>Betrag   | Zu zahlender<br>Betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|---|------------------------|-----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------------|------------------------------|
| 507.208.350 US\$  | 481.336.604 €          | 04.02.2025            | HSBC Bank Plc               | 1         | 8.129.493                            | 0,30                         |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i>   |                        |                       |                             |           |                                      |                              |
| 2.478 US\$  | 3.889 AUD              | 13.03.2025            | UBS AG                      | 1         | 70                                   | 0,00                         |
| 5.432 US\$  | 8.674 AUD              | 13.03.2025            | Westpac Banking Corp        | 2         | 61                                   | 0,00                         |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i>   |                        |                       |                             |           |                                      |                              |
| 1.076.116 US\$  | 951.081 CHF            | 13.03.2025            | Goldman Sachs International | 1         | 18.606                               | 0,00                         |
| 748.812 US\$  | 662.499 CHF            | 13.03.2025            | UBS AG                      | 1         | 12.177                               | 0,00                         |
| 706.127 US\$  | 629.084 CHF            | 13.03.2025            | Westpac Banking Corp        | 13        | 6.646                                | 0,00                         |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>   |                        |                       |                             |           |                                      |                              |
| 5.941.327 US\$  | 5.668.540 €            | 13.03.2025            | UBS AG                      | 1         | 53.953                               | 0,00                         |
| 13.943.992 US\$   | 13.311.726 €           | 13.03.2025            | Westpac Banking Corp        | 16        | 118.367                              | 0,01                         |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>   |                        |                       |                             |           |                                      |                              |
| 342.268 US\$  | 271.746 £              | 13.03.2025            | Goldman Sachs International | 1         | 2.111                                | 0,00                         |
| 239.892 US\$  | 189.153 £              | 13.03.2025            | UBS AG                      | 1         | 3.121                                | 0,00                         |
| 895.570 US\$  | 709.731 £              | 13.03.2025            | Westpac Banking Corp        | 17        | 7.165                                | 0,00                         |
| <i>Abgesicherte Klassen HKD</i>   |                        |                       |                             |           |                                      |                              |
| 3.751.424 HKD   | 483.167 US\$           | 13.03.2025            | Citibank NA                 | 5         | 187                                  | 0,00                         |
| 324.479 HKD   | 41.788 US\$            | 13.03.2025            | Westpac Banking Corp        | 11        | 21                                   | 0,00                         |
| 3 US\$  | 25 HKD                 | 13.03.2025            | Westpac Banking Corp        | 1         | 0                                    | 0,00                         |
| <i>Abgesicherte Klassen JPY</i>   |                        |                       |                             |           |                                      |                              |
| 171.204 US\$  | 26.320.997 ¥           | 13.03.2025            | Westpac Banking Corp        | 2         | 2.375                                | 0,00                         |
| <i>Abgesicherte Klassen SEK</i>   |                        |                       |                             |           |                                      |                              |
| 1.099.449 US\$  | 11.982.846 SEK         | 13.03.2025            | Goldman Sachs International | 4         | 10.901                               | 0,00                         |
| 57.919.462 US\$   | 630.581.934 SEK        | 13.03.2025            | Westpac Banking Corp        | 7         | 636.002                              | 0,02                         |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>   |                        |                       |                             |           |                                      |                              |
| 250.354 US\$  | 336.656 SGD            | 13.03.2025            | Goldman Sachs International | 1         | 2.889                                | 0,00                         |
| 5.236.844 US\$  | 7.017.011 SGD          | 13.03.2025            | Westpac Banking Corp        | 16        | 78.866                               | 0,00                         |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                        |                       |                             |           | <b>9.083.011</b>                     | <b>0,33</b>                  |

## Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Futures-Kontrakte 0,29 % (31. Dezember 2023: 0,74 %)

| Anzahl Kontrakte  | Beschreibung                                    | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---|--------------------------------|----------------------|
| (1.389)   | Euro-Bund Future March 2025                     | 4.941.323                      | 0,18                 |
| (315)   | Euro-Buxl 30-Year Bond Future March 2025        | 2.798.412                      | 0,11                 |
| 433   | US Treasury 2-Year Note (CBT) Future March 2025 | 50.743                         | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten *</b> |   | <b>7.790.478</b>               | <b>0,29</b>          |

### Credit-Default-Swap-Kontrakten 0,13 % (31. Dezember 2023: 0,00 %)

| Nominalwert  | Fälligkeit | Gegenpartei                 | Referenzverbindlichkeit                   | Zeitwert US\$    | % des Nettovermögens |
|--|------------|-----------------------------|---|------------------|----------------------|
| USD 110.327.000  | 20.12.2029 | ICE Clear U.S. <sup>1</sup> | Buying default protection on CDX.EM.42.V1 | 3.456.849        | 0,13                 |
| <b>Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt *</b> |            |                             |   | <b>3.456.849</b> | <b>0,13</b>          |

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

|  |  |  |  | Zeitwert US\$        | % des Nettovermögens |
|--|--|--|--|----------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |  |  |  | <b>2.635.963.909</b> | <b>97,47</b>         |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (0,81 %) (31. Dezember 2023: (0,21 %))

| Geforderter Betrag              | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 303.397 AUD                     | 196.048 US\$        | 13.03.2025       | UBS AG                      | 2         | (8.183)                         | (0,00)               |
| 295.093 AUD                     | 190.618 US\$        | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | (7.894)                         | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i> |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 902.044 CHF                     | 1.038.415 US\$      | 13.03.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (35.429)                        | (0,00)               |
| 106.216.701 CHF                 | 122.171.371 US\$    | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 15        | (4.068.699)                     | (0,15)               |
| 47.578 US\$                     | 42.806 CHF          | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 2         | (18)                            | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 621.247.318 €                   | 659.783.861 US\$    | 13.03.2025       | Citibank NA                 | 5         | (14.553.324)                    | (0,54)               |
| 10.526.162 €                    | 11.105.405 US\$     | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 13        | (172.881)                       | (0,01)               |
| 142.060 US\$                    | 136.788 €           | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 2         | (9)                             | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 29.921.027 £                    | 38.200.128 US\$     | 13.03.2025       | Citibank NA                 | 5         | (746.597)                       | (0,03)               |
| 17.904 £                        | 22.739 US\$         | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 8         | (327)                           | (0,00)               |
| 238.598 US\$                    | 190.683 £           | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 6         | (91)                            | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen HKD</i> |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 2.677 HKD                       | 346 US\$            | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 3         | (0)                             | (0,00)               |
| 15.441 US\$                     | 119.917 HKD         | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 5         | (10)                            | (0,00)               |

## Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (0,81 %) (31. Dezember 2023: (0,21 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen JPY</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 840.089.034 ¥  | 5.635.201 US\$      | 13.03.2025       | Goldman Sachs International | 2         | (246.670)                       | (0,01)               |
| 853.106.509 ¥  | 5.722.850 US\$      | 13.03.2025       | UBS AG                      | 3         | (250.822)                       | (0,01)               |
| 55.903 US\$  | 8.727.594 ¥         | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | (77)                            | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen SEK</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 111.099.949 SEK  | 10.240.590 US\$     | 13.03.2025       | Citibank NA                 | 1         | (148.025)                       | (0,00)               |
| 710.550.936 SEK  | 65.517.239 US\$     | 13.03.2025       | Goldman Sachs International | 4         | (969.218)                       | (0,03)               |
| 1.481.164 SEK  | 136.416 US\$        | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 11        | (1.865)                         | (0,00)               |
| 3.485 US\$   | 38.386 SEK          | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 2         | (1)                             | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 550.527 SGD  | 412.897 US\$        | 13.03.2025       | Citibank NA                 | 1         | (8.223)                         | (0,00)               |
| 54.284.299 SGD   | 40.708.274 US\$     | 13.03.2025       | Goldman Sachs International | 4         | (805.642)                       | (0,03)               |
| 2.167.371 SGD  | 1.601.398 US\$      | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 15        | (8.232)                         | (0,00)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>(22.032.237)</b>             | <b>(0,81)</b>        |

### Futures-Kontrakte (0,16 %) (31. Dezember 2023: (0,39 %))

| Anzahl Kontrakte  | Beschreibung                                     | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|--|---------------------------------|----------------------|
| 79  | Euro-BOBL Future March 2025                      | (111.254)                       | (0,01)               |
| 2   | Euro-Schatz Future March 2025                    | (766)                           | (0,00)               |
| 915   | US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2025 | (1.157.110)                     | (0,04)               |
| 1.536   | US Treasury 5-Year Note (CBT) Future March 2025  | (695.999)                       | (0,03)               |
| 726   | US Treasury Long Bond (CBT) Future March 2025    | (1.917.094)                     | (0,07)               |
| 87  | US Treasury Ultra Bond (CBT) Future March 2025   | (335.235)                       | (0,01)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten <sup>±</sup></b> |  | <b>(4.217.458)</b>              | <b>(0,16)</b>        |

|   | Zeitwert US\$        | % des Nettovermögens |
|---|----------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(26.249.695)</b>  | <b>(0,97)</b>        |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>2.609.714.214</b> | <b>96,50</b>         |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>94.724.380</b>    | <b>3,50</b>          |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>2.704.438.594</b> | <b>100,00</b>        |

| Portfolioanalyse  | US\$                 | % des Gesamtvermögens |
|---|----------------------|-----------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 2.263.744.044        | 82,62                 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden            | 291.889.527          | 10,66                 |
| † Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente  | 60.000.000           | 2,19                  |
| ± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden                          | 3.573.020            | 0,13                  |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente   | (9.492.377)          | (0,35)                |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>2.609.714.214</b> | <b>95,25</b>          |

## Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                           | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 5,19 % (31. Dezember 2023: 3,25 %)</b> |   |         |                       |                   |                              |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi</b>                              |   |         |                       |                   |                              |
| 10.000.000   | Central Huijin Investment Ltd**                 | 2,02 %  | 05.09.2027            | 1.372.972         | 0,13                         |
| 50.000.000   | Central Huijin Investment Ltd**                 | 2,07 %  | 30.07.2029            | 6.875.022         | 0,64                         |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt</b>                    |   |         |                       | <b>8.247.994</b>  | <b>0,77</b>                  |
| <b>Kolumbianischer Peso</b>                                    |   |         |                       |                   |                              |
| 21.424.000.000   | Asian Development Bank*                         | 10,10 % | 23.01.2026            | 4.891.044         | 0,45                         |
| 10.188.000.000   | Asian Development Bank*                         | 11,20 % | 31.01.2025            | 2.314.393         | 0,22                         |
| 18.145.000.000   | Asian Development Bank*                         | 12,75 % | 03.03.2025            | 4.132.270         | 0,38                         |
| 10.000.000.000   | Asian Development Bank*                         | 13,00 % | 07.03.2025            | 2.278.835         | 0,21                         |
| 41.202.000.000   | Empresas Publicas de Medellin ESP*              | 8,38 %  | 08.11.2027            | 8.359.060         | 0,78                         |
| 15.550.000.000   | International Finance Corp*                     | 0,00 %  | 16.08.2028            | 2.479.753         | 0,23                         |
| <b>Kolumbianischer Peso insgesamt</b>                          |   |         |                       | <b>24.455.355</b> | <b>2,27</b>                  |
| <b>Indische Rupie</b>  |   |         |                       |                   |                              |
| 255.400.000  | Asian Infrastructure Investment Bank*           | 7,20 %  | 02.07.2031            | 3.008.124         | 0,28                         |
| <b>Indische Rupie insgesamt</b>                                |   |         |                       | <b>3.008.124</b>  | <b>0,28</b>                  |
| <b>Mexikanischer Peso</b>                                      |   |         |                       |                   |                              |
| 51.000.000   | Asian Development Bank*                         | 0,00 %  | 20.04.2043            | 418.223           | 0,04                         |
| 102.700.000  | Asian Infrastructure Investment Bank*           | 0,00 %  | 08.02.2038            | 1.349.000         | 0,13                         |
| 72.618.300   | Comision Federal de Electricidad*               | 7,35 %  | 25.11.2025            | 3.390.327         | 0,31                         |
| 62.682.200   | Comision Federal de Electricidad*               | 8,18 %  | 23.12.2027            | 2.793.044         | 0,26                         |
| <b>Mexikanischer Peso insgesamt</b>                            |   |         |                       | <b>7.950.594</b>  | <b>0,74</b>                  |
| <b>Pakistanische Rupie</b>                                     |   |         |                       |                   |                              |
| 1.800.000.000  | Citigroup Global Markets Holdings Inc*          | 0,00 %  | 13.01.2025            | 6.447.152         | 0,60                         |
| 1.600.000.000  | Citigroup Global Markets Holdings Inc**         | 0,00 %  | 13.01.2025            | 5.730.802         | 0,53                         |
| <b>Pakistanische Rupie insgesamt</b>                           |   |         |                       | <b>12.177.954</b> | <b>1,13</b>                  |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>                          |   |         |                       | <b>55.840.021</b> | <b>5,19</b>                  |
| <b>Staatsanleihen 90,56 % (31. Dezember 2023: 87,45 %)</b>     |   |         |                       |                   |                              |
| <b>Chilenischer Peso</b>                                       |   |         |                       |                   |                              |
| 3.380.886.960  | Bonos de la Tesoreria de la Republica*          | 1,90 %  | 01.09.2030            | 3.283.746         | 0,31                         |
| 2.055.000.000  | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 2,80 %  | 01.10.2033            | 1.651.914         | 0,15                         |
| 3.920.000.000  | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 4,70 %  | 01.09.2030            | 3.792.786         | 0,35                         |
| 2.335.000.000  | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 5,00 %  | 01.03.2035            | 2.233.107         | 0,21                         |
| 445.000.000  | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 5,10 %  | 15.07.2050            | 430.290           | 0,04                         |
| 2.115.000.000  | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 6,00 %  | 01.04.2033            | 2.169.217         | 0,20                         |
| 3.570.000.000  | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 7,00 %  | 01.05.2034            | 3.942.706         | 0,37                         |
| <b>Chilenischer Peso insgesamt</b>                             |   |         |                       | <b>17.503.766</b> | <b>1,63</b>                  |

## Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung    | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--------------------------|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 90,56 % (31. Dezember 2023: 87,45 %) (Fortsetzung)</b> |                          |         |                       |                   |                              |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi</b>  |                          |         |                       |                   |                              |
| 50.000.000   | China Development Bank** | 2,52 %  | 25.05.2028            | 7.057.281         | 0,66                         |
| 50.000.000   | China Development Bank** | 2,69 %  | 16.06.2027            | 7.025.618         | 0,65                         |
| 50.000.000   | China Development Bank** | 2,73 %  | 11.01.2028            | 7.077.382         | 0,66                         |
| 20.000.000   | China Development Bank** | 2,98 %  | 22.04.2032            | 2.959.808         | 0,27                         |
| 10.000.000   | China Development Bank** | 3,02 %  | 06.03.2033            | 1.490.481         | 0,14                         |
| 10.000.000   | China Development Bank** | 3,48 %  | 08.01.2029            | 1.467.765         | 0,14                         |
| 20.000.000   | China Development Bank** | 3,70 %  | 20.10.2030            | 3.040.282         | 0,28                         |
| 40.000.000   | China Development Bank** | 4,04 %  | 06.07.2028            | 5.930.690         | 0,55                         |
| 20.000.000   | China Development Bank** | 4,24 %  | 24.08.2027            | 2.924.167         | 0,27                         |
| 33.610.000   | China Government Bond**  | 2,05 %  | 15.04.2029            | 4.704.072         | 0,44                         |
| 40.000.000   | China Government Bond**  | 2,11 %  | 25.08.2034            | 5.659.334         | 0,53                         |
| 57.000.000   | China Government Bond**  | 2,12 %  | 25.06.2031            | 8.023.980         | 0,75                         |
| 10.000.000   | China Government Bond**  | 2,19 %  | 25.09.2054            | 1.448.816         | 0,13                         |
| 4.000.000  | China Government Bond**  | 2,25 %  | 29.08.2039            | 566.099           | 0,05                         |
| 20.190.000   | China Government Bond**  | 2,28 %  | 25.03.2031            | 2.865.118         | 0,27                         |
| 5.000.000  | China Government Bond**  | 2,33 %  | 15.08.2044            | 719.137           | 0,07                         |
| 8.120.000  | China Government Bond**  | 2,47 %  | 25.07.2054            | 1.229.640         | 0,11                         |
| 6.760.000  | China Government Bond**  | 2,60 %  | 15.09.2030            | 973.511           | 0,09                         |
| 20.000.000   | China Government Bond**  | 2,62 %  | 25.09.2029            | 2.872.571         | 0,27                         |
| 10.000.000   | China Government Bond**  | 2,67 %  | 25.05.2033            | 1.465.211         | 0,14                         |
| 7.000.000  | China Government Bond**  | 2,69 %  | 15.08.2032            | 1.022.722         | 0,09                         |
| 10.000.000   | China Government Bond**  | 2,88 %  | 25.02.2033            | 1.486.091         | 0,14                         |
| 22.000.000   | China Government Bond**  | 3,02 %  | 27.05.2031            | 3.267.912         | 0,30                         |
| 30.000.000   | China Government Bond**  | 3,13 %  | 21.11.2029            | 4.429.075         | 0,41                         |
| 10.940.000   | China Government Bond**  | 3,19 %  | 15.04.2053            | 1.876.084         | 0,17                         |
| 5.000.000  | China Government Bond**  | 3,29 %  | 23.05.2029            | 740.623           | 0,07                         |
| 45.500.000   | China Government Bond**  | 3,72 %  | 12.04.2051            | 8.375.926         | 0,78                         |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt</b>                              |                          |         |                       | <b>90.699.396</b> | <b>8,43</b>                  |
| <b>Kolumbianischer Peso</b>  |                          |         |                       |                   |                              |
| 21.118.400.000   | Colombian TES*           | 5,75 %  | 03.11.2027            | 4.299.170         | 0,40                         |
| 81.167.900.000   | Colombian TES*           | 6,00 %  | 28.04.2028            | 16.216.931        | 1,51                         |
| 21.584.900.000   | Colombian TES Series B*  | 7,00 %  | 26.03.2031            | 4.023.526         | 0,37                         |
| 25.028.700.000   | Colombian TES*           | 7,00 %  | 30.06.2032            | 4.442.354         | 0,41                         |
| 26.308.300.000   | Colombian TES*           | 7,25 %  | 18.10.2034            | 4.450.313         | 0,41                         |
| 26.457.200.000   | Colombian TES*           | 7,75 %  | 18.09.2030            | 5.223.329         | 0,49                         |
| 21.369.500.000   | Colombian TES*           | 9,25 %  | 28.05.2042            | 3.755.509         | 0,35                         |
| 39.082.500.000   | Colombian TES*           | 13,25 % | 09.02.2033            | 9.596.315         | 0,89                         |

## Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                  | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 90,56 % (31. Dezember 2023: 87,45 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                   |                              |
| <b>Kolumbianischer Peso (Fortsetzung)</b>                                |  |         |                       |                   |                              |
| 10.400.100.000   | Colombian TES Series G <sup>*</sup>                    | 7,00 %  | 26.03.2031            | 1.938.627         | 0,18                         |
|  | <b>Kolumbianischer Peso insgesamt</b>                  |         |                       | <b>53.946.074</b> | <b>5,01</b>                  |
| <b>Costa Rican Colón</b>   |  |         |                       |                   |                              |
| 607.750.000  | Costa Rica Government International Bond <sup>**</sup> | 10,58 % | 26.09.2029            | 1.417.150         | 0,13                         |
|  | <b>Total Costa Rican Colón</b>                         |         |                       | <b>1.417.150</b>  | <b>0,13</b>                  |
| <b>Tschechische Krone</b>  |  |         |                       |                   |                              |
| 430.810.000  | Czech Republic Government Bond <sup>*</sup>            | 0,95 %  | 15.05.2030            | 15.306.945        | 1,42                         |
| 364.240.000  | Czech Republic Government Bond <sup>*</sup>            | 1,20 %  | 13.03.2031            | 12.792.228        | 1,19                         |
| 39.810.000   | Czech Republic Government Bond <sup>*</sup>            | 1,50 %  | 24.04.2040            | 1.118.604         | 0,10                         |
| 96.070.000   | Czech Republic Government Bond <sup>*</sup>            | 1,75 %  | 23.06.2032            | 3.405.726         | 0,32                         |
| 34.130.000   | Czech Republic Government Bond <sup>*</sup>            | 1,95 %  | 30.07.2037            | 1.087.355         | 0,10                         |
| 79.870.000   | Czech Republic Government Bond <sup>*</sup>            | 2,00 %  | 13.10.2033            | 2.789.032         | 0,26                         |
| 35.400.000   | Czech Republic Government Bond <sup>*</sup>            | 4,20 %  | 04.12.2036            | 1.451.204         | 0,13                         |
| 52.940.000   | Czech Republic Government Bond <sup>*</sup>            | 4,90 %  | 14.04.2034            | 2.316.609         | 0,22                         |
| 22.740.000   | Czech Republic Government Bond <sup>*</sup>            | 5,00 %  | 30.09.2030            | 991.723           | 0,09                         |
|  | <b>Tschechische Krone insgesamt</b>                    |         |                       | <b>41.259.426</b> | <b>3,83</b>                  |
| <b>Peso Dominikanische Republik</b>                                      |  |         |                       |                   |                              |
| 152.700.000  | Dominican Republic International Bond <sup>*</sup>     | 9,75 %  | 05.06.2026            | 2.519.031         | 0,23                         |
| 546.650.000  | Dominican Republic International Bond <sup>*</sup>     | 10,75 % | 01.06.2036            | 9.704.694         | 0,90                         |
| 236.100.000  | Dominican Republic International Bond <sup>*</sup>     | 11,25 % | 15.09.2035            | 4.252.286         | 0,40                         |
| 42.800.000   | Dominican Republic International Bond <sup>*</sup>     | 13,63 % | 03.02.2033            | 858.772           | 0,08                         |
|  | <b>Peso Dominikanische Republik insgesamt</b>          |         |                       | <b>17.334.783</b> | <b>1,61</b>                  |
| <b>Ägyptisches Pfund</b>   |  |         |                       |                   |                              |
| 800.000.000  | Egypt Government Bond <sup>*</sup>                     | 25,32 % | 13.08.2027            | 15.612.449        | 1,45                         |
|  | <b>Ägyptisches Pfund insgesamt</b>                     |         |                       | <b>15.612.449</b> | <b>1,45</b>                  |
| <b>Ghanaischer Cedi</b>  |  |         |                       |                   |                              |
| 7.774.695  | Republic of Ghana Government Bonds <sup>*</sup>        | 8,35 %  | 16.02.2027            | 394.555           | 0,04                         |
| 7.791.913  | Republic of Ghana Government Bonds <sup>*</sup>        | 8,50 %  | 15.02.2028            | 345.948           | 0,03                         |
| 7.288.544  | Republic of Ghana Government Bonds <sup>*</sup>        | 8,65 %  | 13.02.2029            | 288.887           | 0,03                         |
| 7.304.662  | Republic of Ghana Government Bonds <sup>*</sup>        | 8,80 %  | 12.02.2030            | 262.259           | 0,03                         |
| 7.320.803  | Republic of Ghana Government Bonds <sup>*</sup>        | 8,95 %  | 11.02.2031            | 243.258           | 0,02                         |
| 7.336.967  | Republic of Ghana Government Bonds <sup>*</sup>        | 9,10 %  | 10.02.2032            | 230.065           | 0,02                         |

## Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 90,56 % (31. Dezember 2023: 87,45 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                   |                              |
| <b>Ghanaischer Cedi (Fortsetzung)</b>                                    |  |        |                       |                   |                              |
| 7.353.156  | Republic of Ghana Government Bonds*                  | 9,25 % | 08.02.2033            | 216.530           | 0,02                         |
| <b>Ghanaischer Cedi insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>1.981.502</b>  | <b>0,19</b>                  |
| <b>Ungarischer Forint</b>  |  |        |                       |                   |                              |
| 2.765.060.000  | Hungary Government Bond*                             | 3,00 % | 27.10.2027            | 6.392.516         | 0,59                         |
| 712.080.000  | Hungary Government Bond*                             | 3,25 % | 22.10.2031            | 1.506.066         | 0,14                         |
| 1.268.750.000  | Hungary Government Bond*                             | 4,50 % | 23.03.2028            | 3.033.491         | 0,28                         |
| 4.717.060.000  | Hungary Government Bond*                             | 4,75 % | 24.11.2032            | 10.599.103        | 0,99                         |
| <b>Ungarischer Forint insgesamt</b>                                      |  |        |                       | <b>21.531.176</b> | <b>2,00</b>                  |
| <b>Indische Rupie</b>  |  |        |                       |                   |                              |
| 1.250.000.000  | India Government Bond*                               | 7,02 % | 18.06.2031            | 14.767.957        | 1,37                         |
| 300.000.000  | India Government Bond*                               | 7,10 % | 18.04.2029            | 3.550.520         | 0,33                         |
| 578.400.000  | India Government Bond*                               | 7,10 % | 08.04.2034            | 6.893.359         | 0,64                         |
| 1.834.200.000  | India Government Bond*                               | 7,18 % | 14.08.2033            | 21.914.294        | 2,04                         |
| 707.630.000  | India Government Bond*                               | 7,18 % | 24.07.2037            | 8.492.207         | 0,79                         |
| 1.430.840.000  | India Government Bond*                               | 7,30 % | 19.06.2053            | 17.414.843        | 1,62                         |
| 440.000.000  | International Bank for Reconstruction & Development* | 6,50 % | 17.04.2030            | 4.993.513         | 0,46                         |
| 1.124.800.000  | International Bank for Reconstruction & Development* | 6,75 % | 13.07.2029            | 12.921.692        | 1,20                         |
| <b>Indische Rupie insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>90.948.385</b> | <b>8,45</b>                  |
| <b>Indonesische Rupiah</b>   |  |        |                       |                   |                              |
| 72.466.000.000   | Indonesia Treasury Bond*                             | 6,13 % | 15.05.2028            | 4.406.991         | 0,41                         |
| 237.648.000.000  | Indonesia Treasury Bond*                             | 6,38 % | 15.08.2028            | 14.481.883        | 1,35                         |
| 12.550.000.000   | Indonesia Treasury Bond*                             | 6,38 % | 15.04.2032            | 744.411           | 0,07                         |
| 11.000.000.000   | Indonesia Treasury Bond*                             | 6,38 % | 15.07.2037            | 649.403           | 0,06                         |
| 46.004.000.000   | Indonesia Treasury Bond*                             | 6,50 % | 15.07.2030            | 2.790.123         | 0,26                         |
| 88.659.000.000   | Indonesia Treasury Bond*                             | 6,63 % | 15.05.2033            | 5.385.678         | 0,50                         |
| 48.411.000.000   | Indonesia Treasury Bond*                             | 6,63 % | 15.02.2034            | 2.929.069         | 0,27                         |
| 9.724.000.000  | Indonesia Treasury Bond*                             | 6,75 % | 15.07.2035            | 592.447           | 0,06                         |
| 159.931.000.000  | Indonesia Treasury Bond*                             | 6,88 % | 15.04.2029            | 9.891.261         | 0,92                         |
| 67.710.000.000   | Indonesia Treasury Bond*                             | 7,00 % | 15.02.2033            | 4.196.977         | 0,39                         |
| 115.990.000.000  | Indonesia Treasury Bond*                             | 7,13 % | 15.06.2038            | 7.225.881         | 0,67                         |
| 50.750.000.000   | Indonesia Treasury Bond*                             | 7,13 % | 15.06.2042            | 3.162.883         | 0,29                         |
| 68.964.000.000   | Indonesia Treasury Bond*                             | 7,13 % | 15.06.2043            | 4.294.844         | 0,40                         |
| 97.706.000.000   | Indonesia Treasury Bond*                             | 7,50 % | 15.08.2032            | 6.186.320         | 0,57                         |
| 79.493.000.000   | Indonesia Treasury Bond*                             | 7,50 % | 15.06.2035            | 5.099.010         | 0,47                         |

## Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung  | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 90,56 % (31. Dezember 2023: 87,45 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                   |                              |
| <b>Indonesische Rupie (Fortsetzung)</b>                                  |  |        |                       |                   |                              |
| 20.280.000.000   | Indonesia Treasury Bond <sup>†</sup>                           | 7,50 % | 15.05.2038            | 1.295.618         | 0,12                         |
| 40.000.000.000   | Indonesia Treasury Bond <sup>†</sup>                           | 7,50 % | 15.04.2040            | 2.578.417         | 0,24                         |
| 39.425.000.000   | Indonesia Treasury Bond <sup>†</sup>                           | 8,25 % | 15.05.2029            | 2.569.912         | 0,24                         |
| 73.362.000.000   | Indonesia Treasury Bond <sup>†</sup>                           | 8,25 % | 15.05.2036            | 4.998.248         | 0,46                         |
| 88.577.000.000   | Indonesia Treasury Bond <sup>†</sup>                           | 8,38 % | 15.03.2034            | 6.018.778         | 0,56                         |
| 98.837.000.000   | Indonesia Treasury Bond <sup>†</sup>                           | 8,75 % | 15.05.2031            | 6.677.667         | 0,62                         |
| 33.258.000.000   | Indonesia Treasury Bond <sup>†</sup>                           | 9,00 % | 15.03.2029            | 2.218.624         | 0,21                         |
| <b>Indonesische Rupiah insgesamt</b>                                     |  |        |                       | <b>98.394.445</b> | <b>9,14</b>                  |
| <b>Japanischer Yen</b>   |  |        |                       |                   |                              |
| 11.253.000   | Argentine Republic Government International Bond <sup>**</sup> | 0,67 % | 31.12.2038            | 10.109            | 0,00                         |
| 5.591.700  | Argentine Republic Government International Bond <sup>**</sup> | 4,33 % | 31.12.2033            | 7.452             | 0,00                         |
| <b>Japanischer Yen insgesamt</b>   |  |        |                       | <b>17.561</b>     | <b>0,00</b>                  |
| <b>Malaysischer Ringgit</b>  |  |        |                       |                   |                              |
| 16.322.000   | Malaysia Government Bond <sup>**</sup>                         | 2,63 % | 15.04.2031            | 3.417.308         | 0,32                         |
| 27.226.000   | Malaysia Government Bond <sup>**</sup>                         | 3,50 % | 31.05.2027            | 6.088.100         | 0,57                         |
| 3.710.000  | Malaysia Government Bond <sup>**</sup>                         | 3,58 % | 15.07.2032            | 817.003           | 0,08                         |
| 24.319.000   | Malaysia Government Bond <sup>**</sup>                         | 3,76 % | 22.05.2040            | 5.288.262         | 0,49                         |
| 28.629.000   | Malaysia Government Bond <sup>**</sup>                         | 3,83 % | 05.07.2034            | 6.400.717         | 0,59                         |
| 5.637.000  | Malaysia Government Bond <sup>**</sup>                         | 3,84 % | 15.04.2033            | 1.261.479         | 0,12                         |
| 38.470.000   | Malaysia Government Bond <sup>**</sup>                         | 3,90 % | 16.11.2027            | 8.693.588         | 0,81                         |
| 31.229.000   | Malaysia Government Bond <sup>**</sup>                         | 4,07 % | 15.06.2050            | 6.887.718         | 0,64                         |
| 1.113.000  | Malaysia Government Bond <sup>**</sup>                         | 4,23 % | 30.06.2031            | 255.279           | 0,02                         |
| 16.765.000   | Malaysia Government Bond <sup>**</sup>                         | 4,25 % | 31.05.2035            | 3.873.853         | 0,36                         |
| 10.300.000   | Malaysia Government Bond <sup>**</sup>                         | 4,50 % | 15.04.2030            | 2.391.902         | 0,22                         |
| 22.000.000   | Malaysia Government Bond <sup>**</sup>                         | 4,50 % | 30.04.2029            | 5.091.668         | 0,47                         |
| 13.956.000   | Malaysia Government Bond <sup>**</sup>                         | 4,64 % | 07.11.2033            | 3.305.351         | 0,31                         |
| 53.634.000   | Malaysia Government Bond <sup>**</sup>                         | 4,70 % | 15.10.2042            | 12.945.721        | 1,20                         |
| 1.300.000  | Malaysia Government Bond <sup>**</sup>                         | 4,76 % | 07.04.2037            | 313.586           | 0,03                         |
| 45.467.000   | Malaysia Government Bond <sup>**</sup>                         | 4,89 % | 08.06.2038            | 11.126.914        | 1,03                         |
| 4.791.000  | Malaysia Government Bond <sup>**</sup>                         | 4,94 % | 30.09.2043            | 1.188.781         | 0,11                         |
| 26.775.000   | Malaysia Government Investment Issue <sup>**</sup>             | 4,37 % | 31.10.2028            | 6.148.451         | 0,57                         |
| <b>Malaysischer Ringgit insgesamt</b>                                    |  |        |                       | <b>85.495.681</b> | <b>7,94</b>                  |
| <b>Mexikanischer Peso</b>  |  |        |                       |                   |                              |
| 82.700.000   | Mexican Bonos <sup>†</sup>                                     | 5,50 % | 04.03.2027            | 3.643.623         | 0,34                         |
| 92.239.400   | Mexican Bonos <sup>†</sup>                                     | 7,50 % | 03.06.2027            | 4.214.904         | 0,39                         |

## Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                    | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 90,56 % (31. Dezember 2023: 87,45 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                   |                              |
| <b>Mexikanischer Peso (Fortsetzung)</b>                                  |  |        |                       |                   |                              |
| 486.133.600  | Mexican Bonos*                           | 7,75 % | 29.05.2031            | 20.870.100        | 1,94                         |
| 211.490.200  | Mexican Bonos*                           | 7,75 % | 13.11.2042            | 7.811.321         | 0,73                         |
| 90.673.600   | Mexican Bonos*                           | 8,00 % | 07.11.2047            | 3.366.390         | 0,31                         |
| 536.778.300  | Mexican Bonos*                           | 8,50 % | 31.05.2029            | 24.464.167        | 2,27                         |
| 201.443.000  | Mexican Bonos*                           | 8,50 % | 18.11.2038            | 8.265.755         | 0,77                         |
| <b>Mexikanischer Peso insgesamt</b>                                      |  |        |                       | <b>72.636.260</b> | <b>6,75</b>                  |
| <b>Peruanischer Sol</b>  |  |        |                       |                   |                              |
| 7.536.000  | Peru Government Bond*                    | 5,35 % | 12.08.2040            | 1.680.234         | 0,15                         |
| 3.943.000  | Peru Government Bond*                    | 5,40 % | 12.08.2034            | 957.397           | 0,09                         |
| 11.457.000   | Peru Government Bond*                    | 6,15 % | 12.08.2032            | 3.025.651         | 0,28                         |
| 8.389.000  | Peru Government Bond*                    | 7,30 % | 12.08.2033            | 2.352.109         | 0,22                         |
| 8.187.000  | Peruvian Government International Bond*  | 5,40 % | 12.08.2034            | 1.987.880         | 0,18                         |
| 16.147.000   | Peruvian Government International Bond** | 6,90 % | 12.08.2037            | 4.267.231         | 0,40                         |
| 26.783.000   | Peruvian Government International Bond*  | 6,95 % | 12.08.2031            | 7.509.297         | 0,70                         |
| 8.500.000  | Peruvian Government International Bond** | 7,60 % | 12.08.2039            | 2.370.242         | 0,22                         |
| <b>Peruanischer Sol insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>24.150.041</b> | <b>2,24</b>                  |
| <b>Philippinischer Peso</b>  |  |        |                       |                   |                              |
| 228.130.000  | Philippine Government Bond*              | 6,25 % | 25.01.2034            | 3.964.756         | 0,37                         |
| 385.360.000  | Philippine Government Bond*              | 6,50 % | 19.05.2029            | 6.751.482         | 0,63                         |
| 166.830.000  | Philippine Government Bond*              | 6,63 % | 17.08.2033            | 2.961.156         | 0,27                         |
| 157.180.000  | Philippine Government Bond*              | 6,88 % | 23.05.2044            | 2.878.036         | 0,27                         |
| 125.346.802  | Philippine Government Bond*              | 8,00 % | 19.07.2031            | 2.377.999         | 0,22                         |
| <b>Philippinischer Peso insgesamt</b>                                    |  |        |                       | <b>18.933.429</b> | <b>1,76</b>                  |
| <b>Polnischer Zloty</b>  |  |        |                       |                   |                              |
| 17.486.000   | Republic of Poland Government Bond**     | 1,25 % | 25.10.2030            | 3.356.320         | 0,31                         |
| 49.798.000   | Republic of Poland Government Bond*      | 1,75 % | 25.04.2032            | 9.308.034         | 0,86                         |
| 26.147.000   | Republic of Poland Government Bond*      | 2,50 % | 25.07.2027            | 5.933.321         | 0,55                         |
| 62.004.000   | Republic of Poland Government Bond*      | 4,75 % | 25.07.2029            | 14.596.491        | 1,36                         |
| 41.398.000   | Republic of Poland Government Bond*      | 6,00 % | 25.10.2033            | 10.184.401        | 0,95                         |
| 81.356.000   | Republic of Poland Government Bond*      | 7,50 % | 25.07.2028            | 21.047.392        | 1,96                         |
| <b>Polnischer Zloty insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>64.425.959</b> | <b>5,99</b>                  |
| <b>Rumänischer neuer Leu</b>   |  |        |                       |                   |                              |
| 66.350.000   | Romania Government Bond*                 | 2,50 % | 25.10.2027            | 12.270.735        | 1,14                         |
| 19.355.000   | Romania Government Bond*                 | 4,75 % | 11.10.2034            | 3.317.978         | 0,31                         |

## Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                     | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 90,56 % (31. Dezember 2023: 87,45 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                   |                              |
| <b>Rumänischer neuer Leu (Fortsetzung)</b>                               |   |         |                       |                   |                              |
| 1.095.000  | Romania Government Bond**                 | 4,85 %  | 25.07.2029            | 208.057           | 0,02                         |
| 16.170.000   | Romania Government Bond*                  | 6,30 %  | 25.04.2029            | 3.262.743         | 0,30                         |
| 28.590.000   | Romania Government Bond*                  | 6,70 %  | 25.02.2032            | 5.767.793         | 0,53                         |
| 17.255.000   | Romania Government Bond*                  | 7,10 %  | 31.07.2034            | 3.524.726         | 0,33                         |
| 9.215.000  | Romania Government Bond*                  | 7,35 %  | 28.04.2031            | 1.922.653         | 0,18                         |
| 31.000.000   | Romania Government Bond*                  | 8,00 %  | 29.04.2030            | 6.665.048         | 0,62                         |
| 29.310.000   | Romania Government Bond*                  | 8,25 %  | 29.09.2032            | 6.436.404         | 0,60                         |
| 17.355.000   | Romania Government Bond*                  | 8,75 %  | 30.10.2028            | 3.801.700         | 0,35                         |
| <b>Rumänischer neuer Leu insgesamt</b>                                   |   |         |                       | <b>47.177.837</b> | <b>4,38</b>                  |
| <b>Serbischer Dinar</b>  |   |         |                       |                   |                              |
| 115.190.000  | Serbia Treasury Bonds*                    | 4,50 %  | 11.01.2026            | 1.024.931         | 0,09                         |
| 80.900.000   | Serbia Treasury Bonds*                    | 4,50 %  | 20.08.2032            | 703.712           | 0,07                         |
| 198.550.000  | Serbia Treasury Bonds*                    | 5,88 %  | 08.02.2028            | 1.856.737         | 0,17                         |
| 114.550.000  | Serbia Treasury Bonds*                    | 7,00 %  | 26.10.2031            | 1.143.471         | 0,11                         |
| <b>Serbischer Dinar insgesamt</b>  |   |         |                       | <b>4.728.851</b>  | <b>0,44</b>                  |
| <b>Südafrikanischer Rand</b>   |   |         |                       |                   |                              |
| 345.089.224  | Republic of South Africa Government Bond* | 6,25 %  | 31.03.2036            | 13.204.646        | 1,23                         |
| 201.350.928  | Republic of South Africa Government Bond* | 6,50 %  | 28.02.2041            | 7.131.794         | 0,66                         |
| 512.393.634  | Republic of South Africa Government Bond* | 8,50 %  | 31.01.2037            | 23.076.830        | 2,14                         |
| 301.080.850  | Republic of South Africa Government Bond* | 8,75 %  | 31.01.2044            | 12.963.973        | 1,20                         |
| 199.874.767  | Republic of South Africa Government Bond* | 8,88 %  | 28.02.2035            | 9.656.038         | 0,90                         |
| 417.026.705  | Republic of South Africa Government Bond* | 9,00 %  | 31.01.2040            | 18.853.894        | 1,75                         |
| 137.535.943  | Republic of South Africa Government Bond* | 10,88 % | 31.03.2038            | 7.269.055         | 0,68                         |
| <b>Südafrikanischer Rand insgesamt</b>                                   |   |         |                       | <b>92.156.230</b> | <b>8,56</b>                  |
| <b>Thailändischer Baht</b>   |   |         |                       |                   |                              |
| 29.597.000   | Thailand Government Bond**                | 1,60 %  | 17.06.2035            | 810.964           | 0,07                         |
| 176.209.000  | Thailand Government Bond**                | 2,00 %  | 17.06.2042            | 4.727.475         | 0,44                         |
| 346.859.000  | Thailand Government Bond**                | 2,40 %  | 17.03.2029            | 10.298.442        | 0,96                         |
| 85.188.000   | Thailand Government Bond**                | 2,80 %  | 17.06.2034            | 2.607.756         | 0,24                         |
| 27.836.000   | Thailand Government Bond**                | 2,88 %  | 17.06.2046            | 841.016           | 0,08                         |
| 271.019.000  | Thailand Government Bond**                | 3,30 %  | 17.06.2038            | 8.675.529         | 0,81                         |
| 231.271.000  | Thailand Government Bond**                | 3,35 %  | 17.06.2033            | 7.343.036         | 0,68                         |
| 150.994.000  | Thailand Government Bond**                | 3,39 %  | 17.06.2037            | 4.871.536         | 0,45                         |
| 75.397.000   | Thailand Government Bond**                | 3,40 %  | 17.06.2036            | 2.445.785         | 0,23                         |
| 364.512.000  | Thailand Government Bond**                | 3,45 %  | 17.06.2043            | 11.851.004        | 1,10                         |

## Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                             | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$         | % des<br>Nettover-<br>mögens          |
|--|---|---------|-----------------------|--------------------------|---------------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 90,56 % (31. Dezember 2023: 87,45 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                          |                                       |
| <b>Thailändischer Baht (Fortsetzung)</b>                                 |   |         |                       |                          |                                       |
| 194.450.000  | Thailand Government Bond**                        | 3,78 %  | 25.06.2032            | 6.304.013                | 0,59                                  |
| 76.225.000   | Thailand Government Bond**                        | 4,88 %  | 22.06.2029            | 2.501.105                | 0,23                                  |
| <b>Thailändischer Baht insgesamt</b>                                     |   |         |                       | <b>63.277.661</b>        | <b>5,88</b>                           |
| <b>Türkische Lira</b>  |   |         |                       |                          |                                       |
| 55.104.752   | Turkiye Government Bond*                          | 17,80 % | 13.07.2033            | 1.079.419                | 0,10                                  |
| 818.945.780  | Turkiye Government Bond*                          | 26,20 % | 05.10.2033            | 22.245.349               | 2,07                                  |
| 381.217.895  | Turkiye Government Bond*                          | 31,08 % | 08.11.2028            | 10.670.229               | 0,99                                  |
| <b>Türkische Lira insgesamt</b>  |   |         |                       | <b>33.994.997</b>        | <b>3,16</b>                           |
| <b>Uganda-Schilling</b>  |   |         |                       |                          |                                       |
| 22.942.900.000   | Republic of Uganda Government Bonds*              | 14,25 % | 22.06.2034            | 5.599.503                | 0,52                                  |
| <b>Uganda-Schilling insgesamt</b>  |   |         |                       | <b>5.599.503</b>         | <b>0,52</b>                           |
| <b>US-Dollar</b>   |   |         |                       |                          |                                       |
| 6.240.000  | Argentine Republic Government International Bond* | 0,75 %  | 09.07.2030            | 4.824.768                | 0,45                                  |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |   |         |                       | <b>4.824.768</b>         | <b>0,45</b>                           |
| <b>Uruguayischer Peso</b>  |   |         |                       |                          |                                       |
| 89.814.491   | Uruguay Government International Bond*            | 8,25 %  | 21.05.2031            | 1.913.944                | 0,18                                  |
| <b>Uruguayischer Peso insgesamt</b>                                      |   |         |                       | <b>1.913.944</b>         | <b>0,18</b>                           |
| <b>Sambischer Kwacha</b>   |   |         |                       |                          |                                       |
| 178.877.000  | Zambia Government Bond*                           | 13,00 % | 25.01.2031            | 4.761.707                | 0,44                                  |
| <b>Sambischer Kwacha insgesamt</b>                                       |   |         |                       | <b>4.761.707</b>         | <b>0,44</b>                           |
| <b>Staatsanleihen insgesamt</b>  |   |         |                       | <b>974.722.981</b>       | <b>90,56</b>                          |
| <b>Anzahl der<br/>Anteile</b>  | <b>Wertpapierbezeichnung</b>                      |         |                       | <b>Zeitwert<br/>US\$</b> | <b>% des<br/>Netto-<br/>vermögens</b> |
| <b>Investmentfonds 0,37 % (31. Dezember 2023: 1,26 %)</b>                |   |         |                       |                          |                                       |
| <b>US-Dollar</b>   |   |         |                       |                          |                                       |
| 370.676  | Neuberger Berman China Bond Fund                  |         |                       | 4.040.368                | 0,37                                  |
| <b>Investmentfonds insgesamt <sup>#</sup></b>                            |   |         |                       | <b>4.040.368</b>         | <b>0,37</b>                           |
| <b>Anlagen insgesamt</b>   |   |         |                       | <b>1.034.603.370</b>     | <b>96,12</b>                          |

## Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 1,20 % (31. Dezember 2023: 1,33 %)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 45.106.480.926 COP | 10.230.199 US\$     | 03.01.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | 8.383                          | 0,00                 |
| 59.024.201.546 COP | 13.261.623 US\$     | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 3         | 111.295                        | 0,01                 |
| 4.996.788 €        | 2.067.132.075 HUF   | 19.03.2025       | BNP Paribas                    | 1         | 7.616                          | 0,00                 |
| 9.845.758 €        | 41.930.874 PLN      | 17.01.2025       | Citibank NA                    | 1         | 54.549                         | 0,01                 |
| 5.018.480 €        | 2.067.191.682 HUF   | 19.03.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | 30.003                         | 0,00                 |
| 9.905.152 €        | 4.083.610.735 HUF   | 19.03.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 50.388                         | 0,00                 |
| 10.610.248.275 HUF | 25.608.108 €        | 19.03.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 2.029                          | 0,00                 |
| 5.356.054.890 NGN  | 2.729.895 US\$      | 28.11.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 224.898                        | 0,02                 |
| 2.267.775.333 NGN  | 1.333.985 US\$      | 10.02.2025       | Standard Chartered Bank        | 1         | 97.841                         | 0,01                 |
| 183.394.745 RON    | 36.604.245 €        | 17.01.2025       | BNP Paribas                    | 6         | 212.064                        | 0,02                 |
| 4.732.797 RON      | 943.068 €           | 17.01.2025       | Citibank NA                    | 1         | 7.092                          | 0,00                 |
| 37.966.348 RON     | 7.563.688 €         | 17.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 3         | 58.528                         | 0,01                 |
| 167.378.503 THB    | 4.855.755 US\$      | 09.01.2025       | Citibank NA                    | 1         | 55.154                         | 0,01                 |
| 94.235.835 THB     | 2.758.781 US\$      | 19.03.2025       | HSBC Bank Plc                  | 1         | 18.886                         | 0,00                 |
| 47.903.033 THB     | 1.402.293 US\$      | 02.01.2025       | Morgan Stanley                 | 1         | 2.694                          | 0,00                 |
| 71.062.575 TRY     | 1.789.854 US\$      | 09.01.2025       | Barclays Bank Plc              | 1         | 208.810                        | 0,02                 |
| 771.951.852 TRY    | 17.785.430 US\$     | 24.03.2025       | Goldman Sachs International    | 3         | 2.424.057                      | 0,23                 |
| 268.878.871 TRY    | 5.892.590 US\$      | 27.05.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | 743.082                        | 0,07                 |
| 325.807.888 TRY    | 7.970.855 US\$      | 09.01.2025       | Goldman Sachs International    | 2         | 1.192.627                      | 0,11                 |
| 6.595.430 US\$     | 29.128.717 MYR      | 14.02.2025       | BNP Paribas                    | 1         | 68.601                         | 0,01                 |
| 3.892.481 US\$     | 28.291.562 CNY      | 06.01.2025       | BNP Paribas                    | 1         | 39.082                         | 0,00                 |
| 10.272.246 US\$    | 74.798.282 CNY      | 02.04.2025       | BNP Paribas                    | 1         | 60.448                         | 0,01                 |
| 4.587.772 US\$     | 72.214.007.922 IDR  | 06.01.2025       | BNP Paribas                    | 1         | 109.027                        | 0,01                 |
| 5.218.862 US\$     | 7.023.879 SGD       | 20.03.2025       | Citibank NA                    | 1         | 54.340                         | 0,01                 |
| 5.216.300 US\$     | 7.466.439.672 KRW   | 20.03.2025       | Citibank NA                    | 1         | 150.032                        | 0,01                 |
| 10.549.084 US\$    | 75.183.319 CNY      | 02.01.2025       | Citibank NA                    | 1         | 248.941                        | 0,02                 |
| 5.195.382 US\$     | 173.229.315 THB     | 09.01.2025       | Citibank NA                    | 1         | 112.810                        | 0,01                 |
| 2.060.407 US\$     | 1.946.255 €         | 03.01.2025       | Citibank NA                    | 1         | 45.060                         | 0,00                 |
| 2.491.247 US\$     | 39.795.911.230 IDR  | 06.01.2025       | Citibank NA                    | 2         | 23.086                         | 0,00                 |
| 19.205.032 US\$    | 1.121.170.571 PHP   | 19.03.2025       | Deutsche Bank AG               | 1         | 26.938                         | 0,00                 |
| 11.643.077 US\$    | 369.271.647 TWD     | 22.01.2025       | Deutsche Bank AG               | 2         | 411.415                        | 0,04                 |
| 59.725.382 US\$    | 262.424.368.911 COP | 16.01.2025       | Deutsche Bank AG               | 1         | 268.765                        | 0,03                 |
| 1.853.645 US\$     | 29.592.523.143 IDR  | 06.01.2025       | Deutsche Bank AG               | 1         | 18.304                         | 0,00                 |
| 20.025.329 US\$    | 1.709.722.515 INR   | 19.03.2025       | Deutsche Bank AG               | 1         | 192.111                        | 0,02                 |
| 8.340.730 US\$     | 8.155.911.825 CLP   | 19.03.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | 147.333                        | 0,01                 |
| 4.755.955 US\$     | 75.674.171.682 IDR  | 06.01.2025       | Goldman Sachs International    | 2         | 62.608                         | 0,01                 |
| 1.916.132 US\$     | 2.730.622.617 KRW   | 19.03.2025       | HSBC Bank Plc                  | 1         | 63.349                         | 0,01                 |
| 5.611.602 US\$     | 87.218.601.782 IDR  | 06.01.2025       | HSBC Bank Plc                  | 1         | 202.265                        | 0,02                 |
| 20.020.873 US\$    | 1.709.722.516 INR   | 19.03.2025       | HSBC Bank Plc                  | 1         | 187.656                        | 0,02                 |

## Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 1,20 % (31. Dezember 2023: 1,33 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 1.492.740 US\$  | 47.935.178 THB      | 02.01.2025       | HSBC Bank Plc                  | 1         | 86.811                         | 0,01                 |
| 5.179.022 US\$  | 23.096.885 MYR      | 26.02.2025       | HSBC Bank Plc                  | 1         | 1.323                          | 0,00                 |
| 13.412.407 US\$   | 12.721.216 €        | 03.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | 239.588                        | 0,02                 |
| 5.132.755 US\$  | 22.775.062 MYR      | 06.03.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 25.644                         | 0,00                 |
| 5.204.120 US\$  | 177.215.894 THB     | 21.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 1.282                          | 0,00                 |
| 2.170.405 US\$  | 2.795.481.305 NGN   | 10.02.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 405.395                        | 0,04                 |
| 6.023.492 US\$  | 201.214.747 THB     | 09.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 119.823                        | 0,01                 |
| 2.175.770 US\$  | 8.142.820 PEN       | 19.03.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 13.290                         | 0,00                 |
| 5.768.089 US\$  | 188.097.396 THB     | 02.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 251.228                        | 0,02                 |
| 5.071.053 US\$  | 31.293.465 BRL      | 05.03.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 63.032                         | 0,01                 |
| 11.675.217 US\$   | 83.326.026 CNY      | 06.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 205.003                        | 0,02                 |
| 2.849.859 US\$  | 20.828.961 CNY      | 02.01.2025       | Standard Chartered Bank        | 1         | 12.705                         | 0,00                 |
| 3.893.740 US\$  | 28.291.562 CNY      | 19.03.2025       | Standard Chartered Bank        | 1         | 33.407                         | 0,00                 |
| 5.439.230 US\$  | 7.250.157 SGD       | 14.02.2025       | Standard Chartered Bank        | 1         | 115.365                        | 0,01                 |
| 11.383.302 US\$   | 81.659.009 CNY      | 13.02.2025       | Standard Chartered Bank        | 2         | 253.727                        | 0,02                 |
| 7.024.492 US\$  | 6.681.826 €         | 03.01.2025       | Standard Chartered Bank        | 2         | 105.461                        | 0,01                 |
| 33.994 US\$   | 1.101.457 THB       | 02.01.2025       | Standard Chartered Bank        | 1         | 1.688                          | 0,00                 |
| 5.965.791 US\$  | 511.385.167 INR     | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 2         | 33.592                         | 0,00                 |
| 3.059.957 US\$  | 13.329.946.444 COP  | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 39.835                         | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i>   |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 1.204.917 US\$  | 1.864.703 AUD       | 13.03.2025       | Citibank NA                    | 1         | 50.281                         | 0,00                 |
| 1.777.574 US\$  | 2.775.574 AUD       | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp           | 16        | 58.920                         | 0,01                 |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>   |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 392.368 US\$  | 373.942 €           | 13.03.2025       | UBS AG                         | 2         | 3.990                          | 0,00                 |
| 223.134 US\$  | 213.989 €           | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp           | 2         | 885                            | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>   |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 12.174 US\$   | 9.635 £             | 13.03.2025       | Goldman Sachs International    | 2         | 114                            | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen SEK</i>   |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 101.979.073 US\$  | 1.106.049.540 SEK   | 13.03.2025       | Goldman Sachs International    | 4         | 1.503.083                      | 0,14                 |
| 9 US\$  | 96 SEK              | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp           | 1         | 0                              | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>   |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 69.361 US\$   | 92.492 SGD          | 13.03.2025       | Goldman Sachs International    | 2         | 1.373                          | 0,00                 |
| 9.452 US\$  | 12.751 SGD          | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp           | 2         | 79                             | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen ZAR</i>   |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 22.962.619 US\$   | 412.401.589 ZAR     | 13.03.2025       | Goldman Sachs International    | 3         | 1.244.802                      | 0,12                 |
| 363.105 US\$  | 6.690.922 ZAR       | 13.03.2025       | UBS AG                         | 1         | 10.749                         | 0,00                 |
| 302.246 US\$  | 5.516.145 ZAR       | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp           | 16        | 11.756                         | 0,00                 |
| 1.558 ZAR   | 82 US\$             | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp           | 1         | 0                              | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>~</sup></b> |                     |                  |                                |           | <b>12.896.398</b>              | <b>1,20</b>          |

## Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Futures-Kontrakte 0,02 % (31. Dezember 2023: 0,03 %)

| Anzahl Kontrakte  | Beschreibung                                     | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|--|--------------------------------|----------------------|
| (83)  | US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2025 | 75.867                         | 0,01                 |
| (28)  | US Treasury Ultra Bond (CBT) Future March 2025   | 95.121                         | 0,01                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten *</b> |  | <b>170.988</b>                 | <b>0,02</b>          |

### Zinsswap-Kontrakte 0,88 % (31. Dezember 2023: 0,89 %)

|  | Nominalwert    | Fälligkeit | Gegenpartei                              | Erhalt/(Zahlung) <sup>#</sup> | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|----------------|------------|--|-------------------------------|-----------------|--------------------|--------------------------------|----------------------|
| MXN  | 512.441.055    | 31.08.2029 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt                        | 6,92 %          | 1D TIIE + 24bps    | 1.716.875                      | 0,16                 |
| MXN  | 197.538.674    | 22.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 0,00 %          | 1D TIIE + 24bps    | 862.459                        | 0,08                 |
| MXN  | 189.498.232    | 25.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 0,00 %          | 1D TIIE + 24bps    | 833.120                        | 0,08                 |
| MXN  | 184.675.074    | 29.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 0,00 %          | 1D TIIE + 24bps    | 818.460                        | 0,08                 |
| MXN  | 512.441.055    | 26.12.2025 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt                        | 6,92 %          | 28D MXIBOR         | 651.408                        | 0,06                 |
| MXN  | 141.097.429    | 19.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 0,00 %          | 28D MXIBOR         | 611.953                        | 0,06                 |
| MXN  | 128.272.271    | 29.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 0,00 %          | 1D TIIE + 24bps    | 568.489                        | 0,05                 |
| MXN  | 128.662.192    | 11.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 0,00 %          | 1D TIIE + 24bps    | 544.124                        | 0,05                 |
| MXN  | 128.662.190    | 11.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 0,00 %          | 1D TIIE + 24bps    | 544.124                        | 0,05                 |
| MXN  | 115.453.272    | 15.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 0,00 %          | 1D TIIE + 24bps    | 493.706                        | 0,04                 |
| MXN  | 106.623.448    | 19.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 0,00 %          | 1D TIIE + 24bps    | 460.433                        | 0,04                 |
| MXN  | 95.000.000     | 10.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 0,00 %          | 1D TIIE + 24bps    | 400.894                        | 0,04                 |
| MXN  | 94.552.835     | 11.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 0,00 %          | 1D TIIE + 24bps    | 399.872                        | 0,04                 |
| MXN  | 60.000.000     | 17.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 0,00 %          | 1D TIIE + 24bps    | 257.911                        | 0,02                 |
| MXN  | 39.280.990     | 17.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 0,00 %          | 1D TIIE + 24bps    | 168.850                        | 0,01                 |
| HUF  | 559.561.178    | 10.02.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 8,72 %          | 6M BUBOR           | 82.741                         | 0,01                 |
| MXN  | 189.498.232    | 13.05.2027 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 9,69 %          | 1D TIIE + 24bps    | 63.386                         | 0,01                 |
| MXN  | 115.453.272    | 28.05.2029 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 9,49 %          | 1D TIIE + 24bps    | 19.344                         | 0,00                 |
| CNY  | 85.502.428     | 19.09.2029 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 1,64 %          | 7D CNRR            | 17.750                         | 0,00                 |
| CNY  | 96.779.381     | 11.12.2029 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 1,48 %          | 7D CNRR            | 7.414                          | 0,00                 |
| CLP  | 18.820.445.965 | 02.05.2027 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 5,36 %          | 1D CLICP           | 131                            | 0,00                 |
| COP  | 16.373.710.210 | 15.10.2034 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 7,95 %          | 1D COOVIBR         | 68                             | 0,00                 |
| COP  | 10.008.583.466 | 08.08.2034 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 7,81 %          | 1D COOVIBR         | 45                             | 0,00                 |
| KRW  | 9.462.404.207  | 19.12.2034 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 2,67 %          | 3M KWDCDC          | 42                             | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Zinsswapkontrakten <sup>∞</sup></b> |                |            |  |                               |                 |                    | <b>9.523.599</b>               | <b>0,88</b>          |

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

## Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

|  | Zeitwert<br>US\$     | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|----------------------|------------------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> | <b>1.057.194.355</b> | <b>98,22</b>                 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (1,82 %) (31. Dezember 2023: (0,96 %))

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettövermögens |
|---------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 12.832.218 BRL      | 2.108.564 US\$      | 05.03.2025       | Citibank NA                    | 1         | (54.972)                        | (0,01)               |
| 629.529.454 BRL     | 106.962.782 US\$    | 05.03.2025       | Morgan Stanley                 | 1         | (6.216.631)                     | (0,58)               |
| 5.231.529 CNY       | 724.922 US\$        | 13.02.2025       | Barclays Bank Plc              | 1         | (11.900)                        | (0,00)               |
| 26.334.319 CNY      | 3.634.694 US\$      | 19.03.2025       | Citibank NA                    | 1         | (41.423)                        | (0,00)               |
| 20.828.961 CNY      | 2.856.695 US\$      | 19.03.2025       | Standard Chartered Bank        | 1         | (14.620)                        | (0,00)               |
| 28.291.562 CNY      | 3.882.801 US\$      | 06.01.2025       | Standard Chartered Bank        | 1         | (29.402)                        | (0,00)               |
| 75.183.319 CNY      | 10.458.251 US\$     | 02.01.2025       | Citibank NA                    | 1         | (158.108)                       | (0,02)               |
| 44.342.583.292 COP  | 10.087.030 US\$     | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | (40.478)                        | (0,00)               |
| 117.633.037 CZK     | 4.679.038 €         | 17.01.2025       | Citibank NA                    | 2         | (8.299)                         | (0,00)               |
| 3.234.027 €         | 16.165.505 RON      | 17.01.2025       | Barclays Bank Plc              | 2         | (10.911)                        | (0,00)               |
| 14.122.692 €        | 70.630.800 RON      | 17.01.2025       | BNP Paribas                    | 3         | (55.456)                        | (0,01)               |
| 9.629.061 €         | 41.456.600 PLN      | 03.01.2025       | BNP Paribas                    | 1         | (65.566)                        | (0,01)               |
| 2.934.484 €         | 12.566.337 PLN      | 17.01.2025       | Citibank NA                    | 1         | (445)                           | (0,00)               |
| 5.438.928 €         | 27.199.082 RON      | 17.01.2025       | Citibank NA                    | 1         | (20.892)                        | (0,00)               |
| 8.948.422 €         | 9.416.304 US\$      | 03.01.2025       | Citibank NA                    | 1         | (150.212)                       | (0,01)               |
| 6.811.425 €         | 7.186.213 US\$      | 03.01.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | (132.982)                       | (0,01)               |
| 1.912.352 €         | 2.010.048 US\$      | 03.01.2025       | HSBC Bank Plc                  | 1         | (29.807)                        | (0,00)               |
| 1.974.135 €         | 2.073.895 US\$      | 05.02.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (26.904)                        | (0,00)               |
| 5.139.074 €         | 25.702.738 RON      | 17.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (20.400)                        | (0,00)               |
| 8.596.963 €         | 9.021.434 US\$      | 03.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | (119.279)                       | (0,01)               |
| 4.705.531 €         | 23.531.139 RON      | 17.01.2025       | Standard Chartered Bank        | 3         | (18.000)                        | (0,00)               |
| 5.683.978 €         | 5.974.740 US\$      | 05.02.2025       | Standard Chartered Bank        | 1         | (80.991)                        | (0,01)               |
| 9.787.357 €         | 10.267.578 US\$     | 17.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (126.962)                       | (0,01)               |
| 193.138.036.340 IDR | 12.479.253 US\$     | 06.01.2025       | BNP Paribas                    | 2         | (500.745)                       | (0,05)               |
| 14.438.197.262 IDR  | 894.108 US\$        | 19.03.2025       | Citibank NA                    | 1         | (7.159)                         | (0,00)               |
| 98.366.390.419 IDR  | 6.229.725 US\$      | 06.01.2025       | Deutsche Bank AG               | 2         | (128.997)                       | (0,01)               |
| 99.603.854.538 IDR  | 6.250.179 US\$      | 19.03.2025       | HSBC Bank Plc                  | 1         | (131.443)                       | (0,01)               |
| 12.990.789.000 IDR  | 821.095 US\$        | 06.01.2025       | Morgan Stanley                 | 1         | (15.400)                        | (0,00)               |
| 2.245.496.662 INR   | 26.181.539 US\$     | 19.03.2025       | BNP Paribas                    | 2         | (133.205)                       | (0,01)               |
| 760.208.774 ¥       | 5.104.859 US\$      | 06.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (232.779)                       | (0,02)               |
| 4.372.593.489 KZT   | 8.513.753 US\$      | 14.05.2025       | Goldman Sachs International    | 3         | (465.302)                       | (0,04)               |
| 1.394.718.074 KZT   | 2.717.424 US\$      | 14.05.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (150.225)                       | (0,02)               |
| 34.905.442 MXN      | 1.717.286 US\$      | 04.02.2025       | BNP Paribas                    | 1         | (48.401)                        | (0,01)               |
| 659.166.549 MXN     | 31.811.267 US\$     | 04.02.2025       | Citibank NA                    | 1         | (295.465)                       | (0,03)               |

## Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (1,82 %) (31. Dezember 2023: (0,96 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag              | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 27.984.092 MXN                  | 1.373.261 US\$      | 04.02.2025       | Deutsche Bank AG               | 1         | (35.297)                        | (0,00)               |
| 137.520.849 MXN                 | 6.767.750 US\$      | 04.02.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | (192.660)                       | (0,02)               |
| 111.186.280 MXN                 | 5.409.938 US\$      | 04.02.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (93.945)                        | (0,01)               |
| 82.271.955 MYR                  | 18.598.074 US\$     | 19.03.2025       | BNP Paribas                    | 2         | (140.687)                       | (0,01)               |
| 21.854.964 MYR                  | 4.904.615 US\$      | 14.02.2025       | HSBC Bank Plc                  | 1         | (7.605)                         | (0,00)               |
| 6.513.750.064 NGN               | 4.281.393 US\$      | 10.02.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | (168.744)                       | (0,02)               |
| 4.089.027.484 NGN               | 2.514.229 US\$      | 20.05.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | (43.601)                        | (0,01)               |
| 41.456.600 PLN                  | 9.692.592 €         | 03.01.2025       | Citibank NA                    | 1         | (219)                           | (0,00)               |
| 47.474.231 PLN                  | 11.099.233 €        | 17.01.2025       | Citibank NA                    | 1         | (11.866)                        | (0,00)               |
| 6.982.707 SGD                   | 5.230.574 US\$      | 14.02.2025       | Citibank NA                    | 1         | (103.100)                       | (0,01)               |
| 1.478.088.444 THB               | 43.908.405 US\$     | 19.03.2025       | Citibank NA                    | 2         | (340.712)                       | (0,03)               |
| 189.230.998 THB                 | 5.920.870 US\$      | 02.01.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | (370.760)                       | (0,04)               |
| 63.665.248 THB                  | 1.870.653 US\$      | 09.01.2025       | Morgan Stanley                 | 1         | (2.706)                         | (0,00)               |
| 375.746.320 TWD                 | 11.740.885 US\$     | 22.01.2025       | Deutsche Bank AG               | 2         | (312.291)                       | (0,03)               |
| 10.062.894 US\$                 | 396.870.463 TRY     | 09.01.2025       | Barclays Bank Plc              | 1         | (1.099.253)                     | (0,10)               |
| 6.256.029 US\$                  | 254.651.677 TRY     | 24.03.2025       | Barclays Bank Plc              | 1         | (410.681)                       | (0,04)               |
| 4.601.889 US\$                  | 158.262.139 THB     | 09.01.2025       | Citibank NA                    | 1         | (41.544)                        | (0,00)               |
| 10.039.882 US\$                 | 45.106.480.926 COP  | 03.01.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | (198.699)                       | (0,02)               |
| 12.905.309 US\$                 | 80.726.064 BRL      | 05.03.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | (13.610)                        | (0,00)               |
| 6.152.598 US\$                  | 27.420.036.946 COP  | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | (59.869)                        | (0,01)               |
| 1.256.190 US\$                  | 56.773.520 TRY      | 24.03.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | (230.125)                       | (0,02)               |
| 1.684.276 US\$                  | 69.613.487 TRY      | 27.05.2025       | Merrill Lynch & Co             | 1         | (33.718)                        | (0,00)               |
| 2.880.473 US\$                  | 122.693.764 TRY     | 24.03.2025       | Morgan Stanley                 | 1         | (331.616)                       | (0,03)               |
| 1.406.431 US\$                  | 47.903.033 THB      | 19.03.2025       | Morgan Stanley                 | 1         | (5.545)                         | (0,00)               |
| 5.122.911 US\$                  | 32.360.200 BRL      | 05.03.2025       | Standard Chartered Bank        | 1         | (55.823)                        | (0,01)               |
| 1.154.933 US\$                  | 40.164.631 THB      | 09.01.2025       | UBS AG                         | 1         | (23.503)                        | (0,00)               |
| 29.853.914 ZAR                  | 1.656.966 US\$      | 19.03.2025       | Morgan Stanley                 | 1         | (85.678)                        | (0,01)               |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 14.180.879 AUD                  | 9.163.282 US\$      | 13.03.2025       | Citibank NA                    | 2         | (382.389)                       | (0,04)               |
| 132.460 AUD                     | 82.741 US\$         | 13.03.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | (721)                           | (0,00)               |
| 13.968.646 AUD                  | 9.022.807 US\$      | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp           | 10        | (373.330)                       | (0,03)               |
| 100.734 US\$                    | 162.889 AUD         | 13.03.2025       | UBS AG                         | 1         | (128)                           | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 16.913.436 €                    | 17.962.991 US\$     | 13.03.2025       | Citibank NA                    | 5         | (396.612)                       | (0,04)               |
| 93.711 €                        | 97.933 US\$         | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp           | 1         | (605)                           | (0,00)               |
| 114.102 US\$                    | 109.918 €           | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp           | 1         | (60)                            | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 433.835 £                       | 553.872 US\$        | 13.03.2025       | Citibank NA                    | 5         | (10.822)                        | (0,00)               |
| 2.410 £                         | 3.018 US\$          | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp           | 1         | (1)                             | (0,00)               |

## Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (1,82 %) (31. Dezember 2023: (0,96 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen GBP (Fortsetzung)</i>                                     |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 3.478 US\$  | 2.780 £             | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | (2)                             | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen SEK</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 1.110.797.606 SEK   | 102.416.906 US\$    | 13.03.2025       | Goldman Sachs International | 4         | (1.509.592)                     | (0,14)               |
| 1.350 SEK   | 125 US\$            | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 2         | (2)                             | (0,00)               |
| 2.983 US\$  | 32.916 SEK          | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | (7)                             | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 3.806 SGD   | 2.855 US\$          | 13.03.2025       | Citibank NA                 | 1         | (57)                            | (0,00)               |
| 662.019 SGD   | 496.420 US\$        | 13.03.2025       | Goldman Sachs International | 3         | (9.792)                         | (0,00)               |
| 1.098 SGD   | 817 US\$            | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 2         | (10)                            | (0,00)               |
| 2.793 US\$  | 3.808 SGD           | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | (6)                             | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen ZAR</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 195.179 US\$  | 3.713.775 ZAR       | 13.03.2025       | UBS AG                      | 1         | (395)                           | (0,00)               |
| 23.330 US\$   | 443.093 ZAR         | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | (4)                             | (0,00)               |
| 10.284.800 ZAR  | 574.304 US\$        | 13.03.2025       | Citibank NA                 | 1         | (32.688)                        | (0,00)               |
| 941.199.374 ZAR   | 52.418.170 US\$     | 13.03.2025       | Goldman Sachs International | 2         | (2.852.900)                     | (0,27)               |
| 3.047.373 ZAR   | 163.101 US\$        | 13.03.2025       | UBS AG                      | 1         | (2.621)                         | (0,00)               |
| 344.796 ZAR   | 19.125 US\$         | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 10        | (967)                           | (0,00)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>oo</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>(19.531.329)</b>             | <b>(1,82)</b>        |

### Zinsswap-Kontrakte (1,66 %) (31. Dezember 2023: (1,16 %))

| Nominalwert        | Fälligkeit | Gegenpartei                              | Erhalt/(Zahlung) <sup>#</sup> | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|------------|--|-------------------------------|-----------------|--------------------|---------------------------------|----------------------|
| KRW 42.042.796.610 | 19.12.2026 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 2,69 %          | 3M KWDC            | (15)                            | (0,00)               |
| CLP 6.932.372.858  | 24.10.2033 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 6,12 %          | 1D CLICP           | (328)                           | (0,00)               |
| MXN 39.280.990     | 10.02.2027 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 9,26 %          | 1D TIIE + 24bps    | (3.781)                         | (0,00)               |
| CLP 45.161.320     | 24.08.2030 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 2,15 %          | 1D CLICP           | (7.066)                         | (0,00)               |
| HUF 550.657.624    | 21.03.2029 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 6,18 %          | 6M BUBOR           | (21.012)                        | (0,00)               |
| MXN 128.272.271    | 30.10.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 9,26 %          | 1D TIIE + 24bps    | (22.827)                        | (0,00)               |
| CZK 136.810.493    | 11.07.2029 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 3,81 %          | 6M PRIBOR          | (35.055)                        | (0,00)               |
| MXN 106.623.448    | 27.07.2029 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 9,17 %          | 1D TIIE + 24bps    | (45.316)                        | (0,00)               |
| MXN 34.061.309     | 08.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 6,21 %          | 28D MXIBOR         | (51.977)                        | (0,00)               |
| MXN 141.097.429    | 08.10.2038 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 9,77 %          | 1D TIIE + 24bps    | (74.904)                        | (0,01)               |
| MXN 128.662.192    | 17.08.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 8,91 %          | 1D TIIE + 24bps    | (82.178)                        | (0,01)               |
| MXN 128.662.190    | 17.08.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 8,94 %          | 1D TIIE + 24bps    | (83.423)                        | (0,01)               |
| HUF 1.487.167.794  | 10.12.2034 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 6,48 %          | 6M BUBOR           | (99.775)                        | (0,01)               |
| HUF 2.808.613.723  | 11.12.2029 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 6,26 %          | 6M BUBOR           | (109.191)                       | (0,01)               |
| MXN 197.538.674    | 27.08.2029 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 9,07 %          | 1D TIIE + 24bps    | (123.589)                       | (0,01)               |
| MXN 60.000.000     | 08.04.2026 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 5,95 %          | 1D TIIE + 24bps    | (124.856)                       | (0,01)               |

## Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Zinsswap-Kontrakte (1,66 %) (31. Dezember 2023: (1,16 %)) (Fortsetzung)

|   | Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei                              | Erhalt/(Zahlung) <sup>#</sup> | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|-------------|------------|--|-------------------------------|-----------------|--------------------|---------------------------------|----------------------|
| MXN   | 328.685.527 | 11.12.2025 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 8,58 %          | 28D MXIBOR         | (166.497)                       | (0,01)               |
| MXN   | 39.280.990  | 17.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 0,00 %          | 28D MXIBOR         | (169.475)                       | (0,01)               |
| MXN   | 328.685.527 | 03.02.2028 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 8,58 %          | 1D TIIE + 24bps    | (171.703)                       | (0,02)               |
| MXN   | 94.552.835  | 05.03.2026 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 6,17 %          | 1D TIIE + 24bps    | (173.601)                       | (0,02)               |
| MXN   | 242.308.506 | 12.12.2025 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 8,04 %          | 28D MXIBOR         | (181.435)                       | (0,02)               |
| MXN   | 184.675.074 | 03.09.2029 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 8,80 %          | 1D TIIE + 24bps    | (207.929)                       | (0,02)               |
| MXN   | 95.000.000  | 16.09.2026 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 6,38 %          | 1D TIIE + 24bps    | (221.465)                       | (0,02)               |
| MXN   | 242.308.506 | 07.01.2028 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 8,04 %          | 1D TIIE + 24bps    | (229.607)                       | (0,02)               |
| MXN   | 60.000.000  | 17.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 0,00 %          | 28D MXIBOR         | (258.866)                       | (0,02)               |
| CZK   | 352.180.585 | 12.09.2029 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 3,19 %          | 6M PRIBOR          | (300.566)                       | (0,03)               |
| MXN   | 94.552.835  | 11.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 0,00 %          | 28D MXIBOR         | (401.571)                       | (0,04)               |
| MXN   | 95.000.000  | 10.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 0,00 %          | 28D MXIBOR         | (402.398)                       | (0,04)               |
| BRL   | 13.470.683  | 02.01.2029 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 10,29 %         | 1D BROIS           | (439.387)                       | (0,04)               |
| MXN   | 106.623.448 | 19.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 0,00 %          | 28D MXIBOR         | (462.436)                       | (0,04)               |
| MXN   | 115.453.272 | 15.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 0,00 %          | 28D MXIBOR         | (497.788)                       | (0,05)               |
| MXN   | 128.272.271 | 29.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 0,00 %          | 28D MXIBOR         | (569.988)                       | (0,05)               |
| BRL   | 67.694.701  | 02.01.2026 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 10,63 %         | 1D BROIS           | (573.035)                       | (0,05)               |
| MXN   | 141.097.429 | 19.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 0,00 %          | 1D TIIE + 24bps    | (609.303)                       | (0,06)               |
| BRL   | 65.515.347  | 02.01.2026 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 11,43 %         | 1D BROIS           | (662.478)                       | (0,06)               |
| BRL   | 34.188.359  | 02.01.2029 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 11,97 %         | 1D BROIS           | (718.696)                       | (0,07)               |
| BRL   | 86.253.227  | 04.01.2027 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 12,71 %         | 1D BROIS           | (754.439)                       | (0,07)               |
| MXN   | 184.675.074 | 29.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 0,00 %          | 28D MXIBOR         | (820.618)                       | (0,08)               |
| BRL   | 86.110.250  | 02.01.2026 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 11,60 %         | 1D BROIS           | (830.757)                       | (0,08)               |
| MXN   | 189.498.232 | 25.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 0,00 %          | 28D MXIBOR         | (835.723)                       | (0,08)               |
| BRL   | 105.671.287 | 04.01.2027 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 12,79 %         | 1D BROIS           | (855.501)                       | (0,08)               |
| BRL   | 40.209.304  | 02.01.2025 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 6,83 %          | 1D BROIS           | (860.335)                       | (0,08)               |
| MXN   | 197.538.674 | 22.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 0,00 %          | 28D MXIBOR         | (862.411)                       | (0,08)               |
| BRL   | 50.416.356  | 02.01.2029 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 12,28 %         | 1D BROIS           | (965.329)                       | (0,09)               |
| MXN   | 257.324.382 | 11.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 0,00 %          | 28D MXIBOR         | (1.092.872)                     | (0,10)               |
| BRL   | 34.373.160  | 02.01.2031 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 10,46 %         | 1D BROIS           | (1.712.698)                     | (0,16)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Zinsswapkontrakten <sup>∞</sup></b> |             |            |  |                               |                 |                    | <b>(17.894.200)</b>             | <b>(1,66)</b>        |

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

## Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

|   | Zeitwert<br>US\$     | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|---|----------------------|------------------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(37.425.529)</b>  | <b>(3,48)</b>                |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>1.019.768.826</b> | <b>94,74</b>                 |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>56.612.226</b>    | <b>5,26</b>                  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>1.076.381.052</b> | <b>100,00</b>                |

| Portfolioanalyse         |   | US\$                 | % des<br>Gesamtver-<br>mögens |
|--------------------------|---|----------------------|-------------------------------|
| *                        | Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 765.474.907          | 68,34                         |
| **                       | Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden             | 265.088.095          | 23,66                         |
| μ                        | Investmentfonds   | 4.040.368            | 0,36                          |
| ±                        | Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden                          | 170.988              | 0,02                          |
| ∞                        | OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap                            | (15.005.532)         | (1,34)                        |
| <b>Anlagen insgesamt</b> |   | <b>1.019.768.826</b> | <b>91,04</b>                  |

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                      | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 29,49 % (31. Dezember 2023: 28,11 %)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>Kolumbianischer Peso</b>                                      |  |         |                       |                  |                              |
| 5.383.000.000  | Asian Development Bank*                                    | 10,10 % | 23.01.2026            | 1.228.925        | 0,24                         |
| 2.293.000.000  | Asian Development Bank*                                    | 11,20 % | 31.01.2025            | 520.897          | 0,10                         |
| 4.129.000.000  | Asian Development Bank*                                    | 12,75 % | 03.03.2025            | 940.322          | 0,18                         |
| 2.561.000.000  | Asian Development Bank*                                    | 13,00 % | 07.03.2025            | 583.610          | 0,11                         |
| 14.336.000.000   | Empresas Publicas de Medellin ESP*                         | 8,38 %  | 08.11.2027            | 2.908.487        | 0,57                         |
| 3.260.000.000  | International Finance Corp*                                | 0,00 %  | 16.08.2028            | 519.871          | 0,10                         |
| <b>Kolumbianischer Peso insgesamt</b>                            |  |         |                       | <b>6.702.112</b> | <b>1,30</b>                  |
| <b>Euro</b>  |  |         |                       |                  |                              |
| 442.253  | NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance Plc*               | 7,13 %  | 19.07.2026            | 357.739          | 0,07                         |
| 821.000  | Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara* | 1,88 %  | 05.11.2031            | 725.080          | 0,14                         |
| <b>Euro insgesamt</b>  |  |         |                       | <b>1.082.819</b> | <b>0,21</b>                  |
| <b>Indische Rupie</b>  |  |         |                       |                  |                              |
| 61.900.000   | Asian Infrastructure Investment Bank*                      | 7,20 %  | 02.07.2031            | 729.063          | 0,14                         |
| <b>Indische Rupie insgesamt</b>                                  |  |         |                       | <b>729.063</b>   | <b>0,14</b>                  |
| <b>Mexikanischer Peso</b>  |  |         |                       |                  |                              |
| 12.000.000   | Asian Development Bank*                                    | 0,00 %  | 20.04.2043            | 98.405           | 0,02                         |
| 17.700.000   | Asian Infrastructure Investment Bank*                      | 0,00 %  | 08.02.2038            | 232.496          | 0,04                         |
| 46.510.400   | Comision Federal de Electricidad*                          | 7,35 %  | 25.11.2025            | 2.171.429        | 0,42                         |
| 43.963.800   | Comision Federal de Electricidad*                          | 8,18 %  | 23.12.2027            | 1.958.974        | 0,38                         |
| <b>Mexikanischer Peso insgesamt</b>                              |  |         |                       | <b>4.461.304</b> | <b>0,86</b>                  |
| <b>Pakistanische Rupie</b>                                       |  |         |                       |                  |                              |
| 400.000.000  | Citigroup Global Markets Holdings Inc*                     | 0,00 %  | 13.01.2025            | 1.432.701        | 0,28                         |
| 400.000.000  | Citigroup Global Markets Holdings Inc**                    | 0,00 %  | 13.01.2025            | 1.432.700        | 0,28                         |
| <b>Pakistanische Rupie insgesamt</b>                             |  |         |                       | <b>2.865.401</b> | <b>0,56</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 332.000  | 3R Lux Sarl**  | 9,75 %  | 05.02.2031            | 343.536          | 0,07                         |
| 400.000  | Abu Dhabi Commercial Bank PJSC*                            | 5,38 %  | 18.07.2028            | 404.944          | 0,08                         |
| 359.000  | Abu Dhabi Commercial Bank PJSC**                           | 8,00 %  | 31.12.2149            | 384.107          | 0,07                         |
| 1.439.000  | Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC*                          | 4,60 %  | 02.11.2047            | 1.268.500        | 0,24                         |
| 275.000  | Abu Dhabi Developmental Holding Co PJSC*                   | 5,25 %  | 02.10.2054            | 253.058          | 0,05                         |
| 200.000  | Abu Dhabi National Energy Co PJSC*                         | 2,00 %  | 29.04.2028            | 181.438          | 0,03                         |
| 351.000  | Abu Dhabi National Energy Co PJSC*                         | 4,70 %  | 24.04.2033            | 339.100          | 0,07                         |
| 200.000  | Abu Dhabi National Energy Co PJSC*                         | 4,75 %  | 09.03.2037            | 188.156          | 0,04                         |
| 300.000  | Access Bank Plc*   | 6,13 %  | 21.09.2026            | 287.473          | 0,06                         |

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 29,49 % (31. Dezember 2023: 28,11 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 200.000  | Access Bank Plc*  | 9,13 %  | 31.12.2149            | 197.638          | 0,04                         |
| 400.000  | Adani Ports & Special Economic Zone Ltd*  | 4,20 %  | 04.08.2027            | 362.093          | 0,07                         |
| 350.000  | Adani Ports & Special Economic Zone Ltd**   | 4,38 %  | 03.07.2029            | 301.544          | 0,06                         |
| 291.000  | Adnoc Murban Rsc Ltd*   | 5,13 %  | 11.09.2054            | 263.067          | 0,05                         |
| 400.000  | Aegea Finance Sarl**  | 9,00 %  | 20.01.2031            | 408.486          | 0,08                         |
| 362.000  | Aeropuerto Internacional de Tocumen SA**  | 5,13 %  | 11.08.2061            | 262.921          | 0,05                         |
| 419.000  | AES Andes SA**  | 8,15 %  | 10.06.2055            | 424.637          | 0,08                         |
| 300.000  | Africa Finance Corp*  | 2,88 %  | 28.04.2028            | 274.890          | 0,05                         |
| 200.000  | AIA Group Ltd*  | 3,20 %  | 16.09.2040            | 149.286          | 0,03                         |
| 250.000  | AIA Group Ltd**   | 5,38 %  | 05.04.2034            | 248.681          | 0,05                         |
| 600.000  | Akbank TAS**  | 9,37 %  | 31.12.2149            | 611.341          | 0,12                         |
| 200.000  | Aldar Investment Properties Sukuk Ltd*  | 4,88 %  | 24.05.2033            | 195.154          | 0,04                         |
| 600.000  | Alfa SAB de CV**  | 6,88 %  | 25.03.2044            | 626.769          | 0,12                         |
| 800.000  | Ambipar Lux Sarl**  | 9,88 %  | 06.02.2031            | 799.234          | 0,15                         |
| 300.000  | America Movil SAB de CV*  | 4,70 %  | 21.07.2032            | 286.718          | 0,06                         |
| 425.000  | Anglo American Capital Plc*   | 3,88 %  | 16.03.2029            | 403.845          | 0,08                         |
| 400.000  | AngloGold Ashanti Holdings Plc*   | 3,75 %  | 01.10.2030            | 362.026          | 0,07                         |
| 310.000  | Antofagasta Plc*  | 5,63 %  | 13.05.2032            | 307.182          | 0,06                         |
| 394.000  | Antofagasta Plc*  | 6,25 %  | 02.05.2034            | 400.321          | 0,08                         |
| 424.000  | Aragvi Finance International DAC**  | 11,13 % | 20.11.2029            | 420.138          | 0,08                         |
| 300.000  | Axis Bank Ltd*  | 4,10 %  | 31.12.2149            | 287.323          | 0,06                         |
| 240.000  | Banco BTG Pactual SA**  | 5,75 %  | 22.01.2030            | 232.032          | 0,04                         |
| 435.000  | Banco Davivienda SA**   | 6,65 %  | 31.12.2149            | 374.290          | 0,07                         |
| 200.000  | Banco de Chile**  | 2,99 %  | 09.12.2031            | 168.814          | 0,03                         |
| 250.000  | Banco de Credito del Peru SA**  | 3,13 %  | 01.07.2030            | 245.301          | 0,05                         |
| 212.000  | Banco de Credito e Inversiones SA**   | 7,50 %  | 31.12.2149            | 206.969          | 0,04                         |
| 627.000  | Banco de Credito e Inversiones SA**   | 8,75 %  | 31.12.2149            | 656.312          | 0,13                         |
| 200.000  | Banco Mercantil del Norte SA*   | 7,50 %  | 31.12.2149            | 193.679          | 0,04                         |
| 200.000  | Banco Santander Chile**   | 3,18 %  | 26.10.2031            | 175.243          | 0,03                         |
| 200.000  | Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand* | 5,62 %  | 10.12.2029            | 199.500          | 0,04                         |
| 390.000  | Bancolombia SA*   | 8,63 %  | 24.12.2034            | 408.714          | 0,08                         |
| 600.000  | Bangkok Bank PCL**  | 3,73 %  | 25.09.2034            | 544.248          | 0,11                         |
| 854.000  | Bangkok Bank PCL**  | 5,00 %  | 31.12.2149            | 847.467          | 0,16                         |
| 300.000  | Bank Hapoalim BM*   | 3,26 %  | 21.01.2032            | 282.688          | 0,05                         |
| 300.000  | Bank Leumi Le-Israel BM**   | 3,28 %  | 29.01.2031            | 289.477          | 0,06                         |
| 700.000  | Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT*   | 4,30 %  | 31.12.2149            | 669.338          | 0,13                         |
| 600.000  | Bank of East Asia Ltd**   | 6,75 %  | 27.06.2034            | 600.294          | 0,12                         |
| 1.708.000  | Banque Ouest Africaine de Developpement*  | 4,70 %  | 22.10.2031            | 1.544.203        | 0,30                         |
| 320.000  | Bapco Energies BSC Closed**   | 7,50 %  | 25.10.2027            | 329.811          | 0,06                         |

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 29,49 % (31. Dezember 2023: 28,11 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 470.000  | Bapco Energies BSC Closed**   | 8,38 %  | 07.11.2028            | 504.350          | 0,10                         |
| 550.000  | BBVA Bancomer SA**  | 5,13 %  | 18.01.2033            | 512.016          | 0,10                         |
| 208.000  | BBVA Bancomer SA**  | 8,13 %  | 08.01.2039            | 212.345          | 0,04                         |
| 267.000  | Bimbo Bakeries USA Inc**  | 5,38 %  | 09.01.2036            | 257.733          | 0,05                         |
| 800.000  | BOC Aviation Ltd*   | 3,00 %  | 11.09.2029            | 735.228          | 0,14                         |
| 274.000  | BOC Aviation Ltd**  | 3,50 %  | 18.09.2027            | 265.071          | 0,05                         |
| 350.000  | BOC Aviation Ltd*   | 4,50 %  | 23.05.2028            | 345.228          | 0,07                         |
| 370.000  | Braskem Idesa SAPI**  | 6,99 %  | 20.02.2032            | 272.338          | 0,05                         |
| 200.000  | Braskem Netherlands Finance BV**  | 4,50 %  | 31.01.2030            | 169.479          | 0,03                         |
| 200.000  | Braskem Netherlands Finance BV*   | 7,25 %  | 13.02.2033            | 185.075          | 0,04                         |
| 475.000  | Braskem Netherlands Finance BV**  | 8,50 %  | 12.01.2031            | 476.611          | 0,09                         |
| 418.800  | Brazil Minas SPE via State of Minas Gerais**                                  | 5,33 %  | 15.02.2028            | 416.744          | 0,08                         |
| 665.000  | BSF Finance*  | 5,50 %  | 23.11.2027            | 673.885          | 0,13                         |
| 200.000  | Buffalo Energy Mexico Holdings/Buffalo Energy Infrastructure/Buffalo Energy** | 7,88 %  | 15.02.2039            | 206.435          | 0,04                         |
| 600.000  | CAS Capital No 1 Ltd*   | 4,00 %  | 31.12.2149            | 575.080          | 0,11                         |
| 400.000  | CBQ Finance Ltd*  | 2,00 %  | 12.05.2026            | 382.446          | 0,07                         |
| 300.000  | Celulosa Arauco y Constitucion SA**   | 4,25 %  | 30.04.2029            | 281.770          | 0,05                         |
| 200.000  | Celulosa Arauco y Constitucion SA**   | 5,15 %  | 29.01.2050            | 168.854          | 0,03                         |
| 500.000  | Cemex SAB de CV**   | 5,13 %  | 31.12.2149            | 490.177          | 0,09                         |
| 200.000  | Cemex SAB de CV**   | 9,13 %  | 31.12.2149            | 206.438          | 0,04                         |
| 341.000  | Cencosud SA**   | 5,95 %  | 28.05.2031            | 340.706          | 0,07                         |
| 700.000  | Central American Bottling Corp/CBC Bottling Holdco SL/Beliv Holdco SL**       | 5,25 %  | 27.04.2029            | 664.263          | 0,12                         |
| 200.000  | CFAMC III Co Ltd*   | 4,25 %  | 07.11.2027            | 192.346          | 0,04                         |
| 300.000  | Champion Path Holdings Ltd**  | 4,85 %  | 27.01.2028            | 284.402          | 0,05                         |
| 300.000  | China Cinda Finance 2017 I Ltd*   | 4,75 %  | 08.02.2028            | 294.216          | 0,06                         |
| 300.000  | China Construction Bank Corp*   | 2,45 %  | 24.06.2030            | 296.161          | 0,06                         |
| 250.000  | China Overseas Grand Oceans Finance IV Cayman Ltd*                            | 2,45 %  | 09.02.2026            | 238.989          | 0,05                         |
| 410.000  | Cibanco SA Ibm/PLA Administradora Industrial S de RL de CV**                  | 4,96 %  | 18.07.2029            | 389.831          | 0,08                         |
| 200.000  | CK Hutchison International 23 Ltd*  | 4,88 %  | 21.04.2033            | 194.836          | 0,04                         |
| 750.000  | CK Hutchison International 24 Ltd**   | 5,50 %  | 26.04.2034            | 757.488          | 0,15                         |
| 150.000  | Coca-Cola Femsa SAB de CV*  | 1,85 %  | 01.09.2032            | 117.866          | 0,02                         |
| 300.000  | Colombia Telecomunicaciones SA ESP**  | 4,95 %  | 17.07.2030            | 252.190          | 0,05                         |
| 249.600  | Cometa Energia SA de CV**   | 6,38 %  | 24.04.2035            | 246.936          | 0,05                         |
| 669.000  | Comision Federal de Electricidad*   | 3,35 %  | 09.02.2031            | 554.849          | 0,11                         |
| 664.000  | Comision Federal de Electricidad*   | 4,69 %  | 15.05.2029            | 624.032          | 0,12                         |
| 275.000  | Comision Federal de Electricidad**  | 6,26 %  | 15.02.2052            | 232.829          | 0,04                         |
| 208.000  | Comision Federal de Electricidad**  | 6,45 %  | 24.01.2035            | 196.553          | 0,04                         |
| 800.000  | Commercial Bank PSQC*   | 4,50 %  | 31.12.2149            | 781.179          | 0,15                         |
| 480.000  | Compania de Minas Buenaventura SAA**  | 5,50 %  | 23.07.2026            | 479.964          | 0,09                         |
| 800.000  | Consolidated Energy Finance SA**  | 12,00 % | 15.02.2031            | 768.828          | 0,15                         |

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 29,49 % (31. Dezember 2023: 28,11 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 488.625  | Continuum Green Energy India Pvt/Co-Issuers**                                 | 7,50 %  | 26.06.2033            | 505.303          | 0,10                         |
| 200.000  | Corp Nacional del Cobre de Chile*   | 5,13 %  | 02.02.2033            | 189.683          | 0,04                         |
| 861.000  | Corp Nacional del Cobre de Chile*   | 5,95 %  | 08.01.2034            | 856.343          | 0,17                         |
| 200.000  | Corp Nacional del Cobre de Chile*   | 6,30 %  | 08.09.2053            | 196.071          | 0,04                         |
| 259.000  | Corp Nacional del Cobre de Chile**  | 6,44 %  | 26.01.2036            | 264.488          | 0,05                         |
| 308.000  | Cosan Luxembourg SA**   | 7,25 %  | 27.06.2031            | 302.758          | 0,06                         |
| 600.000  | CSN Resources SA**  | 4,63 %  | 10.06.2031            | 466.403          | 0,09                         |
| 344.000  | CT Trust**  | 5,13 %  | 03.02.2032            | 308.118          | 0,06                         |
| 300.000  | DIB Sukuk Ltd*  | 2,95 %  | 16.01.2026            | 293.196          | 0,06                         |
| 289.000  | DIB Sukuk Ltd*  | 4,80 %  | 16.08.2028            | 286.467          | 0,06                         |
| 692.000  | DIB Sukuk Ltd*  | 5,49 %  | 30.11.2027            | 700.462          | 0,14                         |
| 190.000  | Digicel Intermediate Holdings Ltd/Digicel International Finance Ltd/Difl US** | 12,00 % | 25.05.2027            | 188.076          | 0,04                         |
| 1.190.000  | DP World Ltd*   | 6,85 %  | 02.07.2037            | 1.297.464        | 0,25                         |
| 451.000  | Ecopetrol SA**  | 5,88 %  | 28.05.2045            | 311.053          | 0,06                         |
| 300.000  | Ecopetrol SA*   | 7,75 %  | 01.02.2032            | 291.373          | 0,06                         |
| 200.000  | Ecopetrol SA*   | 8,38 %  | 19.01.2036            | 193.044          | 0,04                         |
| 200.000  | EIG Pearl Holdings Sarl*  | 3,55 %  | 31.08.2036            | 171.362          | 0,03                         |
| 300.000  | EIG Pearl Holdings Sarl*  | 4,39 %  | 30.11.2046            | 233.150          | 0,04                         |
| 300.000  | Emaar Sukuk Ltd**   | 3,64 %  | 15.09.2026            | 292.593          | 0,06                         |
| 312.000  | Emirates NBD Bank PJSC**  | 5,14 %  | 26.11.2029            | 315.335          | 0,06                         |
| 720.000  | Emirates NBD Bank PJSC*   | 5,88 %  | 11.10.2028            | 742.722          | 0,14                         |
| 400.000  | Emirates NBD Bank PJSC*   | 6,13 %  | 31.12.2149            | 399.900          | 0,08                         |
| 550.000  | Empresa de los Ferrocarriles del Estado*                                      | 3,07 %  | 18.08.2050            | 332.882          | 0,06                         |
| 941.000  | Empresa de Transmision Electrica SA*  | 5,13 %  | 02.05.2049            | 672.641          | 0,13                         |
| 206.000  | Empresa Nacional del Petroleo**   | 4,50 %  | 14.09.2047            | 159.764          | 0,03                         |
| 200.000  | Empresa Nacional del Petroleo**   | 5,95 %  | 30.07.2034            | 199.100          | 0,04                         |
| 400.000  | Endeavour Mining Plc**  | 5,00 %  | 14.10.2026            | 389.450          | 0,08                         |
| 303.425  | Energiean Israel Finance Ltd**  | 4,88 %  | 30.03.2026            | 297.633          | 0,06                         |
| 100.000  | Energiean Israel Finance Ltd**  | 5,88 %  | 30.03.2031            | 88.425           | 0,02                         |
| 400.000  | EnfraGen Energia Sur SA/EnfraGen Spain SA/Prime Energia SpA**                 | 5,38 %  | 30.12.2030            | 341.527          | 0,07                         |
| 200.000  | Engie Energia Chile SA**  | 6,38 %  | 17.04.2034            | 201.048          | 0,04                         |
| 497.000  | FIEMEX Energia - Banco Actinver SA Institucion de Banca Multiple**            | 7,25 %  | 31.01.2041            | 487.408          | 0,09                         |
| 700.000  | First Abu Dhabi Bank PJSC*  | 6,32 %  | 04.04.2034            | 718.271          | 0,14                         |
| 1.300.000  | First Quantum Minerals Ltd**  | 8,63 %  | 01.06.2031            | 1.339.838        | 0,26                         |
| 700.000  | Fortune Star BVI Ltd**  | 5,05 %  | 27.01.2027            | 658.639          | 0,13                         |
| 300.000  | Franshion Brilliant Ltd*  | 4,25 %  | 23.07.2029            | 255.070          | 0,05                         |
| 360.000  | FS Luxembourg Sarl*   | 8,88 %  | 12.02.2031            | 365.544          | 0,07                         |
| 226.000  | FWD Group Holdings Ltd**  | 7,64 %  | 02.07.2031            | 241.555          | 0,05                         |
| 400.000  | FWD Group Holdings Ltd**  | 8,05 %  | 31.12.2149            | 399.250          | 0,08                         |
| 700.000  | Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd*   | 2,63 %  | 31.03.2036            | 571.106          | 0,11                         |

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                       | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 29,49 % (31. Dezember 2023: 28,11 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 719.792  | Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd*           | 2,94 % | 30.09.2040            | 569.899          | 0,11                         |
| 433.000  | GC Treasury Center Co Ltd*                  | 2,98 % | 18.03.2031            | 369.270          | 0,07                         |
| 400.000  | GENM Capital Labuan Ltd*                    | 3,88 % | 19.04.2031            | 353.953          | 0,07                         |
| 700.000  | Globe Telecom Inc*                          | 4,20 % | 31.12.2149            | 683.920          | 0,13                         |
| 200.000  | GLP China Holdings Ltd**                    | 2,95 % | 29.03.2026            | 180.480          | 0,03                         |
| 300.000  | GLP Pte Ltd**                               | 3,88 % | 04.06.2025            | 289.578          | 0,06                         |
| 200.000  | GLP Pte Ltd**                               | 4,50 % | 31.12.2149            | 116.392          | 0,02                         |
| 241.000  | Gohl Capital Ltd*                           | 4,25 % | 24.01.2027            | 234.622          | 0,05                         |
| 395.590  | Greenko Dutch BV**                          | 3,85 % | 29.03.2026            | 384.815          | 0,07                         |
| 417.500  | Greenko Power II Ltd*                       | 4,30 % | 13.12.2028            | 393.544          | 0,08                         |
| 427.000  | Greensaif Pipelines Bidco Sarl*             | 6,51 % | 23.02.2042            | 433.908          | 0,08                         |
| 300.000  | Grupo Aeromexico SAB de CV**                | 8,25 % | 15.11.2029            | 296.214          | 0,06                         |
| 350.000  | Grupo Aval Ltd*                             | 4,38 % | 04.02.2030            | 308.555          | 0,06                         |
| 500.000  | Hanwha Life Insurance Co Ltd**              | 3,38 % | 04.02.2032            | 479.967          | 0,09                         |
| 600.000  | HDFC Bank Ltd**                             | 3,70 % | 31.12.2149            | 562.815          | 0,11                         |
| 400.000  | Hunt Oil Co of Peru LLC Sucursal Del Peru** | 8,55 % | 18.09.2033            | 436.723          | 0,08                         |
| 200.000  | Hyundai Capital America**                   | 5,68 % | 26.06.2028            | 203.009          | 0,04                         |
| 300.000  | IHS Holding Ltd**                           | 6,25 % | 29.11.2028            | 284.232          | 0,05                         |
| 390.000  | IHS Holding Ltd**                           | 7,88 % | 29.05.2030            | 385.114          | 0,07                         |
| 400.000  | Indian Railway Finance Corp Ltd*            | 3,25 % | 13.02.2030            | 363.357          | 0,07                         |
| 400.000  | Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT**         | 3,54 % | 27.04.2032            | 354.583          | 0,07                         |
| 400.000  | InRetail Consumer**                         | 3,25 % | 22.03.2028            | 367.349          | 0,07                         |
| 440.000  | Investment Energy Resources Ltd*            | 6,25 % | 26.04.2029            | 424.234          | 0,08                         |
| 277.000  | IRB Infrastructure Developers Ltd**         | 7,11 % | 11.03.2032            | 280.438          | 0,05                         |
| 200.000  | Israel Discount Bank Ltd**                  | 5,38 % | 26.01.2028            | 199.753          | 0,04                         |
| 300.000  | JSW Steel Ltd**                             | 5,05 % | 05.04.2032            | 268.640          | 0,05                         |
| 400.000  | Kasikornbank PCL*                           | 3,34 % | 02.10.2031            | 383.057          | 0,07                         |
| 408.000  | Kasikornbank PCL*                           | 5,46 % | 07.03.2028            | 411.852          | 0,08                         |
| 200.000  | KazMunayGas National Co JSC*                | 3,50 % | 14.04.2033            | 166.024          | 0,03                         |
| 350.000  | KazMunayGas National Co JSC*                | 5,38 % | 24.04.2030            | 341.152          | 0,07                         |
| 1.885.000  | KazMunayGas National Co JSC*                | 5,75 % | 19.04.2047            | 1.630.554        | 0,32                         |
| 300.000  | Klabin Austria GmbH*                        | 7,00 % | 03.04.2049            | 304.031          | 0,06                         |
| 700.000  | Kookmin Bank**                              | 2,50 % | 04.11.2030            | 596.547          | 0,12                         |
| 400.000  | Kosmos Energy Ltd**                         | 7,50 % | 01.03.2028            | 379.227          | 0,07                         |
| 240.000  | Kosmos Energy Ltd**                         | 8,75 % | 01.10.2031            | 226.342          | 0,04                         |
| 500.000  | Las Vegas Sands Corp*                       | 3,90 % | 08.08.2029            | 465.144          | 0,09                         |
| 550.000  | Latam Airlines Group SA**                   | 7,88 % | 15.04.2030            | 557.485          | 0,11                         |
| 322.000  | LD Celulose International GmbH**            | 7,95 % | 26.01.2032            | 323.132          | 0,06                         |
| 500.000  | Lenovo Group Ltd*                           | 3,42 % | 02.11.2030            | 449.572          | 0,09                         |
| 256.985  | Leviathan Bond Ltd**                        | 6,50 % | 30.06.2027            | 249.256          | 0,05                         |

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                       | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 29,49 % (31. Dezember 2023: 28,11 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 700.000  | Limak Cimento Sanayi ve Ticaret AS**        | 9,75 % | 25.07.2029            | 690.176          | 0,13                         |
| 275.000  | Longfor Group Holdings Ltd**                | 3,95 % | 16.09.2029            | 206.830          | 0,04                         |
| 300.000  | MAF Global Securities Ltd**                 | 7,88 % | 31.12.2149            | 309.672          | 0,06                         |
| 300.000  | MARB BondCo Plc*                            | 3,95 % | 29.01.2031            | 251.527          | 0,05                         |
| 496.000  | Masdar Abu Dhabi Future Energy Co*          | 4,88 % | 25.07.2029            | 493.728          | 0,10                         |
| 227.000  | Mashreqbank PSC**                           | 7,13 % | 31.12.2149            | 234.212          | 0,05                         |
| 699.691  | MC Brazil Downstream Trading Sarl**         | 7,25 % | 30.06.2031            | 582.033          | 0,11                         |
| 550.000  | Medco Bell Pte Ltd**                        | 6,38 % | 30.01.2027            | 550.134          | 0,11                         |
| 600.000  | MEGlobal BV**                               | 2,63 % | 28.04.2028            | 543.638          | 0,11                         |
| 300.000  | MEGlobal Canada ULC*                        | 5,88 % | 18.05.2030            | 306.454          | 0,06                         |
| 200.000  | Meituan*                                    | 3,05 % | 28.10.2030            | 177.110          | 0,03                         |
| 600.000  | Melco Resorts Finance Ltd**                 | 5,63 % | 17.07.2027            | 581.246          | 0,11                         |
| 500.000  | Melco Resorts Finance Ltd*                  | 5,75 % | 21.07.2028            | 478.141          | 0,09                         |
| 200.000  | Melco Resorts Finance Ltd**                 | 7,63 % | 17.04.2032            | 201.016          | 0,04                         |
| 674.000  | Mersin Uluslararası Liman İşletmeciliği AS* | 8,25 % | 15.11.2028            | 698.969          | 0,14                         |
| 885.000  | Mexico City Airport Trust*                  | 5,50 % | 31.07.2047            | 715.287          | 0,14                         |
| 500.000  | MGM China Holdings Ltd**                    | 7,13 % | 26.06.2031            | 507.243          | 0,10                         |
| 250.000  | Millicom International Cellular SA**        | 4,50 % | 27.04.2031            | 219.295          | 0,04                         |
| 540.000  | Millicom International Cellular SA*         | 5,13 % | 15.01.2028            | 520.751          | 0,10                         |
| 180.000  | Millicom International Cellular SA*         | 6,25 % | 25.03.2029            | 177.235          | 0,03                         |
| 900.000  | Minera Mexico SA de CV**                    | 4,50 % | 26.01.2050            | 683.715          | 0,14                         |
| 600.000  | Minerva Luxembourg SA**                     | 8,88 % | 13.09.2033            | 623.085          | 0,12                         |
| 450.000  | Minsur SA**                                 | 4,50 % | 28.10.2031            | 399.587          | 0,08                         |
| 179.752  | MV24 Capital BV*                            | 6,75 % | 01.06.2034            | 170.606          | 0,03                         |
| 200.000  | MVM Energetika Zrt*                         | 6,50 % | 13.03.2031            | 201.714          | 0,04                         |
| 307.974  | Nakilat Inc**                               | 6,07 % | 31.12.2033            | 321.670          | 0,06                         |
| 597.000  | National Bank of Ras Al-Khaimah PSC*        | 5,38 % | 25.07.2029            | 605.740          | 0,12                         |
| 235.000  | Navoi Mining & Metallurgical Combinat*      | 6,95 % | 17.10.2031            | 232.344          | 0,04                         |
| 600.000  | NBK SPC Ltd**                               | 5,50 % | 06.06.2030            | 605.950          | 0,12                         |
| 700.000  | NBK Tier 1 Financing 2 Ltd*                 | 4,50 % | 31.12.2149            | 689.678          | 0,13                         |
| 652.000  | NewCo Holding USD 20 Sarl**                 | 9,38 % | 07.11.2029            | 650.044          | 0,13                         |
| 500.000  | Nexa Resources SA**                         | 6,75 % | 09.04.2034            | 509.684          | 0,10                         |
| 590.000  | Niagara Energy SAC**                        | 5,75 % | 03.10.2034            | 572.447          | 0,11                         |
| 200.000  | NWD Finance BVI Ltd*                        | 5,25 % | 31.12.2149            | 88.223           | 0,02                         |
| 469.000  | NWD MTN Ltd**                               | 4,13 % | 18.07.2029            | 285.230          | 0,06                         |
| 545.000  | Ooredoo International Finance Ltd*          | 2,63 % | 08.04.2031            | 473.923          | 0,09                         |
| 300.000  | Oryx Funding Ltd**                          | 5,80 % | 03.02.2031            | 298.697          | 0,06                         |
| 800.000  | Oversea-Chinese Banking Corp Ltd**          | 1,83 % | 10.09.2030            | 781.459          | 0,15                         |
| 394.000  | Oversea-Chinese Banking Corp Ltd*           | 4,60 % | 15.06.2032            | 390.246          | 0,08                         |
| 400.000  | Oztel Holdings SPC Ltd*                     | 6,63 % | 24.04.2028            | 413.078          | 0,08                         |

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung  | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 29,49 % (31. Dezember 2023: 28,11 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |        |                       |                  |                              |
| 318.000  | Pegasus Hava Tasimaciligi AS*                                    | 8,00 % | 11.09.2031            | 315.994          | 0,06                         |
| 339.000  | Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara*       | 4,38 % | 05.02.2050            | 254.120          | 0,05                         |
| 510.000  | Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara*       | 5,25 % | 15.05.2047            | 444.279          | 0,09                         |
| 1.230.000  | Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara*       | 6,15 % | 21.05.2048            | 1.199.062        | 0,23                         |
| 2.406.824  | Petroleos de Venezuela SA*                                       | 6,00 % | 16.05.2024            | 252.811          | 0,05                         |
| 12.004.188   | Petroleos de Venezuela SA**                                      | 6,00 % | 15.11.2026            | 1.260.911        | 0,24                         |
| 723.000  | Petroleos del Peru SA*   | 4,75 % | 19.06.2032            | 547.504          | 0,11                         |
| 1.870.000  | Petroleos del Peru SA*   | 5,63 % | 19.06.2047            | 1.200.190        | 0,23                         |
| 824.000  | Petroleos Mexicanos**  | 5,95 % | 28.01.2031            | 696.511          | 0,13                         |
| 530.000  | Petroleos Mexicanos**  | 6,75 % | 21.09.2047            | 364.755          | 0,07                         |
| 4.814.000  | Petroleos Mexicanos**  | 7,69 % | 23.01.2050            | 3.635.581        | 0,70                         |
| 300.000  | Power Finance Corp Ltd*  | 3,95 % | 23.04.2030            | 279.491          | 0,05                         |
| 600.000  | Prosus NV*   | 3,68 % | 21.01.2030            | 541.655          | 0,10                         |
| 600.000  | Prosus NV*   | 3,83 % | 08.02.2051            | 388.290          | 0,07                         |
| 550.000  | Prudential Funding Asia Plc*                                     | 2,95 % | 03.11.2033            | 501.035          | 0,10                         |
| 200.000  | QIB Sukuk Ltd*   | 4,49 % | 17.09.2029            | 197.996          | 0,04                         |
| 260.000  | QNB Bank AS**  | 7,25 % | 21.05.2029            | 271.055          | 0,05                         |
| 300.000  | Raizen Fuels Finance SA**  | 5,70 % | 17.01.2035            | 277.950          | 0,05                         |
| 214.000  | Raizen Fuels Finance SA**  | 6,95 % | 05.03.2054            | 211.244          | 0,04                         |
| 300.000  | REC Ltd*   | 2,25 % | 01.09.2026            | 286.065          | 0,06                         |
| 475.000  | Reliance Industries Ltd*   | 2,88 % | 12.01.2032            | 404.035          | 0,08                         |
| 359.000  | Reliance Industries Ltd*   | 3,63 % | 12.01.2052            | 248.173          | 0,05                         |
| 500.000  | ReNew Wind Energy AP2/ReNew Power Pvt Ltd other 9 Subsidiaries** | 4,50 % | 14.07.2028            | 464.831          | 0,09                         |
| 580.000  | SA Global Sukuk Ltd*   | 2,69 % | 17.06.2031            | 502.932          | 0,10                         |
| 300.000  | SABIC Capital I BV*  | 2,15 % | 14.09.2030            | 253.959          | 0,05                         |
| 285.000  | Sable International Finance Ltd**                                | 7,13 % | 15.10.2032            | 279.722          | 0,05                         |
| 644.089  | Samarco Mineracao SA**   | 9,00 % | 30.06.2031            | 630.350          | 0,12                         |
| 360.000  | Sands China Ltd**  | 3,80 % | 08.01.2026            | 353.289          | 0,07                         |
| 1.300.000  | Sands China Ltd**  | 5,40 % | 08.08.2028            | 1.286.318        | 0,25                         |
| 800.000  | Sasol Financing USA LLC*   | 6,50 % | 27.09.2028            | 771.270          | 0,15                         |
| 1.200.000  | Saudi Arabian Oil Co*  | 4,25 % | 16.04.2039            | 1.029.364        | 0,20                         |
| 895.000  | Saudi Arabian Oil Co*  | 4,38 % | 16.04.2049            | 715.284          | 0,14                         |
| 268.000  | Saudi Arabian Oil Co*  | 5,75 % | 17.07.2054            | 251.130          | 0,05                         |
| 750.000  | Saudi Electricity Sukuk Programme Co*                            | 5,19 % | 13.02.2034            | 748.228          | 0,14                         |
| 200.000  | Saudi Electricity Sukuk Programme Co*                            | 5,68 % | 11.04.2053            | 193.952          | 0,04                         |
| 900.000  | SEPLAT Energy Plc*   | 7,75 % | 01.04.2026            | 898.066          | 0,18                         |
| 313.000  | SF Holding Investment 2021 Ltd*                                  | 3,13 % | 17.11.2031            | 276.809          | 0,05                         |
| 1.000.000  | Shinhan Bank Co Ltd*   | 4,38 % | 13.04.2032            | 927.500          | 0,18                         |
| 725.000  | SierraCol Energy Andina LLC**                                    | 6,00 % | 15.06.2028            | 655.445          | 0,13                         |
| 400.000  | Sisecam UK Plc**   | 8,63 % | 02.05.2032            | 397.992          | 0,08                         |

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                              | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 29,49 % (31. Dezember 2023: 28,11 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 293.000  | SK Hynix Inc*                                      | 6,38 %  | 17.01.2028            | 302.320          | 0,06                         |
| 500.000  | SK Hynix Inc**                                     | 6,50 %  | 17.01.2033            | 528.744          | 0,10                         |
| 200.000  | SNB Sukuk Ltd*                                     | 2,34 %  | 19.01.2027            | 189.686          | 0,04                         |
| 1.831.000  | Southern Gas Corridor CJSC*                        | 6,88 %  | 24.03.2026            | 1.856.813        | 0,36                         |
| 348.000  | St Marys Cement Inc Canada**                       | 5,75 %  | 02.04.2034            | 336.040          | 0,06                         |
| 200.000  | Standard Chartered Plc*                            | 1,46 %  | 14.01.2027            | 192.695          | 0,04                         |
| 579.000  | Standard Chartered Plc*                            | 6,30 %  | 06.07.2034            | 601.434          | 0,12                         |
| 2.386.000  | State Oil Co of the Azerbaijan Republic*           | 6,95 %  | 18.03.2030            | 2.468.450        | 0,47                         |
| 500.000  | Stillwater Mining Co*                              | 4,00 %  | 16.11.2026            | 475.198          | 0,09                         |
| 300.000  | Studio City Finance Ltd*                           | 6,50 %  | 15.01.2028            | 292.776          | 0,06                         |
| 400.000  | Sun Hung Kai Properties Capital Market Ltd**       | 3,75 %  | 25.02.2029            | 380.082          | 0,07                         |
| 404.000  | Suzano Austria GmbH**                              | 7,00 %  | 16.03.2047            | 425.446          | 0,08                         |
| 1.144.000  | Telecom Argentina SA**                             | 9,50 %  | 18.07.2031            | 1.177.176        | 0,23                         |
| 326.000  | Telecommunications co Telekom Srbija AD Belgrade** | 7,00 %  | 28.10.2029            | 325.671          | 0,06                         |
| 425.000  | Telecomunicaciones Digitales SA**                  | 4,50 %  | 30.01.2030            | 386.680          | 0,07                         |
| 563.000  | Telefonica Celular del Paraguay SA**               | 5,88 %  | 15.04.2027            | 558.549          | 0,11                         |
| 200.000  | Tencent Holdings Ltd*                              | 3,24 %  | 03.06.2050            | 132.894          | 0,03                         |
| 200.000  | Tencent Holdings Ltd**                             | 3,68 %  | 22.04.2041            | 156.354          | 0,03                         |
| 600.000  | Tengizchevroil Finance Co International Ltd**      | 3,25 %  | 15.08.2030            | 510.616          | 0,10                         |
| 424.000  | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV*    | 4,10 %  | 01.10.2046            | 305.384          | 0,06                         |
| 753.000  | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV**   | 8,13 %  | 15.09.2031            | 842.538          | 0,16                         |
| 834.000  | Thaioil Treasury Center Co Ltd*                    | 3,75 %  | 18.06.2050            | 529.356          | 0,10                         |
| 173.454  | Tierra Mojada Luxembourg II Sarl**                 | 5,75 %  | 01.12.2040            | 158.859          | 0,03                         |
| 750.000  | TNB Global Ventures Capital Bhd*                   | 4,85 %  | 01.11.2028            | 745.486          | 0,14                         |
| 330.000  | Transportadora de Gas del Sur SA**                 | 8,50 %  | 24.07.2031            | 344.745          | 0,07                         |
| 700.000  | Trident Energy Finance Plc**                       | 12,50 % | 30.11.2029            | 735.635          | 0,14                         |
| 400.000  | Trust Fibra Uno**                                  | 4,87 %  | 15.01.2030            | 362.681          | 0,06                         |
| 200.000  | Trust Fibra Uno**                                  | 6,95 %  | 30.01.2044            | 173.152          | 0,03                         |
| 200.000  | TSMC Arizona Corp*                                 | 2,50 %  | 25.10.2031            | 171.274          | 0,03                         |
| 600.000  | TSMC Arizona Corp*                                 | 4,25 %  | 22.04.2032            | 575.305          | 0,11                         |
| 238.000  | Turk Telekomunikasyon AS**                         | 7,38 %  | 20.05.2029            | 242.688          | 0,05                         |
| 269.000  | Turkiye Garanti Bankasi AS*                        | 8,38 %  | 28.02.2034            | 274.611          | 0,05                         |
| 400.000  | Turkiye Is Bankasi AS**                            | 7,75 %  | 12.06.2029            | 412.762          | 0,08                         |
| 300.000  | Turkiye Vakiflar Bankasi TAO*                      | 9,00 %  | 12.10.2028            | 320.286          | 0,06                         |
| 200.000  | Turkiye Vakiflar Bankasi TAO**                     | 10,12 % | 31.12.2149            | 209.370          | 0,04                         |
| 245.000  | TVF Varlik Kiralama AS*                            | 6,95 %  | 23.01.2030            | 246.592          | 0,05                         |
| 955.000  | United Overseas Bank Ltd*                          | 2,00 %  | 14.10.2031            | 905.426          | 0,18                         |
| 428.000  | United Overseas Bank Ltd*                          | 3,86 %  | 07.10.2032            | 415.034          | 0,08                         |
| 250.000  | Vanke Real Estate Hong Kong Co Ltd*                | 3,98 %  | 09.11.2027            | 125.956          | 0,02                         |
| 600.000  | Vedanta Resources Finance II Plc**                 | 10,88 % | 17.09.2029            | 621.383          | 0,12                         |

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                           | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 29,49 % (31. Dezember 2023: 28,11 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                    |                              |
| 755.000  | Vista Energy Argentina SAU**                    | 7,63 %  | 10.12.2035            | 751.036            | 0,15                         |
| 100.000  | Vnesheconombank Via VEB Finance Plc*            | 6,80 %  | 22.11.2025            | 4.018              | 0,00                         |
| 800.000  | VTR Finance NV**                                | 6,38 %  | 15.07.2028            | 760.866            | 0,15                         |
| 600.000  | WE Soda Investments Holding Plc**               | 9,50 %  | 06.10.2028            | 617.700            | 0,12                         |
| 200.000  | Woori Bank**                                    | 6,38 %  | 31.12.2149            | 202.818            | 0,04                         |
| 1.200.000  | Wynn Macau Ltd*                                 | 5,63 %  | 26.08.2028            | 1.156.801          | 0,22                         |
| 316.000  | XP Inc**  | 6,75 %  | 02.07.2029            | 314.423            | 0,06                         |
| 400.000  | Yapi ve Kredi Bankasi AS**                      | 9,25 %  | 16.10.2028            | 431.894            | 0,08                         |
| 450.000  | Yapi ve Kredi Bankasi AS**                      | 9,25 %  | 17.01.2034            | 469.236            | 0,09                         |
| 229.000  | Yapi ve Kredi Bankasi AS**                      | 9,74 %  | 31.12.2149            | 236.345            | 0,05                         |
| 425.000  | Yinson Boronia Production BV*                   | 8,95 %  | 31.07.2042            | 443.897            | 0,09                         |
| 483.000  | YPF Energia Electrica SA**                      | 7,88 %  | 16.10.2032            | 478.160            | 0,09                         |
| 200.000  | YPF SA**  | 6,95 %  | 21.07.2027            | 195.922            | 0,04                         |
| 575.000  | YPF SA**  | 7,00 %  | 15.12.2047            | 509.120            | 0,10                         |
| 900.000  | YPF SA**  | 9,50 %  | 17.01.2031            | 963.458            | 0,19                         |
| 300.000  | Zorlu Enerji Elektrik Uretim AS*                | 11,00 % | 23.04.2030            | 302.665            | 0,06                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |   |         |                       | <b>136.402.478</b> | <b>26,42</b>                 |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>  |   |         |                       | <b>152.243.177</b> | <b>29,49</b>                 |
| <b>Staatsanleihen 58,98 % (31. Dezember 2023: 62,75 %)</b>                     |   |         |                       |                    |                              |
| <b>Chilenischer Peso</b>   |   |         |                       |                    |                              |
| 576.287.550  | Bonos de la Tesoreria de la Republica*          | 1,90 %  | 01.09.2030            | 559.729            | 0,11                         |
| 2.110.000.000  | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 4,70 %  | 01.09.2030            | 2.041.525          | 0,40                         |
| 420.000.000  | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 5,00 %  | 01.03.2035            | 401.672            | 0,08                         |
| 5.000.000  | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 5,10 %  | 15.07.2050            | 4.835              | 0,00                         |
| 865.000.000  | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 6,00 %  | 01.04.2033            | 887.174            | 0,17                         |
| 335.000.000  | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 7,00 %  | 01.05.2034            | 369.974            | 0,07                         |
| <b>Chilenischer Peso insgesamt</b>   |   |         |                       | <b>4.264.909</b>   | <b>0,83</b>                  |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi</b>  |   |         |                       |                    |                              |
| 28.960.000   | China Government Bond**                         | 1,87 %  | 15.09.2031            | 4.042.111          | 0,78                         |
| 15.870.000   | China Government Bond**                         | 2,05 %  | 15.04.2029            | 2.234.030          | 0,43                         |
| 15.600.000   | China Government Bond**                         | 2,12 %  | 25.06.2031            | 2.208.748          | 0,43                         |
| 1.000.000  | China Government Bond**                         | 2,19 %  | 25.09.2054            | 145.720            | 0,03                         |
| 1.000.000  | China Government Bond**                         | 2,25 %  | 29.08.2039            | 142.344            | 0,03                         |
| 3.370.000  | China Government Bond**                         | 2,28 %  | 25.03.2031            | 480.997            | 0,09                         |
| 7.000.000  | China Government Bond**                         | 2,40 %  | 15.07.2028            | 995.050            | 0,19                         |
| 800.000  | China Government Bond**                         | 2,47 %  | 25.07.2054            | 121.848            | 0,02                         |
| 2.300.000  | China Government Bond**                         | 2,60 %  | 15.09.2030            | 333.141            | 0,07                         |
| 6.800.000  | China Government Bond**                         | 2,62 %  | 25.06.2030            | 984.909            | 0,19                         |

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                      | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 58,98 % (31. Dezember 2023: 62,75 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                   |                              |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi (Fortsetzung)</b>                          |  |         |                       |                   |                              |
| 11.400.000   | China Government Bond**                    | 2,67 %  | 25.05.2033            | 1.680.009         | 0,33                         |
| 7.000.000  | China Government Bond**                    | 2,80 %  | 25.03.2030            | 1.022.185         | 0,20                         |
| 400.000  | China Government Bond**                    | 2,88 %  | 25.02.2033            | 59.788            | 0,01                         |
| 6.150.000  | China Government Bond**                    | 3,00 %  | 15.10.2053            | 1.035.666         | 0,20                         |
| 1.000.000  | China Government Bond**                    | 3,02 %  | 27.05.2031            | 149.401           | 0,03                         |
| 6.000.000  | China Government Bond**                    | 3,13 %  | 21.11.2029            | 890.942           | 0,17                         |
| 1.850.000  | China Government Bond**                    | 3,19 %  | 15.04.2053            | 319.090           | 0,06                         |
| 5.000.000  | China Government Bond**                    | 3,27 %  | 19.11.2030            | 755.588           | 0,15                         |
| 3.050.000  | China Government Bond**                    | 3,72 %  | 12.04.2051            | 564.713           | 0,11                         |
| 4.400.000  | China Government Bond**                    | 3,81 %  | 14.09.2050            | 822.109           | 0,16                         |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt</b>                              |  |         |                       | <b>18.988.389</b> | <b>3,68</b>                  |
| <b>Kolumbianischer Peso</b>  |  |         |                       |                   |                              |
| 3.359.700.000  | Colombian TES*                             | 5,75 %  | 03.11.2027            | 683.950           | 0,13                         |
| 19.813.600.000   | Colombian TES*                             | 6,00 %  | 28.04.2028            | 3.958.656         | 0,77                         |
| 2.356.900.000  | Colombian TES*                             | 7,00 %  | 26.03.2031            | 439.337           | 0,08                         |
| 9.225.500.000  | Colombian TES*                             | 7,00 %  | 30.06.2032            | 1.637.438         | 0,32                         |
| 3.417.700.000  | Colombian TES*                             | 7,25 %  | 18.10.2034            | 578.138           | 0,11                         |
| 6.013.100.000  | Colombian TES*                             | 7,75 %  | 18.09.2030            | 1.187.140         | 0,23                         |
| 9.014.600.000  | Colombian TES*                             | 9,25 %  | 28.05.2042            | 1.584.240         | 0,31                         |
| 10.484.100.000   | Colombian TES*                             | 13,25 % | 09.02.2033            | 2.574.265         | 0,50                         |
| <b>Kolumbianischer Peso insgesamt</b>                                    |  |         |                       | <b>12.643.164</b> | <b>2,45</b>                  |
| <b>Costa Rican Colón</b>   |  |         |                       |                   |                              |
| 144.500.000  | Costa Rica Government International Bond** | 10,58 % | 26.09.2029            | 336.945           | 0,07                         |
| <b>Total Costa Rican Colón</b>   |  |         |                       | <b>336.945</b>    | <b>0,07</b>                  |
| <b>Tschechische Krone</b>  |  |         |                       |                   |                              |
| 56.660.000   | Czech Republic Government Bond*            | 0,05 %  | 29.11.2029            | 1.951.747         | 0,38                         |
| 43.790.000   | Czech Republic Government Bond*            | 0,25 %  | 10.02.2027            | 1.683.165         | 0,33                         |
| 126.320.000  | Czech Republic Government Bond*            | 1,20 %  | 13.03.2031            | 4.436.400         | 0,86                         |
| 7.530.000  | Czech Republic Government Bond*            | 1,50 %  | 24.04.2040            | 211.582           | 0,04                         |
| 6.760.000  | Czech Republic Government Bond*            | 1,95 %  | 30.07.2037            | 215.368           | 0,04                         |
| 30.900.000   | Czech Republic Government Bond*            | 2,00 %  | 13.10.2033            | 1.079.017         | 0,21                         |
| 43.050.000   | Czech Republic Government Bond*            | 2,75 %  | 23.07.2029            | 1.698.908         | 0,33                         |
| 16.820.000   | Czech Republic Government Bond*            | 4,20 %  | 04.12.2036            | 689.527           | 0,13                         |
| 9.560.000  | Czech Republic Government Bond*            | 4,90 %  | 14.04.2034            | 418.337           | 0,08                         |
| 6.020.000  | Czech Republic Government Bond*            | 6,20 %  | 16.06.2031            | 280.988           | 0,05                         |
| <b>Tschechische Krone insgesamt</b>                                      |  |         |                       | <b>12.665.039</b> | <b>2,45</b>                  |

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                             | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 58,98 % (31. Dezember 2023: 62,75 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>Peso Dominikanische Republik</b>                                      |   |         |                       |                  |                              |
| 36.550.000   | Dominican Republic International Bond*            | 9,75 %  | 05.06.2026            | 602.951          | 0,12                         |
| 121.450.000  | Dominican Republic International Bond*            | 10,75 % | 01.06.2036            | 2.156.105        | 0,42                         |
| 50.200.000   | Dominican Republic International Bond*            | 11,25 % | 15.09.2035            | 904.129          | 0,17                         |
| 9.650.000  | Dominican Republic International Bond*            | 13,63 % | 03.02.2033            | 193.625          | 0,04                         |
| <b>Peso Dominikanische Republik insgesamt</b>                            |   |         |                       | <b>3.856.810</b> | <b>0,75</b>                  |
| <b>Ägyptisches Pfund</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 162.000.000  | Egypt Government Bond*                            | 25,32 % | 13.08.2027            | 3.161.521        | 0,61                         |
| <b>Ägyptisches Pfund insgesamt</b>                                       |   |         |                       | <b>3.161.521</b> | <b>0,61</b>                  |
| <b>Euro</b>  |   |         |                       |                  |                              |
| 331.739  | Argentine Republic Government International Bond* | 0,13 %  | 09.07.2030            | 256.093          | 0,05                         |
| 456.000  | Bank Gospodarstwa Krajowego*                      | 5,13 %  | 22.02.2033            | 522.358          | 0,10                         |
| 366.000  | Benin Government International Bond*              | 4,88 %  | 19.01.2032            | 344.633          | 0,07                         |
| 413.000  | Benin Government International Bond*              | 4,95 %  | 22.01.2035            | 363.257          | 0,07                         |
| 136.000  | Benin Government International Bond*              | 6,88 %  | 19.01.2052            | 118.790          | 0,02                         |
| 273.841  | Chile Government International Bond*              | 4,13 %  | 05.07.2034            | 293.487          | 0,06                         |
| 2.310.000  | Egypt Government International Bond*              | 6,38 %  | 11.04.2031            | 2.117.421        | 0,41                         |
| 478.000  | Indonesia Government International Bond*          | 3,65 %  | 10.09.2032            | 497.157          | 0,10                         |
| 600.000  | Ivory Coast Government International Bond*        | 4,88 %  | 30.01.2032            | 549.470          | 0,11                         |
| 100.000  | Ivory Coast Government International Bond*        | 5,88 %  | 17.10.2031            | 97.374           | 0,02                         |
| 2.093.000  | Ivory Coast Government International Bond*        | 6,63 %  | 22.03.2048            | 1.755.818        | 0,34                         |
| 2.400.000  | Ivory Coast Government International Bond*        | 6,88 %  | 17.10.2040            | 2.159.493        | 0,42                         |
| 202.000  | Magyar Export-Import Bank Zrt*                    | 4,50 %  | 27.11.2031            | 212.579          | 0,04                         |
| 181.000  | Magyar Export-Import Bank Zrt*                    | 6,00 %  | 16.05.2029            | 203.047          | 0,04                         |
| 545.000  | Peruvian Government International Bond*           | 1,25 %  | 11.03.2033            | 460.790          | 0,09                         |
| 835.000  | Peruvian Government International Bond*           | 1,95 %  | 17.11.2036            | 691.671          | 0,13                         |
| 400.000  | Philippine Government International Bond*         | 1,75 %  | 28.04.2041            | 299.808          | 0,06                         |
| 715.000  | Republic of Cameroon International Bond*          | 5,95 %  | 07.07.2032            | 601.345          | 0,12                         |
| 318.000  | Republic of Poland Government International Bond* | 3,13 %  | 22.10.2031            | 332.214          | 0,06                         |
| 1.179.000  | Romanian Government International Bond*           | 2,00 %  | 28.01.2032            | 974.862          | 0,19                         |
| 186.000  | Romanian Government International Bond*           | 2,63 %  | 02.12.2040            | 123.603          | 0,02                         |
| 322.000  | Romanian Government International Bond*           | 2,88 %  | 13.04.2042            | 217.467          | 0,04                         |
| 137.000  | Romanian Government International Bond*           | 3,38 %  | 28.01.2050            | 92.749           | 0,02                         |
| 1.314.000  | Romanian Government International Bond*           | 3,75 %  | 07.02.2034            | 1.171.452        | 0,23                         |
| 100.000  | Romanian Government International Bond*           | 3,88 %  | 29.10.2035            | 86.026           | 0,02                         |
| 435.000  | Romanian Government International Bond*           | 5,63 %  | 22.02.2036            | 433.793          | 0,08                         |
| 144.000  | Romanian Government International Bond*           | 6,38 %  | 18.09.2033            | 155.664          | 0,03                         |
| 200.000  | Senegal Government International Bond*            | 4,75 %  | 13.03.2028            | 191.004          | 0,04                         |
| 360.000  | Senegal Government International Bond*            | 5,38 %  | 08.06.2037            | 264.844          | 0,05                         |

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 58,98 % (31. Dezember 2023: 62,75 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                   |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |  |        |                       |                   |                              |
| 766.000  | Serbia International Bond*                           | 1,65 % | 03.03.2033            | 638.396           | 0,12                         |
| 472.000  | Serbia International Bond*                           | 2,05 % | 23.09.2036            | 372.872           | 0,07                         |
| 811.000  | Turkiye Government International Bond*               | 5,88 % | 21.05.2030            | 883.217           | 0,17                         |
| <b>Euro insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>17.482.754</b> | <b>3,39</b>                  |
| <b>Ghanaischer Cedi</b>  |  |        |                       |                   |                              |
| 1.597.243  | Republic of Ghana Government Bonds*                  | 8,35 % | 16.02.2027            | 81.058            | 0,02                         |
| 1.600.779  | Republic of Ghana Government Bonds*                  | 8,50 % | 15.02.2028            | 71.072            | 0,01                         |
| 1.497.368  | Republic of Ghana Government Bonds*                  | 8,65 % | 13.02.2029            | 59.349            | 0,01                         |
| 1.500.679  | Republic of Ghana Government Bonds*                  | 8,80 % | 12.02.2030            | 53.879            | 0,01                         |
| 1.503.995  | Republic of Ghana Government Bonds*                  | 8,95 % | 11.02.2031            | 49.975            | 0,01                         |
| 1.507.316  | Republic of Ghana Government Bonds*                  | 9,10 % | 10.02.2032            | 47.265            | 0,01                         |
| 1.510.642  | Republic of Ghana Government Bonds*                  | 9,25 % | 08.02.2033            | 44.484            | 0,01                         |
| <b>Ghanaischer Cedi insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>407.082</b>    | <b>0,08</b>                  |
| <b>Ungarischer Forint</b>  |  |        |                       |                   |                              |
| 224.470.000  | Hungary Government Bond*                             | 2,25 % | 20.04.2033            | 415.311           | 0,08                         |
| 167.210.000  | Hungary Government Bond*                             | 3,00 % | 27.10.2027            | 386.571           | 0,08                         |
| 247.970.000  | Hungary Government Bond*                             | 3,00 % | 21.08.2030            | 534.724           | 0,10                         |
| 492.660.000  | Hungary Government Bond*                             | 3,25 % | 22.10.2031            | 1.041.988         | 0,20                         |
| 123.420.000  | Hungary Government Bond*                             | 4,50 % | 23.03.2028            | 295.088           | 0,06                         |
| 921.120.000  | Hungary Government Bond*                             | 4,75 % | 24.11.2032            | 2.069.731         | 0,40                         |
| <b>Ungarischer Forint insgesamt</b>                                      |  |        |                       | <b>4.743.413</b>  | <b>0,92</b>                  |
| <b>Indische Rupie</b>  |  |        |                       |                   |                              |
| 450.000.000  | India Government Bond*                               | 7,02 % | 18.06.2031            | 5.316.464         | 1,03                         |
| 59.200.000   | India Government Bond*                               | 7,10 % | 08.04.2034            | 705.544           | 0,14                         |
| 570.370.000  | India Government Bond*                               | 7,18 % | 14.08.2033            | 6.814.555         | 1,32                         |
| 176.960.000  | India Government Bond*                               | 7,18 % | 24.07.2037            | 2.123.682         | 0,41                         |
| 289.450.000  | India Government Bond*                               | 7,30 % | 19.06.2053            | 3.522.914         | 0,68                         |
| 152.500.000  | International Bank for Reconstruction & Development* | 6,50 % | 17.04.2030            | 1.730.706         | 0,33                         |
| 242.600.000  | International Bank for Reconstruction & Development* | 6,75 % | 13.07.2029            | 2.786.987         | 0,54                         |
| <b>Indische Rupie insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>23.000.852</b> | <b>4,45</b>                  |
| <b>Indonesische Rupiah</b>   |  |        |                       |                   |                              |
| 8.000.000.000  | Indonesia Treasury Bond*                             | 6,25 % | 15.06.2036            | 471.385           | 0,09                         |
| 10.282.000.000   | Indonesia Treasury Bond*                             | 6,38 % | 15.08.2028            | 626.568           | 0,12                         |
| 2.100.000.000  | Indonesia Treasury Bond*                             | 6,38 % | 15.04.2032            | 124.563           | 0,02                         |
| 1.800.000.000  | Indonesia Treasury Bond*                             | 6,38 % | 15.07.2037            | 106.266           | 0,02                         |
| 11.348.000.000   | Indonesia Treasury Bond*                             | 6,50 % | 15.07.2030            | 688.251           | 0,13                         |

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                  | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 58,98 % (31. Dezember 2023: 62,75 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                   |                              |
| <b>Indonesische Rupie (Fortsetzung)</b>                                  |  |        |                       |                   |                              |
| 19.061.000.000   | Indonesia Treasury Bond*               | 6,63 % | 15.05.2033            | 1.157.879         | 0,22                         |
| 16.094.000.000   | Indonesia Treasury Bond*               | 6,63 % | 15.02.2034            | 973.755           | 0,19                         |
| 26.918.000.000   | Indonesia Treasury Bond*               | 6,75 % | 15.07.2035            | 1.640.013         | 0,32                         |
| 84.638.000.000   | Indonesia Treasury Bond*               | 6,88 % | 15.04.2029            | 5.234.611         | 1,01                         |
| 12.300.000.000   | Indonesia Treasury Bond*               | 7,00 % | 15.05.2027            | 766.717           | 0,15                         |
| 42.048.000.000   | Indonesia Treasury Bond*               | 7,00 % | 15.02.2033            | 2.606.328         | 0,50                         |
| 27.053.000.000   | Indonesia Treasury Bond*               | 7,13 % | 15.06.2038            | 1.685.333         | 0,33                         |
| 9.750.000.000  | Indonesia Treasury Bond*               | 7,13 % | 15.06.2042            | 607.647           | 0,12                         |
| 9.814.000.000  | Indonesia Treasury Bond*               | 7,13 % | 15.06.2043            | 611.183           | 0,12                         |
| 16.000.000.000   | Indonesia Treasury Bond*               | 7,50 % | 15.08.2032            | 1.013.051         | 0,20                         |
| 420.000.000  | Indonesia Treasury Bond*               | 7,50 % | 15.06.2035            | 26.940            | 0,01                         |
| 9.390.000.000  | Indonesia Treasury Bond*               | 7,50 % | 15.04.2040            | 605.283           | 0,12                         |
| 3.824.000.000  | Indonesia Treasury Bond*               | 8,25 % | 15.05.2029            | 249.267           | 0,05                         |
| 23.241.000.000   | Indonesia Treasury Bond*               | 8,25 % | 15.05.2036            | 1.583.439         | 0,31                         |
| 10.000.000.000   | Indonesia Treasury Bond*               | 8,38 % | 15.09.2026            | 637.718           | 0,12                         |
| 917.000.000  | Indonesia Treasury Bond*               | 8,38 % | 15.03.2034            | 62.310            | 0,01                         |
| 17.761.000.000   | Indonesia Treasury Bond*               | 8,75 % | 15.05.2031            | 1.199.976         | 0,23                         |
| <b>Indonesische Rupiah insgesamt</b>                                     |  |        |                       | <b>22.678.483</b> | <b>4,39</b>                  |
| <b>Malaysischer Ringgit</b>  |  |        |                       |                   |                              |
| 6.844.000  | Malaysia Government Bond**             | 2,63 % | 15.04.2031            | 1.432.916         | 0,28                         |
| 250.000  | Malaysia Government Bond**             | 3,58 % | 15.07.2032            | 55.054            | 0,01                         |
| 3.600.000  | Malaysia Government Bond**             | 3,76 % | 22.05.2040            | 782.834           | 0,15                         |
| 12.080.000   | Malaysia Government Bond**             | 3,83 % | 05.07.2034            | 2.700.781         | 0,52                         |
| 2.226.000  | Malaysia Government Bond**             | 4,05 % | 18.04.2039            | 502.069           | 0,10                         |
| 6.565.000  | Malaysia Government Bond**             | 4,07 % | 15.06.2050            | 1.447.945         | 0,28                         |
| 2.410.000  | Malaysia Government Bond**             | 4,25 % | 31.05.2035            | 556.873           | 0,11                         |
| 3.000.000  | Malaysia Government Bond**             | 4,50 % | 15.04.2030            | 696.670           | 0,13                         |
| 1.898.000  | Malaysia Government Bond**             | 4,64 % | 07.11.2033            | 449.524           | 0,09                         |
| 11.204.000   | Malaysia Government Bond**             | 4,70 % | 15.10.2042            | 2.704.327         | 0,52                         |
| 1.700.000  | Malaysia Government Bond**             | 4,76 % | 07.04.2037            | 410.074           | 0,08                         |
| 11.610.000   | Malaysia Government Bond**             | 4,89 % | 08.06.2038            | 2.841.258         | 0,55                         |
| 2.400.000  | Malaysia Government Bond**             | 4,94 % | 30.09.2043            | 595.507           | 0,12                         |
| 5.000.000  | Malaysia Government Investment Issue** | 4,37 % | 31.10.2028            | 1.148.170         | 0,22                         |
| <b>Malaysischer Ringgit insgesamt</b>                                    |  |        |                       | <b>16.324.002</b> | <b>3,16</b>                  |
| <b>Mexikanischer Peso</b>  |  |        |                       |                   |                              |
| 20.810.000   | Mexican Bonos*                         | 7,50 % | 26.05.2033            | 846.582           | 0,16                         |
| 151.094.600  | Mexican Bonos*                         | 7,75 % | 29.05.2031            | 6.486.611         | 1,26                         |

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                    | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 58,98 % (31. Dezember 2023: 62,75 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                   |                              |
| <b>Mexikanischer Peso (Fortsetzung)</b>                                  |  |         |                       |                   |                              |
| 48.068.300   | Mexican Bonos*                           | 7,75 %  | 13.11.2042            | 1.775.387         | 0,34                         |
| 17.050.800   | Mexican Bonos*                           | 8,00 %  | 07.11.2047            | 633.036           | 0,12                         |
| 43.480.100   | Mexican Bonos*                           | 8,50 %  | 31.05.2029            | 1.981.645         | 0,38                         |
| 38.862.000   | Mexican Bonos*                           | 8,50 %  | 18.11.2038            | 1.594.614         | 0,31                         |
| 4.890.000  | Mexican Bonos*                           | 10,00 % | 20.11.2036            | 228.783           | 0,05                         |
| <b>Mexikanischer Peso insgesamt</b>                                      |  |         |                       | <b>13.546.658</b> | <b>2,62</b>                  |
| <b>Peruanischer Sol</b>  |  |         |                       |                   |                              |
| 2.110.000  | Peru Government Bond*                    | 5,35 %  | 12.08.2040            | 470.448           | 0,09                         |
| 3.662.000  | Peru Government Bond*                    | 6,15 %  | 12.08.2032            | 967.088           | 0,18                         |
| 3.153.000  | Peruvian Government International Bond†  | 5,40 %  | 12.08.2034            | 765.578           | 0,15                         |
| 3.322.000  | Peruvian Government International Bond** | 6,90 %  | 12.08.2037            | 877.918           | 0,17                         |
| 6.967.000  | Peruvian Government International Bond†  | 6,95 %  | 12.08.2031            | 1.953.376         | 0,38                         |
| 2.000.000  | Peruvian Government International Bond** | 7,60 %  | 12.08.2039            | 557.704           | 0,11                         |
| <b>Peruanischer Sol insgesamt</b>  |  |         |                       | <b>5.592.112</b>  | <b>1,08</b>                  |
| <b>Philippinischer Peso</b>  |  |         |                       |                   |                              |
| 48.300.000   | Philippine Government Bond†              | 6,25 %  | 25.01.2034            | 839.424           | 0,16                         |
| 94.070.000   | Philippine Government Bond†              | 6,50 %  | 19.05.2029            | 1.648.100         | 0,32                         |
| 33.650.000   | Philippine Government Bond†              | 6,63 %  | 17.08.2033            | 597.272           | 0,12                         |
| 37.700.000   | Philippine Government Bond†              | 6,88 %  | 23.05.2044            | 690.304           | 0,13                         |
| 30.362.934   | Philippine Government Bond†              | 8,00 %  | 19.07.2031            | 576.026           | 0,11                         |
| <b>Philippinischer Peso insgesamt</b>                                    |  |         |                       | <b>4.351.126</b>  | <b>0,84</b>                  |
| <b>Polnischer Zloty</b>  |  |         |                       |                   |                              |
| 26.779.000   | Republic of Poland Government Bond*      | 1,75 %  | 25.04.2032            | 5.005.419         | 0,97                         |
| 12.606.000   | Republic of Poland Government Bond*      | 4,75 %  | 25.07.2029            | 2.967.605         | 0,58                         |
| 2.993.000  | Republic of Poland Government Bond*      | 5,00 %  | 25.10.2034            | 682.297           | 0,13                         |
| 6.036.000  | Republic of Poland Government Bond*      | 6,00 %  | 25.10.2033            | 1.484.928         | 0,29                         |
| 9.669.000  | Republic of Poland Government Bond*      | 7,50 %  | 25.07.2028            | 2.501.441         | 0,48                         |
| <b>Polnischer Zloty insgesamt</b>  |  |         |                       | <b>12.641.690</b> | <b>2,45</b>                  |
| <b>Rumänischer neuer Leu</b>   |  |         |                       |                   |                              |
| 7.325.000  | Romania Government Bond*                 | 4,75 %  | 11.10.2034            | 1.255.706         | 0,24                         |
| 95.000   | Romania Government Bond**                | 4,85 %  | 25.07.2029            | 18.051            | 0,00                         |
| 7.600.000  | Romania Government Bond*                 | 6,70 %  | 25.02.2032            | 1.533.236         | 0,30                         |
| 8.760.000  | Romania Government Bond*                 | 7,10 %  | 31.07.2034            | 1.789.429         | 0,34                         |
| 6.620.000  | Romania Government Bond*                 | 7,35 %  | 28.04.2031            | 1.381.222         | 0,27                         |
| 7.695.000  | Romania Government Bond*                 | 8,00 %  | 29.04.2030            | 1.654.437         | 0,32                         |

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                 | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 58,98 % (31. Dezember 2023: 62,75 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                   |                              |
| <b>Rumänischer neuer Leu (Fortsetzung)</b>                               |   |         |                       |                   |                              |
| 6.780.000  | Romania Government Bond <sup>†</sup>                  | 8,25 %  | 29.09.2032            | 1.488.871         | 0,29                         |
| 2.045.000  | Romania Government Bond <sup>†</sup>                  | 8,75 %  | 30.10.2028            | 447.968           | 0,09                         |
| <b>Rumänischer neuer Leu insgesamt</b>                                   |   |         |                       | <b>9.568.920</b>  | <b>1,85</b>                  |
| <b>Serbischer Dinar</b>  |   |         |                       |                   |                              |
| 15.020.000   | Serbia Treasury Bonds <sup>†</sup>                    | 4,50 %  | 11.01.2026            | 133.644           | 0,03                         |
| 24.630.000   | Serbia Treasury Bonds <sup>†</sup>                    | 4,50 %  | 20.08.2032            | 214.245           | 0,04                         |
| 46.430.000   | Serbia Treasury Bonds <sup>†</sup>                    | 5,88 %  | 08.02.2028            | 434.189           | 0,08                         |
| 23.560.000   | Serbia Treasury Bonds <sup>†</sup>                    | 7,00 %  | 26.10.2031            | 235.183           | 0,05                         |
| <b>Serbischer Dinar insgesamt</b>  |   |         |                       | <b>1.017.261</b>  | <b>0,20</b>                  |
| <b>Südafrikanischer Rand</b>   |   |         |                       |                   |                              |
| 69.463.155   | Republic of South Africa Government Bond <sup>†</sup> | 6,25 %  | 31.03.2036            | 2.657.969         | 0,52                         |
| 78.575.113   | Republic of South Africa Government Bond <sup>†</sup> | 6,50 %  | 28.02.2041            | 2.783.108         | 0,54                         |
| 131.439.970  | Republic of South Africa Government Bond <sup>†</sup> | 8,50 %  | 31.01.2037            | 5.919.702         | 1,15                         |
| 69.728.387   | Republic of South Africa Government Bond <sup>†</sup> | 8,75 %  | 31.01.2044            | 3.002.373         | 0,58                         |
| 24.356.863   | Republic of South Africa Government Bond <sup>†</sup> | 8,75 %  | 28.02.2048            | 1.039.157         | 0,20                         |
| 88.024.992   | Republic of South Africa Government Bond <sup>†</sup> | 9,00 %  | 31.01.2040            | 3.979.635         | 0,77                         |
| 52.162.123   | Republic of South Africa Government Bond <sup>†</sup> | 10,88 % | 31.03.2038            | 2.756.875         | 0,53                         |
| <b>Südafrikanischer Rand insgesamt</b>                                   |   |         |                       | <b>22.138.819</b> | <b>4,29</b>                  |
| <b>Thailändischer Baht</b>   |   |         |                       |                   |                              |
| 3.425.000  | Thailand Government Bond <sup>†</sup>                 | 1,59 %  | 17.12.2035            | 93.426            | 0,02                         |
| 24.588.000   | Thailand Government Bond <sup>**</sup>                | 2,00 %  | 17.06.2042            | 659.666           | 0,13                         |
| 30.019.000   | Thailand Government Bond <sup>**</sup>                | 2,80 %  | 17.06.2034            | 918.935           | 0,18                         |
| 8.831.000  | Thailand Government Bond <sup>**</sup>                | 2,88 %  | 17.06.2046            | 266.813           | 0,05                         |
| 44.284.000   | Thailand Government Bond <sup>**</sup>                | 3,30 %  | 17.06.2038            | 1.417.565         | 0,27                         |
| 21.990.000   | Thailand Government Bond <sup>**</sup>                | 3,35 %  | 17.06.2033            | 698.200           | 0,14                         |
| 48.502.000   | Thailand Government Bond <sup>**</sup>                | 3,39 %  | 17.06.2037            | 1.564.826         | 0,30                         |
| 16.578.000   | Thailand Government Bond <sup>**</sup>                | 3,40 %  | 17.06.2036            | 537.770           | 0,10                         |
| 100.832.000  | Thailand Government Bond <sup>**</sup>                | 3,45 %  | 17.06.2043            | 3.278.247         | 0,64                         |
| <b>Thailändischer Baht insgesamt</b>                                     |   |         |                       | <b>9.435.448</b>  | <b>1,83</b>                  |
| <b>Türkische Lira</b>  |   |         |                       |                   |                              |
| 12.481.091   | Turkiye Government Bond <sup>†</sup>                  | 17,80 % | 13.07.2033            | 244.486           | 0,05                         |
| 188.817.558  | Turkiye Government Bond <sup>†</sup>                  | 26,20 % | 05.10.2033            | 5.128.926         | 0,99                         |
| 92.486.997   | Turkiye Government Bond <sup>†</sup>                  | 31,08 % | 08.11.2028            | 2.588.696         | 0,50                         |
| <b>Türkische Lira insgesamt</b>  |   |         |                       | <b>7.962.108</b>  | <b>1,54</b>                  |

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                             | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 58,98 % (31. Dezember 2023: 62,75 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>Uganda-Schilling</b>  |   |         |                       |                  |                              |
| 5.469.700.000  | Republic of Uganda Government Bonds*              | 14,25 % | 22.06.2034            | 1.334.949        | 0,26                         |
| <b>Uganda-Schilling insgesamt</b>  |   |         |                       | <b>1.334.949</b> | <b>0,26</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 1.281.000  | Angolan Government International Bond*            | 8,75 %  | 14.04.2032            | 1.135.054        | 0,22                         |
| 310.000  | Angolan Government International Bond*            | 9,13 %  | 26.11.2049            | 249.456          | 0,05                         |
| 337.000  | Angolan Government International Bond*            | 9,38 %  | 08.05.2048            | 277.284          | 0,05                         |
| 2.183.508  | Argentine Republic Government International Bond* | 0,75 %  | 09.07.2030            | 1.688.289        | 0,33                         |
| 630.000  | Argentine Republic Government International Bond* | 1,00 %  | 09.07.2029            | 513.135          | 0,10                         |
| 2.197.000  | Argentine Republic Government International Bond* | 3,50 %  | 09.07.2041            | 1.376.790        | 0,27                         |
| 1.862.174  | Argentine Republic Government International Bond* | 4,13 %  | 09.07.2035            | 1.239.567        | 0,24                         |
| 1.820.000  | Argentine Republic Government International Bond* | 4,13 %  | 09.07.2046            | 1.212.071        | 0,23                         |
| 760.000  | Bahamas Government International Bond*            | 6,00 %  | 21.11.2028            | 727.700          | 0,14                         |
| 200.000  | Bahamas Government International Bond*            | 8,95 %  | 15.10.2032            | 207.409          | 0,04                         |
| 240.000  | Bank Gospodarstwa Krajowego*                      | 5,38 %  | 22.05.2033            | 234.551          | 0,05                         |
| 960.000  | Bank Gospodarstwa Krajowego**                     | 5,75 %  | 09.07.2034            | 955.142          | 0,18                         |
| 360.000  | Bank Gospodarstwa Krajowego**                     | 6,25 %  | 09.07.2054            | 353.500          | 0,07                         |
| 1.049.000  | Bermuda Government International Bond*            | 5,00 %  | 15.07.2032            | 1.014.383        | 0,20                         |
| 1.056.000  | Brazilian Government International Bond*          | 5,00 %  | 27.01.2045            | 779.465          | 0,15                         |
| 290.000  | Brazilian Government International Bond*          | 5,63 %  | 07.01.2041            | 244.249          | 0,05                         |
| 200.000  | Brazilian Government International Bond*          | 5,63 %  | 21.02.2047            | 157.527          | 0,03                         |
| 865.000  | Brazilian Government International Bond*          | 6,00 %  | 20.10.2033            | 809.057          | 0,16                         |
| 310.000  | Brazilian Government International Bond*          | 6,25 %  | 18.03.2031            | 302.752          | 0,06                         |
| 450.000  | Brazilian Government International Bond*          | 8,25 %  | 20.01.2034            | 491.844          | 0,10                         |
| 216.000  | Bulgaria Government International Bond*           | 5,00 %  | 05.03.2037            | 203.455          | 0,04                         |
| 417.000  | Chile Government International Bond*              | 3,25 %  | 21.09.2071            | 246.907          | 0,05                         |
| 250.000  | Colombia Government International Bond*           | 3,00 %  | 30.01.2030            | 207.687          | 0,04                         |
| 300.000  | Colombia Government International Bond*           | 5,00 %  | 15.06.2045            | 203.100          | 0,04                         |
| 1.653.000  | Colombia Government International Bond*           | 5,20 %  | 15.05.2049            | 1.114.535        | 0,22                         |
| 635.000  | Colombia Government International Bond*           | 6,13 %  | 18.01.2041            | 520.275          | 0,10                         |
| 1.310.000  | Colombia Government International Bond*           | 7,50 %  | 02.02.2034            | 1.292.315        | 0,25                         |
| 413.000  | Colombia Government International Bond*           | 7,75 %  | 07.11.2036            | 404.492          | 0,08                         |
| 825.000  | Colombia Government International Bond*           | 8,00 %  | 20.04.2033            | 845.006          | 0,16                         |
| 224.000  | Colombia Government International Bond**          | 8,00 %  | 14.11.2035            | 225.792          | 0,04                         |
| 346.000  | Colombia Government International Bond*           | 8,38 %  | 07.11.2054            | 336.277          | 0,07                         |
| 200.000  | Colombia Government International Bond*           | 8,75 %  | 14.11.2053            | 202.728          | 0,04                         |
| 395.000  | Costa Rica Government International Bond*         | 6,55 %  | 03.04.2034            | 402.357          | 0,08                         |
| 162.000  | Costa Rica Government International Bond*         | 7,16 %  | 12.03.2045            | 167.184          | 0,03                         |

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 58,98 % (31. Dezember 2023: 62,75 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 786.000  | Costa Rica Government International Bond <sup>†</sup>   | 7,30 %  | 13.11.2054            | 816.065          | 0,16                         |
| 200.000  | Development Bank of Kazakhstan JSC <sup>**</sup>        | 5,25 %  | 23.10.2029            | 199.150          | 0,04                         |
| 430.000  | Dominican Republic International Bond <sup>†</sup>      | 4,88 %  | 23.09.2032            | 384.850          | 0,07                         |
| 1.664.000  | Dominican Republic International Bond <sup>†</sup>      | 5,88 %  | 30.01.2060            | 1.411.488        | 0,28                         |
| 1.195.000  | Dominican Republic International Bond <sup>†</sup>      | 6,00 %  | 22.02.2033            | 1.150.785        | 0,22                         |
| 154.000  | Dominican Republic International Bond <sup>†</sup>      | 6,40 %  | 05.06.2049            | 145.183          | 0,03                         |
| 158.000  | Dominican Republic International Bond <sup>†</sup>      | 6,60 %  | 01.06.2036            | 157.131          | 0,03                         |
| 300.000  | Dominican Republic International Bond <sup>†</sup>      | 7,05 %  | 03.02.2031            | 307.950          | 0,06                         |
| 194.209  | Ecuador Government International Bond <sup>†</sup>      | 0,00 %  | 31.07.2030            | 106.625          | 0,02                         |
| 658.547  | Ecuador Government International Bond <sup>†</sup>      | 5,00 %  | 31.07.2040            | 339.823          | 0,07                         |
| 2.912.231  | Ecuador Government International Bond <sup>†</sup>      | 5,50 %  | 31.07.2035            | 1.661.292        | 0,32                         |
| 699.564  | Ecuador Government International Bond <sup>†</sup>      | 6,90 %  | 31.07.2030            | 488.916          | 0,09                         |
| 240.000  | Egypt Government International Bond <sup>†</sup>        | 8,15 %  | 20.11.2059            | 177.300          | 0,03                         |
| 1.950.000  | Egypt Government International Bond <sup>†</sup>        | 8,70 %  | 01.03.2049            | 1.538.751        | 0,30                         |
| 1.030.000  | Egypt Government International Bond <sup>†</sup>        | 8,88 %  | 29.05.2050            | 824.717          | 0,16                         |
| 150.000  | El Salvador Government International Bond <sup>†</sup>  | 7,12 %  | 20.01.2050            | 126.937          | 0,02                         |
| 390.000  | El Salvador Government International Bond <sup>**</sup> | 9,25 %  | 17.04.2030            | 413.887          | 0,08                         |
| 2.479.000  | El Salvador Government International Bond <sup>†</sup>  | 9,50 %  | 15.07.2052            | 2.592.662        | 0,50                         |
| 1.020.000  | Ethiopia International Bond <sup>†</sup>                | 6,63 %  | 11.12.2024            | 813.725          | 0,16                         |
| 159.808  | Ghana Government International Bond <sup>†</sup>        | 0,00 %  | 03.07.2026            | 148.905          | 0,03                         |
| 105.119  | Ghana Government International Bond <sup>†</sup>        | 0,00 %  | 03.01.2030            | 81.692           | 0,02                         |
| 1.458.548  | Ghana Government International Bond <sup>†</sup>        | 5,00 %  | 03.07.2029            | 1.263.290        | 0,24                         |
| 1.737.912  | Ghana Government International Bond <sup>†</sup>        | 5,00 %  | 03.07.2035            | 1.226.345        | 0,24                         |
| 203.000  | Guatemala Government Bond <sup>†</sup>                  | 3,70 %  | 07.10.2033            | 164.608          | 0,03                         |
| 200.000  | Guatemala Government Bond <sup>†</sup>                  | 5,25 %  | 10.08.2029            | 192.650          | 0,04                         |
| 200.000  | Guatemala Government Bond <sup>**</sup>                 | 6,05 %  | 06.08.2031            | 195.900          | 0,04                         |
| 200.000  | Guatemala Government Bond <sup>†</sup>                  | 6,13 %  | 01.06.2050            | 178.175          | 0,03                         |
| 200.000  | Guatemala Government Bond <sup>**</sup>                 | 6,55 %  | 06.02.2037            | 196.800          | 0,04                         |
| 853.000  | Guatemala Government Bond <sup>†</sup>                  | 6,60 %  | 13.06.2036            | 845.323          | 0,16                         |
| 335.000  | Guatemala Government Bond <sup>†</sup>                  | 7,05 %  | 04.10.2032            | 347.269          | 0,07                         |
| 286.000  | Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS <sup>**</sup>    | 6,50 %  | 26.04.2030            | 283.057          | 0,05                         |
| 401.000  | Honduras Government International Bond <sup>†</sup>     | 5,63 %  | 24.06.2030            | 359.296          | 0,07                         |
| 201.000  | Honduras Government International Bond <sup>†</sup>     | 6,25 %  | 19.01.2027            | 195.447          | 0,04                         |
| 217.000  | Honduras Government International Bond <sup>**</sup>    | 8,63 %  | 27.11.2034            | 215.861          | 0,04                         |
| 135.188  | Iraq International Bond <sup>†</sup>                    | 5,80 %  | 15.01.2028            | 131.727          | 0,03                         |
| 543.000  | Israel Government International Bond <sup>†</sup>       | 5,50 %  | 12.03.2034            | 532.471          | 0,10                         |
| 308.000  | Israel Government International Bond <sup>†</sup>       | 5,75 %  | 12.03.2054            | 282.166          | 0,05                         |
| 360.000  | Istanbul Metropolitan Municipality <sup>†</sup>         | 10,50 % | 06.12.2028            | 390.810          | 0,08                         |
| 315.000  | Lebanon Government International Bond <sup>†</sup>      | 6,38 %  | 09.03.2020            | 40.871           | 0,01                         |
| 7.131.000  | Lebanon Government International Bond <sup>†</sup>      | 8,25 %  | 17.05.2034            | 927.529          | 0,18                         |

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 58,98 % (31. Dezember 2023: 62,75 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 1.040.000  | Mexico Government International Bond*                   | 5,75 %  | 12.10.2110            | 799.864          | 0,15                         |
| 263.000  | Mongolia Government International Bond*                 | 7,88 %  | 05.06.2029            | 275.032          | 0,05                         |
| 1.143.000  | Mongolia Government International Bond*                 | 8,65 %  | 19.01.2028            | 1.203.865        | 0,23                         |
| 411.000  | Morocco Government International Bond*                  | 3,00 %  | 15.12.2032            | 336.075          | 0,07                         |
| 400.000  | Morocco Government International Bond*                  | 6,50 %  | 08.09.2033            | 413.111          | 0,08                         |
| 480.000  | Nigeria Government International Bond*                  | 7,70 %  | 23.02.2038            | 392.249          | 0,08                         |
| 827.000  | Nigeria Government International Bond*                  | 7,88 %  | 16.02.2032            | 745.734          | 0,14                         |
| 801.000  | Nigeria Government International Bond*                  | 8,25 %  | 28.09.2051            | 640.317          | 0,12                         |
| 806.000  | Nigeria Government International Bond*                  | 8,75 %  | 21.01.2031            | 777.185          | 0,15                         |
| 588.000  | Nigeria Government International Bond*                  | 9,25 %  | 21.01.2049            | 533.512          | 0,10                         |
| 200.000  | Nigeria Government International Bond*                  | 9,63 %  | 09.06.2031            | 199.849          | 0,04                         |
| 219.000  | Nigeria Government International Bond*                  | 10,38 % | 09.12.2034            | 223.806          | 0,04                         |
| 1.930.000  | Oman Government International Bond*                     | 6,75 %  | 17.01.2048            | 1.958.313        | 0,38                         |
| 316.000  | Oman Government International Bond*                     | 7,00 %  | 25.01.2051            | 331.656          | 0,06                         |
| 466.000  | Panama Government International Bond*                   | 4,50 %  | 01.04.2056            | 275.724          | 0,05                         |
| 380.000  | Panama Government International Bond*                   | 4,50 %  | 19.01.2063            | 223.722          | 0,04                         |
| 820.000  | Panama Government International Bond*                   | 6,40 %  | 14.02.2035            | 746.485          | 0,14                         |
| 200.000  | Panama Government International Bond*                   | 6,88 %  | 31.01.2036            | 188.211          | 0,04                         |
| 200.000  | Panama Government International Bond**                  | 7,50 %  | 01.03.2031            | 203.119          | 0,04                         |
| 200.000  | Panama Government International Bond**                  | 8,00 %  | 01.03.2038            | 200.981          | 0,04                         |
| 485.000  | Papua New Guinea Government International Bond*         | 8,38 %  | 04.10.2028            | 481.345          | 0,09                         |
| 230.000  | Paraguay Government International Bond*                 | 3,85 %  | 28.06.2033            | 199.468          | 0,04                         |
| 448.000  | Paraguay Government International Bond*                 | 5,40 %  | 30.03.2050            | 380.912          | 0,07                         |
| 423.000  | Paraguay Government International Bond*                 | 5,60 %  | 13.03.2048            | 370.019          | 0,07                         |
| 220.000  | Paraguay Government International Bond*                 | 6,10 %  | 11.08.2044            | 208.285          | 0,04                         |
| 312.142  | Provincia de Buenos Aires*                              | 6,63 %  | 01.09.2037            | 208.901          | 0,04                         |
| 121.057  | Provincia de Cordoba*                                   | 6,88 %  | 10.12.2025            | 119.611          | 0,02                         |
| 551.000  | Republic of Armenia International Bond*                 | 3,60 %  | 02.02.2031            | 455.309          | 0,09                         |
| 1.150.000  | Republic of Azerbaijan International Bond*              | 5,13 %  | 01.09.2029            | 1.114.767        | 0,22                         |
| 300.000  | Republic of Poland Government International Bond*       | 5,13 %  | 18.09.2034            | 290.959          | 0,06                         |
| 1.846.000  | Republic of South Africa Government International Bond* | 5,75 %  | 30.09.2049            | 1.385.940        | 0,27                         |
| 100.000  | Republic of South Africa Government International Bond* | 6,25 %  | 08.03.2041            | 86.421           | 0,02                         |
| 627.000  | Republic of South Africa Government International Bond* | 7,10 %  | 19.11.2036            | 612.103          | 0,12                         |
| 1.332.000  | Republic of South Africa Government International Bond* | 7,30 %  | 20.04.2052            | 1.209.662        | 0,23                         |
| 521.000  | Republic of South Africa Government International Bond* | 7,95 %  | 19.11.2054            | 500.513          | 0,10                         |
| 252.000  | Romanian Government International Bond*                 | 5,75 %  | 24.03.2035            | 225.240          | 0,04                         |
| 400.000  | Serbia International Bond*                              | 2,13 %  | 01.12.2030            | 325.547          | 0,06                         |
| 755.065  | Sri Lanka Government International Bond*                | 3,10 %  | 15.01.2030            | 626.704          | 0,12                         |
| 1.481.050  | Sri Lanka Government International Bond*                | 3,35 %  | 15.03.2033            | 1.127.523        | 0,22                         |
| 1.000.049  | Sri Lanka Government International Bond*                | 3,60 %  | 15.06.2035            | 725.036          | 0,14                         |

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                    | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|--|---------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 58,98 % (31. Dezember 2023: 62,75 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                    |                              |
| 694.056  | Sri Lanka Government International Bond* | 3,60 %  | 15.05.2036            | 529.218            | 0,10                         |
| 1.388.698  | Sri Lanka Government International Bond* | 3,60 %  | 15.02.2038            | 1.064.159          | 0,21                         |
| 950.603  | Sri Lanka Government International Bond* | 4,00 %  | 15.04.2028            | 892.426            | 0,17                         |
| 660.000  | Turkiye Government International Bond*   | 6,50 %  | 03.01.2035            | 618.179            | 0,12                         |
| 340.000  | Turkiye Government International Bond*   | 7,63 %  | 15.05.2034            | 345.937            | 0,07                         |
| 870.000  | Turkiye Government International Bond*   | 9,13 %  | 13.07.2030            | 963.366            | 0,19                         |
| 678.000  | Turkiye Government International Bond*   | 9,38 %  | 14.03.2029            | 748.922            | 0,15                         |
| 200.000  | Turkiye Ihracat Kredi Bankasi AS**       | 7,50 %  | 06.02.2028            | 204.034            | 0,04                         |
| 217.000  | Turkiye Ihracat Kredi Bankasi AS*        | 9,38 %  | 31.01.2026            | 225.814            | 0,04                         |
| 67.679   | Ukraine Government International Bond*   | 0,00 %  | 01.02.2030            | 37.156             | 0,01                         |
| 252.915  | Ukraine Government International Bond*   | 0,00 %  | 01.02.2034            | 105.281            | 0,02                         |
| 213.730  | Ukraine Government International Bond*   | 0,00 %  | 01.02.2035            | 126.738            | 0,02                         |
| 378.109  | Ukraine Government International Bond*   | 0,00 %  | 01.02.2036            | 223.053            | 0,04                         |
| 1.191.000  | Ukraine Government International Bond*   | 0,00 %  | 01.08.2041            | 922.272            | 0,18                         |
| 34.709   | Ukraine Government International Bond*   | 1,75 %  | 01.02.2029            | 24.215             | 0,00                         |
| 401.056  | Ukraine Government International Bond*   | 1,75 %  | 01.02.2034            | 227.098            | 0,04                         |
| 454.264  | Ukraine Government International Bond*   | 1,75 %  | 01.02.2035            | 250.859            | 0,05                         |
| 348.993  | Ukraine Government International Bond*   | 1,75 %  | 01.02.2036            | 189.995            | 0,04                         |
| 621.000  | Uzbekneftegaz JSC*                       | 4,75 %  | 16.11.2028            | 547.123            | 0,11                         |
| 5.326.600  | Venezuela Government International Bond* | 8,25 %  | 13.10.2024            | 752.382            | 0,15                         |
| 1.514.690  | Zambia Government International Bond*    | 0,50 %  | 31.12.2053            | 869.483            | 0,17                         |
| 1.684.666  | Zambia Government International Bond*    | 5,75 %  | 30.06.2033            | 1.481.169          | 0,29                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |  |         |                       | <b>74.870.718</b>  | <b>14,50</b>                 |
| <b>Uruguayischer Peso</b>  |  |         |                       |                    |                              |
| 21.798.998   | Uruguay Government International Bond*   | 8,25 %  | 21.05.2031            | 464.536            | 0,09                         |
| <b>Uruguayischer Peso insgesamt</b>                                      |  |         |                       | <b>464.536</b>     | <b>0,09</b>                  |
| <b>Sambischer Kwacha</b>   |  |         |                       |                    |                              |
| 39.014.000   | Zambia Government Bond*                  | 13,00 % | 25.01.2031            | 1.038.553          | 0,20                         |
| <b>Sambischer Kwacha insgesamt</b>                                       |  |         |                       | <b>1.038.553</b>   | <b>0,20</b>                  |
| <b>Staatsanleihen insgesamt</b>  |  |         |                       | <b>304.516.261</b> | <b>58,98</b>                 |
| <b>Investmentfonds 0,77 % (31. Dezember 2023: 2,72 %)</b>                |  |         |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |  |         |                       |                    |                              |
| 367.123  | Neuberger Berman China Bond Fund         |         |                       | 4.001.641          | 0,77                         |
| <b>Investmentfonds insgesamt #</b>                                       |  |         |                       | <b>4.001.641</b>   | <b>0,77</b>                  |
| <b>Anlagen insgesamt</b>   |  |         |                       | <b>460.761.079</b> | <b>89,24</b>                 |

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 0,77 % (31. Dezember 2023: 1,26 %)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 5.635.060.418 COP  | 1.276.810 US\$      | 13.01.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | 460                            | 0,00                 |
| 2.903.841.028 COP  | 653.515 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | 4.399                          | 0,00                 |
| 12.105.002.174 COP | 2.745.428 US\$      | 03.01.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | 2.250                          | 0,00                 |
| 22.072.490.977 COP | 4.964.102 US\$      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 3         | 36.789                         | 0,01                 |
| 98.612.937 EGP     | 1.862.980 US\$      | 17.03.2025       | Citibank NA                    | 1         | 24.770                         | 0,01                 |
| 1.285.951 €        | 531.987.984 HUF     | 19.03.2025       | BNP Paribas                    | 1         | 1.960                          | 0,00                 |
| 4.143.601 €        | 104.058.363 CZK     | 17.01.2025       | Citibank NA                    | 1         | 12.021                         | 0,00                 |
| 3.735.796 €        | 15.909.915 PLN      | 17.01.2025       | Citibank NA                    | 1         | 20.698                         | 0,00                 |
| 1.291.457 €        | 531.971.814 HUF     | 19.03.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | 7.721                          | 0,00                 |
| 3.761.131 €        | 1.550.606.865 HUF   | 19.03.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 19.133                         | 0,00                 |
| 3.254.283.192 HUF  | 7.854.296 €         | 19.03.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 622                            | 0,00                 |
| 16.618.258 MYR     | 3.699.770 US\$      | 19.03.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 28.470                         | 0,01                 |
| 969.811.532 NGN    | 584.224 US\$        | 20.05.2025       | Citibank NA                    | 1         | 1.745                          | 0,00                 |
| 476.211.482 NGN    | 268.288 US\$        | 10.02.2025       | Citibank NA                    | 1         | 32.382                         | 0,01                 |
| 1.418.098.767 NGN  | 722.782 US\$        | 28.11.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 59.545                         | 0,01                 |
| 637.021.586 NGN    | 374.719 US\$        | 10.02.2025       | Standard Chartered Bank        | 1         | 27.484                         | 0,01                 |
| 58.361.918 RON     | 11.646.817 €        | 17.01.2025       | BNP Paribas                    | 6         | 69.344                         | 0,01                 |
| 1.713.818 RON      | 341.499 €           | 17.01.2025       | Citibank NA                    | 1         | 2.568                          | 0,00                 |
| 2.135.954 RON      | 425.564 €           | 17.01.2025       | Deutsche Bank AG               | 1         | 3.254                          | 0,00                 |
| 12.051.491 RON     | 2.400.713 €         | 17.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 3         | 18.781                         | 0,00                 |
| 3.614.815 RON      | 723.113 €           | 17.01.2025       | Standard Chartered Bank        | 1         | 2.499                          | 0,00                 |
| 53.752.763 THB     | 1.559.401 US\$      | 09.01.2025       | Citibank NA                    | 1         | 17.712                         | 0,00                 |
| 9.154.144 THB      | 267.990 US\$        | 19.03.2025       | HSBC Bank Plc                  | 1         | 1.835                          | 0,00                 |
| 8.998.729 THB      | 263.425 US\$        | 02.01.2025       | Morgan Stanley                 | 1         | 506                            | 0,00                 |
| 25.068.870 THB     | 725.841 US\$        | 09.01.2025       | UBS AG                         | 1         | 9.683                          | 0,00                 |
| 21.518.650 TRY     | 541.991 US\$        | 09.01.2025       | Barclays Bank Plc              | 1         | 63.230                         | 0,01                 |
| 130.204.428 TRY    | 2.919.855 US\$      | 27.05.2025       | Goldman Sachs International    | 2         | 293.464                        | 0,06                 |
| 186.445.763 TRY    | 4.299.254 US\$      | 24.03.2025       | Goldman Sachs International    | 3         | 581.845                        | 0,11                 |
| 76.268.708 TRY     | 1.868.572 US\$      | 09.01.2025       | Goldman Sachs International    | 2         | 276.517                        | 0,05                 |
| 35.002.153 TRY     | 851.048 US\$        | 27.05.2025       | Morgan Stanley                 | 1         | 12.772                         | 0,00                 |
| 16.186.934 US\$    | 15.360.356 €        | 04.02.2025       | Barclays Bank Plc              | 1         | 260.389                        | 0,05                 |
| 344.967 US\$       | 2.496.154 CNY       | 13.02.2025       | Barclays Bank Plc              | 1         | 4.758                          | 0,00                 |
| 1.702.631 US\$     | 26.919.856.354 IDR  | 06.01.2025       | BNP Paribas                    | 2         | 33.049                         | 0,01                 |
| 1.297.119 US\$     | 9.427.798 CNY       | 06.01.2025       | BNP Paribas                    | 1         | 13.024                         | 0,00                 |
| 2.752.039 US\$     | 87.246.250 TWD      | 22.01.2025       | BNP Paribas                    | 1         | 98.382                         | 0,02                 |
| 1.304.027 US\$     | 5.759.235 MYR       | 14.02.2025       | BNP Paribas                    | 1         | 13.564                         | 0,00                 |
| 2.523.582 US\$     | 18.375.689 CNY      | 02.04.2025       | BNP Paribas                    | 1         | 14.850                         | 0,00                 |
| 4.251.087 US\$     | 141.740.675 THB     | 09.01.2025       | Citibank NA                    | 3         | 92.395                         | 0,02                 |
| 1.084.413 US\$     | 1.024.334 €         | 03.01.2025       | Citibank NA                    | 2         | 23.714                         | 0,01                 |
| 10.719.132 US\$    | 77.782.749 CNY      | 13.02.2025       | Citibank NA                    | 1         | 117.865                        | 0,02                 |
| 1.344.145 US\$     | 1.923.965.031 KRW   | 20.03.2025       | Citibank NA                    | 1         | 38.660                         | 0,01                 |

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 0,77 % (31. Dezember 2023: 1,26 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag              | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 2.585.936 US\$                  | 18.429.966 CNY      | 02.01.2025       | Citibank NA                    | 1         | 61.024                         | 0,01                 |
| 45.263 US\$                     | 327.942 CNY         | 19.03.2025       | Citibank NA                    | 1         | 516                            | 0,00                 |
| 2.199.761 US\$                  | 35.390.530.242 IDR  | 06.01.2025       | Citibank NA                    | 1         | 4.824                          | 0,00                 |
| 1.282.342 US\$                  | 5.635.060.418 COP   | 13.01.2025       | Citibank NA                    | 1         | 5.072                          | 0,00                 |
| 2.577.202 US\$                  | 3.468.378 SGD       | 20.03.2025       | Citibank NA                    | 2         | 26.971                         | 0,01                 |
| 2.610.625 US\$                  | 3.480.146 SGD       | 14.02.2025       | Citibank NA                    | 1         | 55.117                         | 0,01                 |
| 4.523.368 US\$                  | 264.069.699 PHP     | 19.03.2025       | Deutsche Bank AG               | 1         | 6.345                          | 0,00                 |
| 6.379.793 US\$                  | 544.694.003 INR     | 19.03.2025       | Deutsche Bank AG               | 1         | 61.204                         | 0,01                 |
| 2.750.799 US\$                  | 87.245.036 TWD      | 22.01.2025       | Deutsche Bank AG               | 2         | 97.179                         | 0,02                 |
| 18.576.403 US\$                 | 81.621.929.094 COP  | 16.01.2025       | Deutsche Bank AG               | 1         | 83.594                         | 0,02                 |
| 1.311.262 US\$                  | 9.402.987 CNY       | 13.02.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | 29.697                         | 0,01                 |
| 685.253 US\$                    | 58.571.996 INR      | 19.03.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | 5.803                          | 0,00                 |
| 1.287.213 US\$                  | 20.366.908.551 IDR  | 06.01.2025       | Goldman Sachs International    | 2         | 24.047                         | 0,01                 |
| 2.114.193 US\$                  | 2.067.345.799 CLP   | 19.03.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | 37.346                         | 0,01                 |
| 1.233.727 US\$                  | 1.767.176.297 KRW   | 20.03.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | 34.629                         | 0,01                 |
| 6.378.374 US\$                  | 544.694.003 INR     | 19.03.2025       | HSBC Bank Plc                  | 1         | 59.785                         | 0,01                 |
| 493.079 US\$                    | 702.671.902 KRW     | 19.03.2025       | HSBC Bank Plc                  | 1         | 16.302                         | 0,00                 |
| 2.290.326 US\$                  | 36.498.997.356 IDR  | 19.03.2025       | HSBC Bank Plc                  | 1         | 48.166                         | 0,01                 |
| 3.769.205 US\$                  | 58.583.060.475 IDR  | 06.01.2025       | HSBC Bank Plc                  | 1         | 135.857                        | 0,03                 |
| 1.368.861 US\$                  | 6.104.711 MYR       | 26.02.2025       | HSBC Bank Plc                  | 1         | 350                            | 0,00                 |
| 2.607.765 US\$                  | 11.527.625 MYR      | 14.02.2025       | HSBC Bank Plc                  | 1         | 24.787                         | 0,01                 |
| 461.416 US\$                    | 14.817.086 THB      | 02.01.2025       | HSBC Bank Plc                  | 1         | 26.834                         | 0,01                 |
| 2.579.973 US\$                  | 18.413.269 CNY      | 06.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 45.301                         | 0,01                 |
| 1.341.379 US\$                  | 45.677.991 THB      | 21.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 330                            | 0,00                 |
| 2.844.602 US\$                  | 92.762.482 THB      | 02.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 123.896                        | 0,02                 |
| 7.700.543 US\$                  | 7.262.922 €         | 15.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 176.094                        | 0,03                 |
| 2.208.789 US\$                  | 13.622.505 BRL      | 05.03.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | 28.724                         | 0,01                 |
| 4.512.990 US\$                  | 4.296.693 €         | 03.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 3         | 63.764                         | 0,01                 |
| 612.533 US\$                    | 788.943.062 NGN     | 10.02.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 114.411                        | 0,02                 |
| 1.370.034 US\$                  | 6.079.114 MYR       | 06.03.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 6.845                          | 0,00                 |
| 1.366.511 US\$                  | 45.648.294 THB      | 09.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 27.183                         | 0,01                 |
| 2.622.781 US\$                  | 18.806.051 CNY      | 13.02.2025       | Standard Chartered Bank        | 1         | 59.643                         | 0,01                 |
| 1.297.539 US\$                  | 9.427.798 CNY       | 19.03.2025       | Standard Chartered Bank        | 1         | 11.132                         | 0,00                 |
| 267.787 US\$                    | 255.172 €           | 03.01.2025       | Standard Chartered Bank        | 1         | 3.556                          | 0,00                 |
| 1.305.502 US\$                  | 1.740.153 SGD       | 14.02.2025       | Standard Chartered Bank        | 1         | 27.689                         | 0,01                 |
| 980.588 US\$                    | 7.166.892 CNY       | 02.01.2025       | Standard Chartered Bank        | 1         | 4.372                          | 0,00                 |
| 816.985 US\$                    | 16.704.492 MXN      | 04.02.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 18.316                         | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 3.590.735 US\$                  | 3.435.372 €         | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp           | 21        | 22.738                         | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 44 £                            | 54 US\$             | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp           | 2         | 0                              | 0,00                 |

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 0,77 % (31. Dezember 2023: 1,26 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen GBP (Fortsetzung)</i>                                   |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 2.496.044 US\$  | 1.955.106 £         | 13.03.2025       | Citibank NA                 | 2         | 48.746                         | 0,01                 |
| 11.987 US\$   | 9.522 £             | 13.03.2025       | Goldman Sachs International | 1         | 68                             | 0,00                 |
| 11.643 US\$   | 9.253 £             | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 9         | 61                             | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen SEK</i>   |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 163 SEK   | 15 US\$             | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | 0                              | 0,00                 |
| 363.262 US\$  | 3.939.875 SEK       | 13.03.2025       | Goldman Sachs International | 2         | 5.355                          | 0,00                 |
| 33.069 US\$   | 362.273 SEK         | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 10        | 159                            | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>   |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 5 US\$  | 6 SGD               | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | 0                              | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>3.978.941</b>               | <b>0,77</b>          |

### Futures-Kontrakte 0,10 % (31. Dezember 2023: 0,23 %)

| Anzahl Kontrakte   | Beschreibung                                     | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |             |
|--|--|--------------------------------|----------------------|-------------|
| (64)   | Euro-Bund Future March 2025                      | 229.300                        | 0,04                 |             |
| (24)   | Euro-Buxl 30-Year Bond Future March 2025         | 213.230                        | 0,04                 |             |
| (25)   | US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2025 | 24.531                         | 0,01                 |             |
| 23   | US Treasury 2-Year Note (CBT) Future March 2025  | 2.696                          | 0,00                 |             |
| (7)  | US Treasury Long Bond (CBT) Future March 2025    | 22.422                         | 0,00                 |             |
| (7)  | US Treasury Ultra Bond (CBT) Future March 2025   | 23.780                         | 0,01                 |             |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten <sup>*</sup></b> |  |                                | <b>515.959</b>       | <b>0,10</b> |

### Zinsswap-Kontrakte 0,69 % (31. Dezember 2023: 0,50 %)

| Nominalwert       | Fälligkeit | Gegenpartei                              | Erhalt/(Zahlung) <sup>#</sup> | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------------|------------|--|-------------------------------|-----------------|--------------------|--------------------------------|----------------------|
| CLP 3.154.502.226 | 05.06.2030 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt                        | 2,33 %          | 1D CLICP           | 446.938                        | 0,09                 |
| MXN 89.792.389    | 29.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 0,00 %          | 1D TIIE + 24bps    | 397.950                        | 0,08                 |
| MXN 80.184.016    | 31.08.2029 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt                        | 6,92 %          | 28D MXIBOR         | 268.647                        | 0,05                 |
| MXN 60.000.000    | 10.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 0,00 %          | 1D TIIE + 24bps    | 253.196                        | 0,05                 |
| MXN 56.934.366    | 19.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 0,00 %          | 1D TIIE + 24bps    | 245.860                        | 0,05                 |
| MXN 63.783.049    | 01.01.2032 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt                        | 7,64 %          | 28D MXIBOR         | 243.322                        | 0,05                 |
| MXN 45.745.846    | 25.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 0,00 %          | 1D TIIE + 24bps    | 201.119                        | 0,04                 |
| MXN 37.080.494    | 11.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 0,00 %          | 1D TIIE + 24bps    | 156.817                        | 0,03                 |
| MXN 35.056.640    | 22.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 0,00 %          | 1D TIIE + 24bps    | 153.058                        | 0,03                 |
| BRL 3.954.742     | 02.01.2031 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 11,49 %         | 1D BROIS           | 144.577                        | 0,03                 |
| MXN 29.184.713    | 29.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 0,00 %          | 1D TIIE + 24bps    | 129.343                        | 0,03                 |
| MXN 29.276.180    | 19.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 0,00 %          | 28D MXIBOR         | 126.974                        | 0,02                 |
| MXN 27.580.600    | 11.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 0,00 %          | 1D TIIE + 24bps    | 116.641                        | 0,02                 |
| MXN 27.580.600    | 11.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 0,00 %          | 1D TIIE + 24bps    | 116.641                        | 0,02                 |
| MXN 26.220.027    | 19.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 0,00 %          | 1D TIIE + 24bps    | 113.226                        | 0,02                 |

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Zinsswap-Kontrakte 0,69 % (31. Dezember 2023: 0,50 %) (Fortsetzung)

|  | Nominalwert   | Fälligkeit | Gegenpartei                              | Erhalt/(Zahlung) <sup>#</sup> | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------|------------|--|-------------------------------|-----------------|--------------------|--------------------------------|----------------------|
| MXN  | 24.807.076    | 15.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 0,00 %          | 1D TIIE + 24bps    | 106.081                        | 0,02                 |
| MXN  | 80.184.016    | 26.12.2025 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt                        | 6,92 %          | 28D MXIBOR         | 101.929                        | 0,02                 |
| MXN  | 18.899.906    | 17.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 0,00 %          | 1D TIIE + 24bps    | 81.242                         | 0,02                 |
| MXN  | 17.665.108    | 08.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 0,00 %          | 1D TIIE + 24bps    | 74.158                         | 0,01                 |
| MXN  | 63.783.049    | 11.12.2025 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt                        | 7,64 %          | 1D TIIE + 24bps    | 58.550                         | 0,01                 |
| MXN  | 45.745.846    | 13.05.2027 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 9,69 %          | 1D TIIE + 24bps    | 15.302                         | 0,00                 |
| CNY  | 20.716.460    | 19.09.2029 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 1,64 %          | 7D CNRR            | 4.325                          | 0,00                 |
| CNY  | 20.472.751    | 19.09.2029 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 1,65 %          | 7D CNRR            | 4.309                          | 0,00                 |
| CNY  | 20.823.205    | 11.12.2029 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 1,49 %          | 7D CNRR            | 1.650                          | 0,00                 |
| CNY  | 20.714.171    | 11.12.2029 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 1,48 %          | 7D CNRR            | 1.596                          | 0,00                 |
| MXN  | 37.047.081    | 20.03.2025 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt                        | 10,05 %         | 28D MXIBOR         | 649                            | 0,00                 |
| CLP  | 4.547.153.086 | 02.05.2027 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 5,36 %          | 1D CLICP           | 32                             | 0,00                 |
| COP  | 4.561.437.866 | 15.10.2034 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 7,95 %          | 1D COOVIBR         | 19                             | 0,00                 |
| COP  | 2.463.882.748 | 08.08.2034 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 7,81 %          | 1D COOVIBR         | 11                             | 0,00                 |
| KRW  | 2.185.183.803 | 19.12.2034 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 2,67 %          | 3M KWDCD           | 10                             | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Zinsswapkontrakten <sup>∞</sup></b> |               |            |  |                               |                 |                    | <b>3.564.172</b>               | <b>0,69</b>          |

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

### Credit-Default-Swap-Kontrakten 0,11 % (31. Dezember 2023: 0,00 %)

|   | Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei                 | Referenzverbindlichkeit                   | Zeitwert US\$  | % des Nettovermögens |
|---|-------------|------------|-----------------------------|---|----------------|----------------------|
| USD   | 17.972.784  | 20.12.2029 | ICE Clear U.S. <sup>1</sup> | Buying default protection on CDX.EM.42.V1 | 563.137        | 0,11                 |
| <b>Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt <sup>±</sup></b> |             |            |                             |   | <b>563.137</b> | <b>0,11</b>          |

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

|  | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens |
|--|--------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> | <b>469.383.288</b> | <b>90,91</b>         |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (1,74 %) (31. Dezember 2023: (0,39 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 4.974.977 BRL      | 810.977 US\$        | 05.03.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (14.811)                        | (0,00)               |
| 166.432.155 BRL    | 28.278.337 US\$     | 05.03.2025       | Morgan Stanley              | 1         | (1.643.525)                     | (0,32)               |
| 1.920.239 CNY      | 264.273 US\$        | 19.03.2025       | Barclays Bank Plc           | 1         | (2.259)                         | (0,00)               |
| 28.287.492 CNY     | 3.904.273 US\$      | 19.03.2025       | Citibank NA                 | 1         | (44.496)                        | (0,01)               |

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (1,74 %) (31. Dezember 2023: (0,39 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 4.822.715 CNY      | 666.687 US\$        | 13.02.2025       | HSBC Bank Plc                  | 1         | (9.383)                         | (0,00)               |
| 9.427.798 CNY      | 1.293.893 US\$      | 06.01.2025       | Standard Chartered Bank        | 1         | (9.798)                         | (0,00)               |
| 7.166.892 CNY      | 982.940 US\$        | 19.03.2025       | Standard Chartered Bank        | 1         | (5.031)                         | (0,00)               |
| 18.429.966 CNY     | 2.563.670 US\$      | 02.01.2025       | Citibank NA                    | 1         | (38.757)                        | (0,01)               |
| 9.190.995.744 COP  | 2.090.763 US\$      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | (8.390)                         | (0,00)               |
| 2.225.680 €        | 11.125.097 RON      | 17.01.2025       | Barclays Bank Plc              | 2         | (7.484)                         | (0,00)               |
| 3.069.097 €        | 15.349.090 RON      | 17.01.2025       | BNP Paribas                    | 3         | (12.017)                        | (0,00)               |
| 2.584.110 €        | 11.125.531 PLN      | 03.01.2025       | BNP Paribas                    | 1         | (17.596)                        | (0,00)               |
| 1.680.092 €        | 8.401.669 RON       | 17.01.2025       | Citibank NA                    | 2         | (6.420)                         | (0,00)               |
| 1.830.812 €        | 1.926.888 US\$      | 03.01.2025       | Citibank NA                    | 2         | (31.082)                        | (0,01)               |
| 721.177 €          | 3.088.294 PLN       | 17.01.2025       | Citibank NA                    | 1         | (109)                           | (0,00)               |
| 7.262.922 €        | 7.656.473 US\$      | 15.01.2025       | Citibank NA                    | 1         | (132.024)                       | (0,03)               |
| 1.809.200 €        | 1.908.748 US\$      | 03.01.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | (35.322)                        | (0,01)               |
| 537.793 €          | 2.703.465 RON       | 17.01.2025       | HSBC Bank Plc                  | 1         | (4.990)                         | (0,00)               |
| 509.205 €          | 534.937 US\$        | 05.02.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (6.939)                         | (0,00)               |
| 517.267 €          | 547.967 US\$        | 03.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (12.337)                        | (0,00)               |
| 1.234.290 €        | 6.173.218 RON       | 17.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (4.900)                         | (0,00)               |
| 255.172 €          | 268.141 US\$        | 05.02.2025       | Standard Chartered Bank        | 1         | (3.551)                         | (0,00)               |
| 724.140 €          | 3.621.211 RON       | 17.01.2025       | Standard Chartered Bank        | 1         | (2.765)                         | (0,00)               |
| 2.592.884 €        | 2.720.105 US\$      | 17.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (33.635)                        | (0,01)               |
| 97.977.346.186 IDR | 6.345.653 US\$      | 06.01.2025       | BNP Paribas                    | 2         | (269.054)                       | (0,05)               |
| 35.390.530.242 IDR | 2.191.614 US\$      | 19.03.2025       | Citibank NA                    | 1         | (17.548)                        | (0,00)               |
| 14.572.918.557 IDR | 924.795 US\$        | 06.01.2025       | Deutsche Bank AG               | 1         | (20.976)                        | (0,01)               |
| 22.368.068.687 IDR | 1.403.064 US\$      | 06.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (15.786)                        | (0,00)               |
| 6.342.022.192 IDR  | 399.568 US\$        | 06.01.2025       | Morgan Stanley                 | 1         | (6.233)                         | (0,00)               |
| 544.883.226 INR    | 6.353.004 US\$      | 19.03.2025       | BNP Paribas                    | 2         | (32.219)                        | (0,01)               |
| 202.914.741 ¥      | 1.362.588 US\$      | 06.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (62.133)                        | (0,01)               |
| 1.004.243.986 KZT  | 1.955.811 US\$      | 14.05.2025       | Goldman Sachs International    | 3         | (107.341)                       | (0,02)               |
| 386.627.307 KZT    | 753.292 US\$        | 14.05.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (41.644)                        | (0,01)               |
| 12.488.301 MXN     | 614.402 US\$        | 04.02.2025       | BNP Paribas                    | 1         | (17.317)                        | (0,00)               |
| 189.885.706 MXN    | 9.195.237 US\$      | 04.02.2025       | Citibank NA                    | 2         | (116.499)                       | (0,02)               |
| 28.240.442 MXN     | 1.389.784 US\$      | 04.02.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | (39.563)                        | (0,01)               |
| 29.595.448 MXN     | 1.440.012 US\$      | 04.02.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (25.006)                        | (0,01)               |
| 20.689.259 MYR     | 4.681.930 US\$      | 19.03.2025       | BNP Paribas                    | 2         | (40.377)                        | (0,01)               |
| 1.545.296.919 NGN  | 1.015.297 US\$      | 10.02.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | (39.628)                        | (0,01)               |
| 901.290.750 NGN    | 553.797 US\$        | 20.05.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | (9.229)                         | (0,00)               |
| 11.125.531 PLN     | 2.601.159 €         | 03.01.2025       | Citibank NA                    | 1         | (59)                            | (0,00)               |
| 17.955.874 PLN     | 4.197.992 €         | 17.01.2025       | Citibank NA                    | 1         | (4.488)                         | (0,00)               |
| 5.226.114 SGD      | 3.914.754 US\$      | 14.02.2025       | Citibank NA                    | 1         | (77.164)                        | (0,02)               |
| 521.926.836 THB    | 15.504.468 US\$     | 19.03.2025       | Citibank NA                    | 2         | (120.309)                       | (0,02)               |
| 51.387.382 THB     | 1.605.047 US\$      | 02.01.2025       | Citibank NA                    | 1         | (97.865)                        | (0,02)               |

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (1,74 %) (31. Dezember 2023: (0,39 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag              | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 46.623.417 THB                  | 1.458.805 US\$      | 02.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (91.349)                        | (0,02)               |
| 570.040 THB                     | 17.593 US\$         | 02.01.2025       | Standard Chartered Bank     | 1         | (874)                           | (0,00)               |
| 174.944.139 TWD                 | 5.439.098 US\$      | 22.01.2025       | Deutsche Bank AG            | 2         | (118.047)                       | (0,02)               |
| 3.205.093 US\$                  | 130.035.969 TRY     | 24.03.2025       | Barclays Bank Plc           | 2         | (199.213)                       | (0,04)               |
| 2.213.096 US\$                  | 87.282.302 TRY      | 09.01.2025       | Barclays Bank Plc           | 1         | (241.755)                       | (0,05)               |
| 1.659.510 US\$                  | 57.071.697 THB      | 09.01.2025       | Citibank NA                 | 1         | (14.981)                        | (0,00)               |
| 1.249.259 US\$                  | 20.374.319.101 IDR  | 19.03.2025       | Citibank NA                 | 1         | (2.350)                         | (0,00)               |
| 2.873.823 US\$                  | 17.976.508 BRL      | 05.03.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (3.031)                         | (0,00)               |
| 2.694.353 US\$                  | 12.105.002.174 COP  | 03.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (53.324)                        | (0,01)               |
| 424.509 US\$                    | 19.185.704 TRY      | 24.03.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (77.767)                        | (0,02)               |
| 1.275.041 US\$                  | 5.682.425.184 COP   | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (12.407)                        | (0,00)               |
| 570.497 US\$                    | 23.477.328 TRY      | 27.05.2025       | HSBC Bank Plc               | 1         | (8.900)                         | (0,00)               |
| 260.148 US\$                    | 10.505.056 TRY      | 09.01.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | (35.311)                        | (0,01)               |
| 561.564 US\$                    | 23.135.271 TRY      | 27.05.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | (9.393)                         | (0,00)               |
| 439.938 US\$                    | 23.316.740 EGP      | 17.03.2025       | Morgan Stanley              | 1         | (6.415)                         | (0,00)               |
| 264.202 US\$                    | 8.998.729 THB       | 19.03.2025       | Morgan Stanley              | 1         | (1.042)                         | (0,00)               |
| 636.108 US\$                    | 1.157.715.667 NGN   | 28.11.2025       | Morgan Stanley              | 1         | (2.573)                         | (0,00)               |
| 697.913 US\$                    | 29.727.607 TRY      | 24.03.2025       | Morgan Stanley              | 1         | (80.347)                        | (0,02)               |
| 372.310 US\$                    | 15.363.730 TRY      | 27.05.2025       | Standard Chartered Bank     | 1         | (6.852)                         | (0,00)               |
| 1.714.058 US\$                  | 10.827.293 BRL      | 05.03.2025       | Standard Chartered Bank     | 1         | (18.678)                        | (0,00)               |
| 2.052.215 ZAR                   | 113.903 US\$        | 19.03.2025       | Morgan Stanley              | 1         | (5.890)                         | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 2.265.734 AUD                   | 1.464.055 US\$      | 13.03.2025       | Citibank NA                 | 2         | (61.098)                        | (0,01)               |
| 2.217.821 AUD                   | 1.431.914 US\$      | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 2         | (58.624)                        | (0,01)               |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 191.105.660 €                   | 202.961.771 US\$    | 13.03.2025       | Citibank NA                 | 4         | (4.478.487)                     | (0,87)               |
| 2.707.492 €                     | 2.858.034 US\$      | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 10        | (46.019)                        | (0,01)               |
| 326.804 US\$                    | 314.677 €           | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | (21)                            | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 2.797.448 £                     | 3.571.453 US\$      | 13.03.2025       | Citibank NA                 | 3         | (69.759)                        | (0,01)               |
| 2.389 £                         | 3.020 US\$          | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 4         | (31)                            | (0,00)               |
| 306 US\$                        | 245 £               | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | (0)                             | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen NOK</i> |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 138.346 NOK                     | 12.469 US\$         | 13.03.2025       | Citibank NA                 | 2         | (289)                           | (0,00)               |
| 2.929 NOK                       | 264 US\$            | 13.03.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (6)                             | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen SEK</i> |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 8.055.431 SEK                   | 742.506 US\$        | 13.03.2025       | Citibank NA                 | 1         | (10.733)                        | (0,00)               |
| 8.240.919 SEK                   | 760.064 US\$        | 13.03.2025       | Goldman Sachs International | 2         | (11.441)                        | (0,00)               |
| 53.731 SEK                      | 4.903 US\$          | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 3         | (23)                            | (0,00)               |

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (1,74 %) (31. Dezember 2023: (0,39 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 2.149.789 SGD   | 1.612.145 US\$      | 13.03.2025       | Goldman Sachs International | 4         | (31.905)                        | (0,01)               |
| 7.315 SGD   | 5.468 US\$          | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 3         | (92)                            | (0,00)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>oo</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>(9.007.086)</b>              | <b>(1,74)</b>        |

### Futures-Kontrakte (0,07 %) (31. Dezember 2023: (0,19 %))

| Anzahl Kontrakte  | Beschreibung                                     | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|--|---------------------------------|----------------------|
| 122   | Euro-BOBL Future March 2025                      | (152.865)                       | (0,03)               |
| 18  | US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2025 | (19.406)                        | (0,01)               |
| 130   | US Treasury 5-Year Note (CBT) Future March 2025  | (68.164)                        | (0,01)               |
| 36  | US Treasury Long Bond (CBT) Future March 2025    | (95.062)                        | (0,02)               |
| 3   | US Treasury Ultra Bond (CBT) Future March 2025   | (17.791)                        | (0,00)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten <sup>±</sup></b> |  | <b>(353.288)</b>                | <b>(0,07)</b>        |

### Zinsswap-Kontrakte (1,36 %) (31. Dezember 2023: (1,10 %))

|     | Nominalwert   | Fälligkeit | Gegenpartei                              | Erhalt/(Zahlung) <sup>#</sup> | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-----|---------------|------------|--|-------------------------------|-----------------|--------------------|---------------------------------|----------------------|
| KRW | 9.869.467.305 | 19.12.2026 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 2,69 %          | 3M KWDC            | (3)                             | (0,00)               |
| CLP | 1.516.255.404 | 24.10.2033 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 6,12 %          | 1D CLICP           | (72)                            | (0,00)               |
| MXN | 18.899.906    | 10.02.2027 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 9,26 %          | 1D TIIE + 24bps    | (1.819)                         | (0,00)               |
| HUF | 107.758.564   | 21.03.2029 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 6,18 %          | 6M BUBOR           | (4.112)                         | (0,00)               |
| MXN | 29.184.713    | 30.10.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 9,26 %          | 1D TIIE + 24bps    | (5.194)                         | (0,00)               |
| MXN | 26.220.027    | 27.07.2029 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 9,17 %          | 1D TIIE + 24bps    | (11.144)                        | (0,00)               |
| MXN | 9.645.130     | 08.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 6,21 %          | 28D MXIBOR         | (14.718)                        | (0,00)               |
| MXN | 29.276.180    | 08.10.2038 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 9,77 %          | 1D TIIE + 24bps    | (15.542)                        | (0,00)               |
| MXN | 27.580.600    | 17.08.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 8,91 %          | 1D TIIE + 24bps    | (17.616)                        | (0,00)               |
| MXN | 27.580.600    | 17.08.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 8,94 %          | 1D TIIE + 24bps    | (17.883)                        | (0,00)               |
| CLP | 2.698.258.379 | 13.04.2025 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt                        | 7,51 %          | 1D CLICP           | (18.546)                        | (0,00)               |
| MXN | 17.665.108    | 26.02.2029 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 8,71 %          | 1D TIIE + 24bps    | (20.115)                        | (0,00)               |
| MXN | 28.121.151    | 12.12.2025 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 8,04 %          | 28D MXIBOR         | (21.056)                        | (0,00)               |
| MXN | 63.984.030    | 27.05.2027 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 8,58 %          | 28D MXIBOR         | (21.152)                        | (0,00)               |
| MXN | 35.056.640    | 27.08.2029 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 9,07 %          | 1D TIIE + 24bps    | (21.933)                        | (0,00)               |
| MXN | 28.121.151    | 07.01.2028 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 8,04 %          | 1D TIIE + 24bps    | (26.647)                        | (0,01)               |
| MXN | 54.330.570    | 11.12.2025 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 8,58 %          | 28D MXIBOR         | (27.521)                        | (0,01)               |
| MXN | 54.330.570    | 03.02.2028 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 8,58 %          | 1D TIIE + 24bps    | (28.382)                        | (0,01)               |
| MXN | 63.984.030    | 11.12.2025 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 8,58 %          | 1D TIIE + 24bps    | (32.396)                        | (0,01)               |
| HUF | 509.372.982   | 10.12.2034 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 6,48 %          | 6M BUBOR           | (34.174)                        | (0,01)               |
| HUF | 1.029.449.430 | 11.12.2029 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 6,26 %          | 6M BUBOR           | (40.022)                        | (0,01)               |
| CLP | 3.388.538.669 | 17.06.2025 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 1,36 %          | 1D CLICP           | (56.783)                        | (0,01)               |
| CLP | 3.115.406.937 | 23.06.2025 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 1,16 %          | 1D CLICP           | (56.930)                        | (0,01)               |

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Zinsswap-Kontrakte (1,36 %) (31. Dezember 2023: (1,10 %)) (Fortsetzung)

|   | Nominalwert   | Fälligkeit | Gegenpartei                              | Erhalt/(Zahlung) <sup>#</sup> | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------|------------|--|-------------------------------|-----------------|--------------------|---------------------------------|----------------------|
| MXN   | 56.934.366    | 09.03.2029 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 8,77 %          | 1D TIIE + 24bps    | (59.556)                        | (0,01)               |
| MXN   | 37.080.494    | 05.03.2026 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 6,17 %          | 1D TIIE + 24bps    | (68.081)                        | (0,01)               |
| MXN   | 17.665.108    | 08.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 0,00 %          | 28D MXIBOR         | (74.427)                        | (0,02)               |
| MXN   | 18.899.906    | 17.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 0,00 %          | 28D MXIBOR         | (81.542)                        | (0,02)               |
| MXN   | 89.792.389    | 03.09.2029 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 8,80 %          | 1D TIIE + 24bps    | (101.099)                       | (0,02)               |
| MXN   | 24.807.076    | 15.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 0,00 %          | 28D MXIBOR         | (106.958)                       | (0,02)               |
| MXN   | 26.220.027    | 19.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 0,00 %          | 28D MXIBOR         | (113.719)                       | (0,02)               |
| BRL   | 5.750.107     | 02.01.2029 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 11,97 %         | 1D BROIS           | (120.877)                       | (0,02)               |
| CLP   | 1.254.313.506 | 23.01.2030 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 3,06 %          | 1D CLICP           | (125.000)                       | (0,02)               |
| MXN   | 29.276.180    | 19.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 0,00 %          | 1D TIIE + 24bps    | (126.424)                       | (0,03)               |
| MXN   | 29.184.713    | 29.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 0,00 %          | 28D MXIBOR         | (129.684)                       | (0,03)               |
| MXN   | 60.000.000    | 16.09.2026 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 6,38 %          | 1D TIIE + 24bps    | (139.873)                       | (0,03)               |
| MXN   | 35.056.640    | 22.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 0,00 %          | 28D MXIBOR         | (153.050)                       | (0,03)               |
| MXN   | 37.080.494    | 11.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 0,00 %          | 28D MXIBOR         | (157.483)                       | (0,03)               |
| BRL   | 8.358.247     | 02.01.2029 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 12,28 %         | 1D BROIS           | (160.036)                       | (0,03)               |
| BRL   | 19.663.289    | 02.01.2026 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 10,63 %         | 1D BROIS           | (166.449)                       | (0,03)               |
| MXN   | 45.745.846    | 25.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 0,00 %          | 28D MXIBOR         | (201.748)                       | (0,04)               |
| CLP   | 1.377.149.008 | 24.08.2030 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 2,15 %          | 1D CLICP           | (215.474)                       | (0,04)               |
| MXN   | 55.161.200    | 11.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 0,00 %          | 28D MXIBOR         | (234.273)                       | (0,05)               |
| MXN   | 56.934.366    | 19.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 0,00 %          | 28D MXIBOR         | (246.930)                       | (0,05)               |
| MXN   | 60.000.000    | 10.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 0,00 %          | 28D MXIBOR         | (254.146)                       | (0,05)               |
| BRL   | 34.632.671    | 02.01.2026 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 11,59 %         | 1D BROIS           | (334.122)                       | (0,07)               |
| BRL   | 22.544.996    | 04.01.2027 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 10,55 %         | 1D BROIS           | (363.331)                       | (0,07)               |
| BRL   | 11.917.471    | 02.01.2029 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 10,29 %         | 1D BROIS           | (388.725)                       | (0,08)               |
| MXN   | 89.792.389    | 29.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 0,00 %          | 28D MXIBOR         | (398.999)                       | (0,08)               |
| BRL   | 8.615.804     | 02.01.2031 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 10,46 %         | 1D BROIS           | (429.296)                       | (0,08)               |
| BRL   | 29.000.000    | 04.01.2027 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 7,67 %          | 1D BROIS           | (1.551.996)                     | (0,30)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Zinsswapkontrakten <sup>∞</sup></b> |               |            |  |                               |                 |                    | <b>(6.997.058)</b>              | <b>(1,36)</b>        |

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

|   | Zeitwert US\$       | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(16.357.432)</b> | <b>(3,17)</b>        |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>453.025.856</b>  | <b>87,74</b>         |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>63.282.296</b>   | <b>12,26</b>         |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>516.308.152</b>  | <b>100,00</b>        |

## Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

| Portfolioanalyse  | US\$               | % des<br>Gesamtver-<br>mögens |
|---|--------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 335.535.460        | 62,72                         |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden            | 121.223.978        | 22,66                         |
| μ Investmentfonds   | 4.001.641          | 0,75                          |
| ± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden                          | 162.671            | 0,03                          |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap                            | (7.897.894)        | (1,48)                        |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>453.025.856</b> | <b>84,68</b>                  |

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                    | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 18,01 % (31. Dezember 2023: 14,20 %)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>Kolumbianischer Peso</b>                                      |  |         |                       |                  |                              |
| 443.000.000  | Asian Development Bank*                  | 10,10 % | 23.01.2026            | 101.136          | 0,18                         |
| 186.000.000  | Asian Development Bank*                  | 11,20 % | 31.01.2025            | 42.253           | 0,07                         |
| 338.000.000  | Asian Development Bank*                  | 12,75 % | 03.03.2025            | 76.975           | 0,13                         |
| 205.000.000  | Asian Development Bank*                  | 13,00 % | 07.03.2025            | 46.716           | 0,08                         |
| 270.000.000  | International Finance Corp*              | 0,00 %  | 16.08.2028            | 43.057           | 0,08                         |
| <b>Kolumbianischer Peso insgesamt</b>                            |  |         |                       | <b>310.137</b>   | <b>0,54</b>                  |
| <b>Euro</b>  |  |         |                       |                  |                              |
| 100.000  | Banque Ouest Africaine de Developpement* | 2,75 %  | 22.01.2033            | 87.033           | 0,15                         |
| <b>Euro insgesamt</b>  |  |         |                       | <b>87.033</b>    | <b>0,15</b>                  |
| <b>Indische Rupie</b>  |  |         |                       |                  |                              |
| 50.200.000   | Asian Infrastructure Investment Bank*    | 6,65 %  | 30.06.2033            | 571.497          | 0,99                         |
| 5.100.000  | Asian Infrastructure Investment Bank*    | 7,20 %  | 02.07.2031            | 60.068           | 0,11                         |
| <b>Indische Rupie insgesamt</b>                                  |  |         |                       | <b>631.565</b>   | <b>1,10</b>                  |
| <b>Mexikanischer Peso</b>  |  |         |                       |                  |                              |
| 1.000.000  | Asian Development Bank*                  | 0,00 %  | 20.04.2043            | 8.200            | 0,01                         |
| 3.000.000  | Asian Infrastructure Investment Bank*    | 0,00 %  | 08.02.2038            | 39.406           | 0,07                         |
| <b>Mexikanischer Peso insgesamt</b>                              |  |         |                       | <b>47.606</b>    | <b>0,08</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 470.000  | Abu Dhabi Developmental Holding Co PJSC* | 5,25 %  | 02.10.2054            | 432.499          | 0,75                         |
| 200.000  | African Export-Import Bank*              | 2,63 %  | 17.05.2026            | 190.977          | 0,33                         |
| 200.000  | African Export-Import Bank*              | 3,80 %  | 17.05.2031            | 174.471          | 0,30                         |
| 200.000  | African Export-Import Bank*              | 3,99 %  | 21.09.2029            | 184.612          | 0,32                         |
| 206.000  | Antofagasta Plc*                         | 6,25 %  | 02.05.2034            | 209.305          | 0,36                         |
| 200.000  | Banco de Credito e Inversiones SA*       | 3,50 %  | 12.10.2027            | 191.669          | 0,33                         |
| 880.000  | Banque Ouest Africaine de Developpement* | 4,70 %  | 22.10.2031            | 795.608          | 1,38                         |
| 205.000  | Banque Ouest Africaine de Developpement* | 5,00 %  | 27.07.2027            | 199.611          | 0,35                         |
| 200.000  | Cencosud SA*                             | 4,38 %  | 17.07.2027            | 195.562          | 0,34                         |
| 300.000  | Corp Nacional del Cobre de Chile*        | 3,15 %  | 14.01.2030            | 267.376          | 0,47                         |
| 200.000  | Corp Nacional del Cobre de Chile*        | 3,70 %  | 30.01.2050            | 134.342          | 0,23                         |
| 910.000  | Corp Nacional del Cobre de Chile*        | 5,95 %  | 08.01.2034            | 905.451          | 1,58                         |
| 200.000  | DIB Sukuk Ltd*                           | 4,80 %  | 16.08.2028            | 198.247          | 0,35                         |
| 600.000  | DP World Ltd*                            | 6,85 %  | 02.07.2037            | 654.184          | 1,14                         |
| 436.000  | Empresa de los Ferrocarriles del Estado* | 3,83 %  | 14.09.2061            | 287.969          | 0,50                         |
| 200.000  | Empresa de Transmision Electrica SA*     | 5,13 %  | 02.05.2049            | 142.963          | 0,25                         |

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                           | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 18,01 % (31. Dezember 2023: 14,20 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                   |                              |
| 325.000  | First Abu Dhabi Bank PJSC*                      | 5,00 %  | 28.02.2029            | 326.295           | 0,57                         |
| 400.000  | Indian Railway Finance Corp Ltd*                | 3,57 %  | 21.01.2032            | 358.257           | 0,62                         |
| 400.000  | LG Chem Ltd*                                    | 2,38 %  | 07.07.2031            | 330.261           | 0,58                         |
| 200.000  | MDGH GMTN RSC Ltd*                              | 2,50 %  | 03.06.2031            | 173.037           | 0,30                         |
| 600.000  | Metropolitan Bank & Trust Co*                   | 5,50 %  | 06.03.2034            | 597.788           | 1,04                         |
| 292.000  | NBK SPC Ltd*                                    | 1,63 %  | 15.09.2027            | 274.579           | 0,48                         |
| 200.000  | NBK Tier 1 Ltd*                                 | 3,63 %  | 31.12.2149            | 190.594           | 0,33                         |
| 200.000  | Ooredoo International Finance Ltd*              | 2,63 %  | 08.04.2031            | 173.917           | 0,30                         |
| 400.000  | Shinhan Bank Co Ltd*                            | 4,00 %  | 23.04.2029            | 378.121           | 0,66                         |
| 200.000  | Sigma Finance Netherlands BV*                   | 4,88 %  | 27.03.2028            | 197.434           | 0,34                         |
| 200.000  | SK Hynix Inc**                                  | 6,50 %  | 17.01.2033            | 211.498           | 0,37                         |
| 600.000  | Tencent Holdings Ltd*                           | 3,24 %  | 03.06.2050            | 398.681           | 0,69                         |
| 220.000  | TSMC Arizona Corp*                              | 3,25 %  | 25.10.2051            | 158.222           | 0,28                         |
| 400.000  | UltraTech Cement Ltd*                           | 2,80 %  | 16.02.2031            | 345.333           | 0,60                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |   |         |                       | <b>9.278.863</b>  | <b>16,14</b>                 |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>  |   |         |                       | <b>10.355.204</b> | <b>18,01</b>                 |
| <b>Staatsanleihen 72,67 % (31. Dezember 2023: 74,18 %)</b>                     |   |         |                       |                   |                              |
| <b>Chilenischer Peso</b>   |   |         |                       |                   |                              |
| 38.419.170   | Bonos de la Tesoreria de la Republica*          | 1,90 %  | 01.09.2030            | 37.315            | 0,06                         |
| 75.000.000   | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 2,30 %  | 01.10.2028            | 67.295            | 0,12                         |
| 55.000.000   | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 2,80 %  | 01.10.2033            | 44.212            | 0,08                         |
| 40.000.000   | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 4,50 %  | 01.03.2026            | 40.668            | 0,07                         |
| 155.000.000  | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 4,70 %  | 01.09.2030            | 149.970           | 0,26                         |
| 35.000.000   | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 5,00 %  | 01.03.2035            | 33.473            | 0,06                         |
| 45.000.000   | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 6,00 %  | 01.04.2033            | 46.153            | 0,08                         |
| 20.000.000   | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 6,00 %  | 01.01.2043            | 21.364            | 0,04                         |
| 40.000.000   | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos* | 7,00 %  | 01.05.2034            | 44.176            | 0,07                         |
| <b>Chilenischer Peso insgesamt</b>   |   |         |                       | <b>484.626</b>    | <b>0,84</b>                  |
| <b>Kolumbianischer Peso</b>  |   |         |                       |                   |                              |
| 294.100.000  | Colombian TES*                                  | 5,75 %  | 03.11.2027            | 59.871            | 0,10                         |
| 1.338.300.000  | Colombian TES*                                  | 7,00 %  | 26.03.2031            | 249.466           | 0,43                         |
| 1.452.700.000  | Colombian TES*                                  | 7,00 %  | 30.06.2032            | 257.840           | 0,45                         |
| 335.400.000  | Colombian TES*                                  | 7,25 %  | 18.10.2034            | 56.736            | 0,10                         |
| 828.200.000  | Colombian TES*                                  | 7,75 %  | 18.09.2030            | 163.508           | 0,29                         |
| 298.000.000  | Colombian TES*                                  | 9,25 %  | 28.05.2042            | 52.371            | 0,09                         |
| 777.100.000  | Colombian TES*                                  | 13,25 % | 09.02.2033            | 190.809           | 0,33                         |
| <b>Kolumbianischer Peso insgesamt</b>  |   |         |                       | <b>1.030.601</b>  | <b>1,79</b>                  |

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                             | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 72,67 % (31. Dezember 2023: 74,18 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>Tschechische Krone</b>  |   |        |                       |                  |                              |
| 2.810.000  | Czech Republic Government Bond*                   | 0,05 % | 29.11.2029            | 96.795           | 0,17                         |
| 2.200.000  | Czech Republic Government Bond*                   | 0,95 % | 15.05.2030            | 78.167           | 0,14                         |
| 7.900.000  | Czech Republic Government Bond*                   | 1,20 % | 13.03.2031            | 277.450          | 0,48                         |
| 680.000  | Czech Republic Government Bond*                   | 1,50 % | 24.04.2040            | 19.107           | 0,03                         |
| 2.550.000  | Czech Republic Government Bond*                   | 1,75 % | 23.06.2032            | 90.399           | 0,16                         |
| 1.870.000  | Czech Republic Government Bond*                   | 1,95 % | 30.07.2037            | 59.577           | 0,10                         |
| 3.410.000  | Czech Republic Government Bond*                   | 2,00 % | 13.10.2033            | 119.076          | 0,21                         |
| 3.160.000  | Czech Republic Government Bond*                   | 2,75 % | 23.07.2029            | 124.705          | 0,22                         |
| 720.000  | Czech Republic Government Bond*                   | 4,20 % | 04.12.2036            | 29.516           | 0,05                         |
| 490.000  | Czech Republic Government Bond*                   | 5,00 % | 30.09.2030            | 21.370           | 0,04                         |
| 590.000  | Czech Republic Government Bond*                   | 5,50 % | 12.12.2028            | 25.919           | 0,04                         |
| 130.000  | Czech Republic Government Bond*                   | 6,20 % | 16.06.2031            | 6.068            | 0,01                         |
| <b>Tschechische Krone insgesamt</b>                                      |   |        |                       | <b>948.149</b>   | <b>1,65</b>                  |
| <b>Euro</b>  |   |        |                       |                  |                              |
| 500.000  | Bank Gospodarstwa Krajowego*                      | 4,00 % | 13.03.2032            | 533.683          | 0,93                         |
| 410.000  | Bank Gospodarstwa Krajowego*                      | 5,13 % | 22.02.2033            | 469.664          | 0,82                         |
| 200.000  | Bulgaria Government International Bond*           | 4,13 % | 23.09.2029            | 218.085          | 0,38                         |
| 233.000  | Bulgaria Government International Bond*           | 4,38 % | 13.05.2031            | 258.698          | 0,45                         |
| 210.000  | Bulgaria Government International Bond*           | 4,50 % | 27.01.2033            | 236.511          | 0,41                         |
| 650.000  | Chile Government International Bond*              | 0,83 % | 02.07.2031            | 574.153          | 1,00                         |
| 291.000  | Chile Government International Bond*              | 3,88 % | 09.07.2031            | 306.466          | 0,53                         |
| 348.092  | Chile Government International Bond*              | 4,13 % | 05.07.2034            | 373.065          | 0,65                         |
| 750.000  | Indonesia Government International Bond*          | 0,90 % | 14.02.2027            | 741.871          | 1,29                         |
| 1.960.000  | Indonesia Government International Bond*          | 1,40 % | 30.10.2031            | 1.770.522        | 3,08                         |
| 187.000  | Indonesia Government International Bond*          | 3,65 % | 10.09.2032            | 194.494          | 0,34                         |
| 400.000  | Kazakhstan Government International Bond*         | 0,60 % | 30.09.2026            | 397.560          | 0,69                         |
| 300.000  | Kazakhstan Government International Bond*         | 2,38 % | 09.11.2028            | 302.722          | 0,53                         |
| 350.000  | Latvia Government International Bond*             | 0,25 % | 23.01.2030            | 317.915          | 0,55                         |
| 250.000  | Lithuania Government International Bond*          | 2,13 % | 01.06.2032            | 244.488          | 0,42                         |
| 127.000  | Magyar Export-Import Bank Zrt*                    | 4,50 % | 27.11.2031            | 133.651          | 0,23                         |
| 200.000  | Mexico Government International Bond*             | 3,38 % | 23.02.2031            | 201.249          | 0,35                         |
| 900.000  | Philippine Government International Bond*         | 1,75 % | 28.04.2041            | 674.569          | 1,17                         |
| 109.000  | Republic of Poland Government International Bond* | 3,13 % | 22.10.2031            | 113.872          | 0,20                         |
| 276.000  | Republic of Poland Government International Bond* | 4,25 % | 14.02.2043            | 296.563          | 0,52                         |
| 337.000  | Romanian Government International Bond*           | 2,00 % | 14.04.2033            | 266.059          | 0,46                         |
| 500.000  | Romanian Government International Bond*           | 2,12 % | 16.07.2031            | 430.554          | 0,75                         |
| 1.225.000  | Romanian Government International Bond*           | 3,75 % | 07.02.2034            | 1.092.107        | 1,90                         |

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 72,67 % (31. Dezember 2023: 74,18 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                   |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |  |        |                       |                   |                              |
| 247.000  | Romanian Government International Bond*              | 6,38 % | 18.09.2033            | 267.007           | 0,46                         |
| <b>Euro insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>10.415.528</b> | <b>18,11</b>                 |
| <b>Ungarischer Forint</b>  |  |        |                       |                   |                              |
| 18.430.000   | Hungary Government Bond*                             | 2,25 % | 20.04.2033            | 34.099            | 0,06                         |
| 13.810.000   | Hungary Government Bond*                             | 3,00 % | 21.08.2030            | 29.780            | 0,05                         |
| 143.260.000  | Hungary Government Bond*                             | 4,50 % | 23.03.2028            | 342.524           | 0,60                         |
| 30.280.000   | Hungary Government Bond*                             | 4,50 % | 27.05.2032            | 67.891            | 0,12                         |
| 1.790.000  | Hungary Government Bond*                             | 4,75 % | 24.11.2032            | 4.022             | 0,01                         |
| 11.810.000   | Hungary Government Bond*                             | 6,75 % | 22.10.2028            | 30.174            | 0,05                         |
| 20.690.000   | Hungary Government Bond*                             | 7,00 % | 24.10.2035            | 53.793            | 0,09                         |
| <b>Ungarischer Forint insgesamt</b>                                      |  |        |                       | <b>562.283</b>    | <b>0,98</b>                  |
| <b>Indische Rupie</b>  |  |        |                       |                   |                              |
| 42.600.000   | India Government Bond*                               | 7,02 % | 18.06.2031            | 503.292           | 0,88                         |
| 18.900.000   | India Government Bond*                               | 7,10 % | 08.04.2034            | 225.250           | 0,39                         |
| 14.500.000   | India Government Bond*                               | 7,18 % | 24.07.2037            | 174.013           | 0,30                         |
| 34.730.000   | India Government Bond*                               | 7,30 % | 19.06.2053            | 422.701           | 0,73                         |
| 9.100.000  | International Bank for Reconstruction & Development* | 6,50 % | 17.04.2030            | 103.275           | 0,18                         |
| 19.800.000   | International Bank for Reconstruction & Development* | 6,75 % | 13.07.2029            | 227.462           | 0,40                         |
| <b>Indische Rupie insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>1.655.993</b>  | <b>2,88</b>                  |
| <b>Indonesische Rupiah</b>   |  |        |                       |                   |                              |
| 4.000.000.000  | Indonesia Treasury Bond*                             | 5,13 % | 15.04.2027            | 238.644           | 0,41                         |
| 4.712.000.000  | Indonesia Treasury Bond*                             | 6,38 % | 15.08.2028            | 287.142           | 0,50                         |
| 2.100.000.000  | Indonesia Treasury Bond*                             | 6,38 % | 15.04.2032            | 124.563           | 0,22                         |
| 300.000.000  | Indonesia Treasury Bond*                             | 6,38 % | 15.07.2037            | 17.711            | 0,03                         |
| 5.406.000.000  | Indonesia Treasury Bond*                             | 6,50 % | 15.02.2031            | 326.576           | 0,57                         |
| 186.000.000  | Indonesia Treasury Bond*                             | 6,63 % | 15.05.2033            | 11.299            | 0,02                         |
| 5.146.000.000  | Indonesia Treasury Bond*                             | 6,63 % | 15.02.2034            | 311.355           | 0,54                         |
| 1.269.000.000  | Indonesia Treasury Bond*                             | 6,75 % | 15.07.2035            | 77.315            | 0,13                         |
| 7.789.000.000  | Indonesia Treasury Bond*                             | 6,88 % | 15.04.2029            | 481.727           | 0,84                         |
| 3.426.000.000  | Indonesia Treasury Bond*                             | 7,00 % | 15.02.2033            | 212.359           | 0,37                         |
| 3.870.000.000  | Indonesia Treasury Bond*                             | 7,13 % | 15.06.2038            | 241.091           | 0,42                         |
| 1.109.000.000  | Indonesia Treasury Bond*                             | 7,13 % | 15.06.2042            | 69.116            | 0,12                         |
| 1.638.000.000  | Indonesia Treasury Bond*                             | 7,13 % | 15.06.2043            | 102.009           | 0,18                         |
| 3.550.000.000  | Indonesia Treasury Bond*                             | 7,50 % | 15.06.2035            | 227.712           | 0,40                         |
| 1.391.000.000  | Indonesia Treasury Bond*                             | 7,50 % | 15.04.2040            | 89.664            | 0,16                         |

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                    | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 72,67 % (31. Dezember 2023: 74,18 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                  |                              |
| <b>Indonesische Rupie (Fortsetzung)</b>                                  |  |        |                       |                  |                              |
| 100.000.000  | Indonesia Treasury Bond*                 | 8,38 % | 15.03.2034            | 6.795            | 0,01                         |
| 131.000.000  | Indonesia Treasury Bond*                 | 8,38 % | 15.04.2039            | 9.018            | 0,01                         |
| <b>Indonesische Rupiah insgesamt</b>                                     |  |        |                       | <b>2.834.096</b> | <b>4,93</b>                  |
| <b>Malaysischer Ringgit</b>  |  |        |                       |                  |                              |
| 645.000  | Malaysia Government Bond**               | 2,63 % | 15.04.2031            | 135.042          | 0,24                         |
| 588.000  | Malaysia Government Bond**               | 3,52 % | 20.04.2028            | 131.247          | 0,23                         |
| 420.000  | Malaysia Government Bond**               | 3,58 % | 15.07.2032            | 92.491           | 0,16                         |
| 573.000  | Malaysia Government Bond**               | 3,76 % | 22.05.2040            | 124.601          | 0,22                         |
| 265.000  | Malaysia Government Bond**               | 3,83 % | 05.07.2034            | 59.247           | 0,10                         |
| 400.000  | Malaysia Government Bond**               | 4,07 % | 15.06.2050            | 88.222           | 0,15                         |
| 115.000  | Malaysia Government Bond**               | 4,18 % | 16.05.2044            | 26.070           | 0,05                         |
| 350.000  | Malaysia Government Bond**               | 4,25 % | 31.05.2035            | 80.874           | 0,14                         |
| 850.000  | Malaysia Government Bond**               | 4,50 % | 30.04.2029            | 196.724          | 0,34                         |
| 1.373.000  | Malaysia Government Bond**               | 4,64 % | 07.11.2033            | 325.182          | 0,57                         |
| 1.671.000  | Malaysia Government Bond**               | 4,70 % | 15.10.2042            | 403.332          | 0,70                         |
| 688.000  | Malaysia Government Bond**               | 4,89 % | 08.06.2038            | 168.371          | 0,29                         |
| 147.000  | Malaysia Government Investment Issue**   | 4,66 % | 31.03.2038            | 35.193           | 0,06                         |
| <b>Malaysischer Ringgit insgesamt</b>                                    |  |        |                       | <b>1.866.596</b> | <b>3,25</b>                  |
| <b>Mexikanischer Peso</b>  |  |        |                       |                  |                              |
| 3.896.000  | Mexican Bonos*                           | 7,50 % | 03.06.2027            | 178.029          | 0,31                         |
| 3.090.000  | Mexican Bonos*                           | 7,50 % | 26.05.2033            | 125.706          | 0,22                         |
| 12.695.900   | Mexican Bonos*                           | 7,75 % | 29.05.2031            | 545.045          | 0,95                         |
| 5.919.800  | Mexican Bonos*                           | 7,75 % | 13.11.2042            | 218.646          | 0,38                         |
| 6.610.000  | Mexican Bonos*                           | 8,00 % | 24.05.2035            | 273.523          | 0,47                         |
| 1.503.800  | Mexican Bonos*                           | 8,00 % | 07.11.2047            | 55.831           | 0,10                         |
| 10.916.800   | Mexican Bonos*                           | 8,50 % | 31.05.2029            | 497.543          | 0,86                         |
| <b>Mexikanischer Peso insgesamt</b>                                      |  |        |                       | <b>1.894.323</b> | <b>3,29</b>                  |
| <b>Peruanischer Sol</b>  |  |        |                       |                  |                              |
| 199.000  | Peru Government Bond*                    | 5,35 % | 12.08.2040            | 44.369           | 0,08                         |
| 313.000  | Peru Government Bond*                    | 6,15 % | 12.08.2032            | 82.659           | 0,15                         |
| 56.000   | Peruvian Government International Bond*  | 5,40 % | 12.08.2034            | 13.597           | 0,02                         |
| 565.000  | Peruvian Government International Bond** | 6,90 % | 12.08.2037            | 149.315          | 0,26                         |
| 494.000  | Peruvian Government International Bond*  | 6,95 % | 12.08.2031            | 138.506          | 0,24                         |
| 150.000  | Peruvian Government International Bond** | 7,60 % | 12.08.2039            | 41.828           | 0,07                         |
| <b>Peruanischer Sol insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>470.274</b>   | <b>0,82</b>                  |

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--------------------------------------|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 72,67 % (31. Dezember 2023: 74,18 %) (Fortsetzung)</b> |                                      |        |                       |                  |                              |
| <b>Philippinischer Peso</b>  |                                      |        |                       |                  |                              |
| 2.470.000  | Philippine Government Bond*          | 6,25 % | 25.01.2034            | 42.927           | 0,08                         |
| 7.840.000  | Philippine Government Bond*          | 6,50 % | 19.05.2029            | 137.356          | 0,24                         |
| 2.720.000  | Philippine Government Bond*          | 6,63 % | 17.08.2033            | 48.279           | 0,08                         |
| 3.110.000  | Philippine Government Bond*          | 6,88 % | 23.05.2044            | 56.945           | 0,10                         |
| 2.512.182  | Philippine Government Bond*          | 8,00 % | 19.07.2031            | 47.660           | 0,08                         |
| <b>Philippinischer Peso insgesamt</b>                                    |                                      |        |                       | <b>333.167</b>   | <b>0,58</b>                  |
| <b>Polnischer Zloty</b>  |                                      |        |                       |                  |                              |
| 807.000  | Republic of Poland Government Bond** | 1,25 % | 25.10.2030            | 154.898          | 0,27                         |
| 1.603.000  | Republic of Poland Government Bond*  | 1,75 % | 25.04.2032            | 299.626          | 0,52                         |
| 340.000  | Republic of Poland Government Bond*  | 2,50 % | 25.07.2026            | 79.227           | 0,14                         |
| 735.000  | Republic of Poland Government Bond*  | 2,75 % | 25.10.2029            | 158.423          | 0,28                         |
| 143.000  | Republic of Poland Government Bond** | 3,25 % | 25.07.2025            | 34.458           | 0,06                         |
| 262.000  | Republic of Poland Government Bond*  | 4,75 % | 25.07.2029            | 61.678           | 0,11                         |
| 1.086.000  | Republic of Poland Government Bond*  | 6,00 % | 25.10.2033            | 267.169          | 0,46                         |
| 1.368.000  | Republic of Poland Government Bond*  | 7,50 % | 25.07.2028            | 353.912          | 0,61                         |
| <b>Polnischer Zloty insgesamt</b>  |                                      |        |                       | <b>1.409.391</b> | <b>2,45</b>                  |
| <b>Rumänischer neuer Leu</b>   |                                      |        |                       |                  |                              |
| 340.000  | Romania Government Bond*             | 2,50 % | 25.10.2027            | 62.880           | 0,11                         |
| 255.000  | Romania Government Bond*             | 3,25 % | 24.06.2026            | 50.531           | 0,09                         |
| 390.000  | Romania Government Bond*             | 4,75 % | 11.10.2034            | 66.857           | 0,12                         |
| 255.000  | Romania Government Bond**            | 4,85 % | 25.07.2029            | 48.452           | 0,08                         |
| 300.000  | Romania Government Bond*             | 6,30 % | 25.04.2029            | 60.533           | 0,11                         |
| 545.000  | Romania Government Bond*             | 6,70 % | 25.02.2032            | 109.949          | 0,19                         |
| 455.000  | Romania Government Bond*             | 7,10 % | 31.07.2034            | 92.944           | 0,16                         |
| 200.000  | Romania Government Bond*             | 7,35 % | 28.04.2031            | 41.729           | 0,07                         |
| 510.000  | Romania Government Bond*             | 8,00 % | 29.04.2030            | 109.651          | 0,19                         |
| 315.000  | Romania Government Bond*             | 8,25 % | 29.09.2032            | 69.173           | 0,12                         |
| 1.440.000  | Romania Government Bond*             | 8,75 % | 30.10.2028            | 315.439          | 0,55                         |
| <b>Rumänischer neuer Leu insgesamt</b>                                   |                                      |        |                       | <b>1.028.138</b> | <b>1,79</b>                  |
| <b>Thailändischer Baht</b>   |                                      |        |                       |                  |                              |
| 2.430.000  | Thailand Government Bond**           | 2,00 % | 17.12.2031            | 70.410           | 0,12                         |
| 3.700.000  | Thailand Government Bond**           | 2,00 % | 17.06.2042            | 99.267           | 0,17                         |
| 908.000  | Thailand Government Bond**           | 2,80 % | 17.06.2034            | 27.796           | 0,05                         |
| 62.000   | Thailand Government Bond**           | 2,88 % | 17.06.2046            | 1.873            | 0,00                         |
| 2.232.000  | Thailand Government Bond**           | 3,30 % | 17.06.2038            | 71.448           | 0,13                         |

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 72,67 % (31. Dezember 2023: 74,18 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                  |                              |
| <b>Thailändischer Baht (Fortsetzung)</b>                                 |  |        |                       |                  |                              |
| 4.713.000  | Thailand Government Bond**                           | 3,35 % | 17.06.2033            | 149.641          | 0,26                         |
| 6.858.000  | Thailand Government Bond**                           | 3,39 % | 17.06.2037            | 221.260          | 0,39                         |
| 12.440.000   | Thailand Government Bond**                           | 3,45 % | 17.06.2043            | 404.449          | 0,70                         |
| 200.000  | Thailand Government Bond**                           | 3,78 % | 25.06.2032            | 6.484            | 0,01                         |
| <b>Thailändischer Baht insgesamt</b>                                     |  |        |                       | <b>1.052.628</b> | <b>1,83</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>   |  |        |                       |                  |                              |
| 340.000  | Abu Dhabi Government International Bond*             | 5,50 % | 30.04.2054            | 334.265          | 0,58                         |
| 259.000  | Amazon Conservation DAC**                            | 6,03 % | 16.01.2042            | 258.417          | 0,45                         |
| 200.000  | Bank Gospodarstwa Krajowego*                         | 5,38 % | 22.05.2033            | 195.460          | 0,34                         |
| 510.000  | Bank Gospodarstwa Krajowego**                        | 5,75 % | 09.07.2034            | 507.419          | 0,88                         |
| 800.000  | Bermuda Government International Bond*               | 3,72 % | 25.01.2027            | 778.000          | 1,35                         |
| 400.000  | Bermuda Government International Bond*               | 5,00 % | 15.07.2032            | 386.800          | 0,67                         |
| 142.000  | Bulgaria Government International Bond*              | 5,00 % | 05.03.2037            | 133.753          | 0,23                         |
| 400.000  | Chile Government International Bond*                 | 3,50 % | 31.01.2034            | 345.272          | 0,60                         |
| 200.000  | Chile Government International Bond*                 | 4,34 % | 07.03.2042            | 168.178          | 0,29                         |
| 650.000  | Hungary Government International Bond*               | 5,50 % | 16.06.2034            | 620.626          | 1,08                         |
| 390.000  | Hungary Government International Bond*               | 7,63 % | 29.03.2041            | 432.654          | 0,75                         |
| 775.000  | Indonesia Government International Bond*             | 8,50 % | 12.10.2035            | 965.656          | 1,68                         |
| 220.000  | Israel Government International Bond*                | 5,50 % | 12.03.2034            | 215.734          | 0,38                         |
| 360.000  | Israel Government International Bond*                | 5,75 % | 12.03.2054            | 329.805          | 0,58                         |
| 200.000  | Korea Mine Rehabilitation & Mineral Resources Corp** | 5,13 % | 08.05.2029            | 200.060          | 0,35                         |
| 200.000  | Latvia Government International Bond*                | 5,13 % | 30.07.2034            | 195.020          | 0,34                         |
| 200.000  | Mexico Government International Bond*                | 3,50 % | 12.02.2034            | 159.603          | 0,28                         |
| 1.256.000  | Mexico Government International Bond*                | 5,75 % | 12.10.2110            | 965.990          | 1,68                         |
| 780.000  | Mexico Government International Bond**               | 6,00 % | 07.05.2036            | 735.955          | 1,28                         |
| 1.100.000  | Mexico Government International Bond*                | 6,35 % | 09.02.2035            | 1.077.174        | 1,88                         |
| 250.000  | Oriental Republic of Uruguay*                        | 5,25 % | 10.09.2060            | 228.579          | 0,40                         |
| 580.000  | Panama Bonos del Tesoro*                             | 6,38 % | 25.07.2033            | 521.466          | 0,91                         |
| 400.000  | Panama Government International Bond*                | 2,25 % | 29.09.2032            | 280.575          | 0,49                         |
| 588.000  | Panama Government International Bond*                | 4,50 % | 19.01.2063            | 346.181          | 0,60                         |
| 437.000  | Panama Government International Bond*                | 6,70 % | 26.01.2036            | 406.507          | 0,71                         |
| 200.000  | Panama Government International Bond**               | 8,00 % | 01.03.2038            | 200.981          | 0,35                         |
| 1.890.000  | Peruvian Government International Bond*              | 8,75 % | 21.11.2033            | 2.251.368        | 3,91                         |
| 300.000  | Qatar Government International Bond*                 | 4,82 % | 14.03.2049            | 271.700          | 0,47                         |
| 221.000  | Republic of Poland Government International Bond*    | 5,13 % | 18.09.2034            | 214.340          | 0,37                         |
| 174.000  | Republic of Poland Government International Bond*    | 5,50 % | 18.03.2054            | 160.406          | 0,28                         |
| 130.000  | Romanian Government International Bond*              | 5,75 % | 24.03.2035            | 116.195          | 0,20                         |
| 280.000  | Uruguay Government International Bond*               | 5,10 % | 18.06.2050            | 257.767          | 0,45                         |

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                  | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 72,67 % (31. Dezember 2023: 74,18 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |        |                       |                   |                              |
| 1.290.000  | Uruguay Government International Bond* | 7,88 % | 15.01.2033            | 1.501.257         | 2,61                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |  |        |                       | <b>15.763.163</b> | <b>27,42</b>                 |
| <b>Uruguayischer Peso</b>  |  |        |                       |                   |                              |
| 1.721.498  | Uruguay Government International Bond* | 8,25 % | 21.05.2031            | 36.685            | 0,06                         |
| <b>Uruguayischer Peso insgesamt</b>                                      |  |        |                       | <b>36.685</b>     | <b>0,06</b>                  |
| <b>Staatsanleihen insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>41.785.641</b> | <b>72,67</b>                 |
| <b>Anlagen insgesamt</b>   |  |        |                       | <b>52.140.845</b> | <b>90,68</b>                 |

Devisenterminkontrakte 0,64 % (31. Dezember 2023: 3,57 %)

| Geforderter<br>Betrag | Zu zahlender<br>Betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|-----------------------|------------------------|-----------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------------|------------------------------|
| 488.437.636 COP       | 110.163 US\$           | 16.01.2025            | Goldman Sachs International    | 1         | 501                                  | 0,00                         |
| 669.709.536 COP       | 151.745 US\$           | 13.01.2025            | Goldman Sachs International    | 1         | 55                                   | 0,00                         |
| 1.108.797.965 COP     | 249.135 US\$           | 16.01.2025            | State Street Bank and Trust Co | 3         | 2.082                                | 0,00                         |
| 96.595 €              | 39.960.465 HUF         | 19.03.2025            | BNP Paribas                    | 1         | 147                                  | 0,00                         |
| 230.144 €             | 980.130 PLN            | 17.01.2025            | Citibank NA                    | 2         | 1.275                                | 0,00                         |
| 44.620 €              | 1.121.855 CZK          | 17.01.2025            | Goldman Sachs International    | 1         | 75                                   | 0,00                         |
| 96.932 €              | 39.927.692 HUF         | 19.03.2025            | Goldman Sachs International    | 1         | 579                                  | 0,00                         |
| 188.685 €             | 77.789.507 HUF         | 19.03.2025            | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 960                                  | 0,00                         |
| 152.346.876 HUF       | 367.693 €              | 19.03.2025            | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 29                                   | 0,00                         |
| 220.485 MYR           | 49.112 US\$            | 19.03.2025            | HSBC Bank Plc                  | 1         | 353                                  | 0,00                         |
| 319.734 MYR           | 71.183 US\$            | 19.03.2025            | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 548                                  | 0,00                         |
| 2.452.475 RON         | 489.180 €              | 17.01.2025            | BNP Paribas                    | 6         | 3.163                                | 0,01                         |
| 350.251 RON           | 70.059 €               | 17.01.2025            | Citibank NA                    | 2         | 248                                  | 0,00                         |
| 354.631 RON           | 70.937 €               | 17.01.2025            | Deutsche Bank AG               | 1         | 250                                  | 0,00                         |
| 826.013 RON           | 164.566 €              | 17.01.2025            | JPMorgan Chase Bank            | 3         | 1.266                                | 0,00                         |
| 23.050.034 THB        | 676.562 US\$           | 19.03.2025            | HSBC Bank Plc                  | 2         | 2.854                                | 0,01                         |
| 3.677.476 THB         | 106.699 US\$           | 09.01.2025            | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 1.198                                | 0,00                         |
| 646.064 US\$          | 613.925 €              | 05.02.2025            | Barclays Bank Plc              | 1         | 9.482                                | 0,02                         |
| 32.319 US\$           | 508.723.475 IDR        | 06.01.2025            | BNP Paribas                    | 1         | 768                                  | 0,00                         |
| 241 US\$              | 1.062 MYR              | 19.03.2025            | BNP Paribas                    | 1         | 3                                    | 0,00                         |
| 131.264 US\$          | 579.727 MYR            | 14.02.2025            | BNP Paribas                    | 1         | 1.365                                | 0,00                         |
| 102.762 US\$          | 136.960 SGD            | 14.02.2025            | BNP Paribas                    | 1         | 2.191                                | 0,00                         |
| 101.310 US\$          | 136.349 SGD            | 20.03.2025            | Citibank NA                    | 1         | 1.055                                | 0,00                         |
| 101.260 US\$          | 144.939.819 KRW        | 20.03.2025            | Citibank NA                    | 1         | 2.912                                | 0,01                         |
| 295.685 US\$          | 9.925.259 THB          | 09.01.2025            | Citibank NA                    | 2         | 4.477                                | 0,01                         |
| 1.201.787 US\$        | 8.720.695 CNY          | 13.02.2025            | Citibank NA                    | 1         | 13.215                               | 0,02                         |
| 485.194 US\$          | 460.849 €              | 03.01.2025            | Citibank NA                    | 2         | 7.984                                | 0,01                         |

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 0,64 % (31. Dezember 2023: 3,57 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 152.402 US\$  | 669.709.536 COP     | 13.01.2025       | Citibank NA                    | 1         | 603                            | 0,00                 |
| 102.942 US\$  | 1.662.321.499 IDR   | 19.03.2025       | Citibank NA                    | 1         | 824                            | 0,00                 |
| 41.425 US\$   | 654.359.050 IDR     | 06.01.2025       | Citibank NA                    | 1         | 841                            | 0,00                 |
| 1.114.677 US\$  | 4.897.725.374 COP   | 16.01.2025       | Deutsche Bank AG               | 1         | 5.016                          | 0,01                 |
| 232.057 US\$  | 7.359.961 TWD       | 22.01.2025       | Deutsche Bank AG               | 2         | 8.198                          | 0,02                 |
| 276.710 US\$  | 23.624.928 INR      | 19.03.2025       | Deutsche Bank AG               | 1         | 2.655                          | 0,01                 |
| 371.810 US\$  | 21.705.533 PHP      | 19.03.2025       | Deutsche Bank AG               | 1         | 528                            | 0,00                 |
| 80.576 US\$   | 1.259.569.775 IDR   | 06.01.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | 2.457                          | 0,01                 |
| 85.776 US\$   | 376.782.964 COP     | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | 409                            | 0,00                 |
| 318.016 US\$  | 310.969.238 CLP     | 19.03.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | 5.618                          | 0,01                 |
| 160.780 US\$  | 13.742.648 INR      | 19.03.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | 1.361                          | 0,00                 |
| 102.831 US\$  | 458.596 MYR         | 26.02.2025       | HSBC Bank Plc                  | 1         | 26                             | 0,00                 |
| 115.403 US\$  | 1.793.653.193 IDR   | 06.01.2025       | HSBC Bank Plc                  | 1         | 4.160                          | 0,01                 |
| 276.648 US\$  | 23.624.928 INR      | 19.03.2025       | HSBC Bank Plc                  | 1         | 2.593                          | 0,01                 |
| 36.065 US\$   | 51.394.787 KRW      | 19.03.2025       | HSBC Bank Plc                  | 1         | 1.192                          | 0,00                 |
| 118.742 US\$  | 3.872.177 THB       | 02.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 5.172                          | 0,01                 |
| 117.485 US\$  | 3.924.573 THB       | 09.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 2.337                          | 0,00                 |
| 705.584 US\$  | 674.431 €           | 03.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 3         | 7.211                          | 0,01                 |
| 605.469 US\$  | 571.060 €           | 15.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 13.846                         | 0,02                 |
| 100.857 US\$  | 3.434.498 THB       | 21.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 25                             | 0,00                 |
| 383.513 US\$  | 6.022.859.541 IDR   | 06.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | 9.972                          | 0,02                 |
| 103.415 US\$  | 458.873 MYR         | 06.03.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 517                            | 0,00                 |
| 13.551.893 US\$   | 12.860.863 €        | 04.02.2025       | Standard Chartered Bank        | 1         | 216.972                        | 0,38                 |
| 43.628 US\$   | 3.754.993 INR       | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 70                             | 0,00                 |
| 81.612 US\$   | 1.668.686 MXN       | 04.02.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 1.830                          | 0,00                 |
| 26.189 US\$   | 114.085.593 COP     | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 341                            | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i>   |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 204.462 US\$  | 323.936 AUD         | 13.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 2         | 3.879                          | 0,01                 |
| <i>Abgesicherte Klassen NOK</i>   |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 4.496 NOK   | 396 US\$            | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp           | 3         | 0                              | 0,00                 |
| 290.404 US\$  | 3.222.234 NOK       | 13.03.2025       | Citibank NA                    | 2         | 6.740                          | 0,01                 |
| 510.439 US\$  | 5.728.945 NOK       | 13.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 2         | 6.099                          | 0,01                 |
| 3 US\$  | 31 NOK              | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp           | 1         | 0                              | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>~</sup></b> |                     |                  |                                |           | <b>370.527</b>                 | <b>0,64</b>          |

### Futures-Kontrakte 0,50 % (31. Dezember 2023: 1,28 %)

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung                | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (7)              | Euro-BOBL Future March 2025 | 9.858                          | 0,02                 |
| (46)             | Euro-Bund Future March 2025 | 171.479                        | 0,30                 |

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Futures-Kontrakte 0,50 % (31. Dezember 2023: 1,28 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte  | Beschreibung                                     | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|--|--------------------------------|----------------------|
| (6)   | Euro-Buxl 30-Year Bond Future March 2025         | 53.184                         | 0,09                 |
| (43)  | US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2025 | 48.086                         | 0,08                 |
| 6   | US Treasury 2-Year Note (CBT) Future March 2025  | 703                            | 0,00                 |
| (1)   | US Treasury Ultra Bond (CBT) Future March 2025   | 3.397                          | 0,01                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten *</b> |  | <b>286.707</b>                 | <b>0,50</b>          |

### Zinsswap-Kontrakte 0,16 % (31. Dezember 2023: 0,03 %)

|  | Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei                              | Erhalt/(Zahlung)# | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|-------------|------------|--|-------------------|-----------------|--------------------|--------------------------------|----------------------|
| MXN  | 4.279.674   | 08.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt            | 0,00 %          | 1D TIIE + 24bps    | 17.966                         | 0,03                 |
| MXN  | 3.689.545   | 25.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt            | 0,00 %          | 1D TIIE + 24bps    | 16.221                         | 0,03                 |
| MXN  | 2.474.111   | 29.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt            | 0,00 %          | 1D TIIE + 24bps    | 10.965                         | 0,02                 |
| MXN  | 2.369.982   | 19.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt            | 0,00 %          | 28D MXIBOR         | 10.279                         | 0,02                 |
| MXN  | 2.313.879   | 29.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt            | 0,00 %          | 1D TIIE + 24bps    | 10.255                         | 0,02                 |
| MXN  | 2.318.249   | 11.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt            | 0,00 %          | 1D TIIE + 24bps    | 9.804                          | 0,02                 |
| MXN  | 2.318.248   | 11.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt            | 0,00 %          | 1D TIIE + 24bps    | 9.804                          | 0,02                 |
| MXN  | 500.566     | 19.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt            | 0,00 %          | 1D TIIE + 24bps    | 2.162                          | 0,00                 |
| MXN  | 3.689.545   | 13.05.2027 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)         | 9,69 %          | 1D TIIE + 24bps    | 1.234                          | 0,00                 |
| CLP  | 6.474.990   | 05.06.2030 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt            | 2,33 %          | 1D CLICP           | 917                            | 0,00                 |
| CLP  | 367.235.941 | 02.05.2027 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)         | 5,36 %          | 1D CLICP           | 2                              | 0,00                 |
| COP  | 203.427.620 | 08.08.2034 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt            | 7,81 %          | 1D COOVIBR         | 1                              | 0,00                 |
| COP  | 288.523.160 | 15.10.2034 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt            | 7,95 %          | 1D COOVIBR         | 1                              | 0,00                 |
| KRW  | 164.616.486 | 19.12.2034 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt            | 2,67 %          | 3M KWDCD           | 1                              | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Zinsswapkontrakten **</b> |             |            |  |                   |                 |                    | <b>89.612</b>                  | <b>0,16</b>          |

#Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

|  | Zeitwert US\$     | % des Nettovermögens |
|--|-------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> | <b>52.887.691</b> | <b>91,98</b>         |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (2,13 %) (31. Dezember 2023: (0,43 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 763.633.701 COP    | 173.711 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (697)                           | (0,00)               |
| 1.167.697 CZK      | 46.543 €            | 17.01.2025       | Citibank NA                 | 2         | (181)                           | (0,00)               |
| 79.375 €           | 396.742 RON         | 17.01.2025       | Barclays Bank Plc           | 2         | (264)                           | (0,00)               |

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (2,13 %) (31. Dezember 2023: (0,43 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 613.925 €          | 645.207 US\$        | 03.01.2025       | Barclays Bank Plc              | 1         | (9.487)                         | (0,02)               |
| 38.301 €           | 40.261 US\$         | 05.02.2025       | Barclays Bank Plc              | 1         | (546)                           | (0,00)               |
| 382.054 €          | 1.910.732 RON       | 17.01.2025       | BNP Paribas                    | 4         | (1.499)                         | (0,00)               |
| 571.060 €          | 602.004 US\$        | 15.01.2025       | Citibank NA                    | 1         | (10.381)                        | (0,02)               |
| 143.285 €          | 717.778 RON         | 17.01.2025       | Citibank NA                    | 3         | (808)                           | (0,00)               |
| 68.264 €           | 292.325 PLN         | 17.01.2025       | Citibank NA                    | 1         | (10)                            | (0,00)               |
| 34.357 €           | 14.332.095 HUF      | 19.03.2025       | Citibank NA                    | 1         | (246)                           | (0,00)               |
| 19.185 €           | 20.241 US\$         | 03.01.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | (375)                           | (0,00)               |
| 90.102 €           | 450.639 RON         | 17.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (358)                           | (0,00)               |
| 38.318 €           | 40.254 US\$         | 05.02.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (522)                           | (0,00)               |
| 58.257 €           | 61.598 US\$         | 03.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | (1.273)                         | (0,00)               |
| 22.835 €           | 9.515.761 HUF       | 19.03.2025       | Standard Chartered Bank        | 1         | (138)                           | (0,00)               |
| 1.049.874 €        | 1.094.311 US\$      | 04.02.2025       | Standard Chartered Bank        | 3         | (5.738)                         | (0,01)               |
| 194.123 €          | 203.648 US\$        | 17.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (2.518)                         | (0,01)               |
| 3.427.954.972 IDR  | 224.494 US\$        | 06.01.2025       | BNP Paribas                    | 1         | (11.891)                        | (0,02)               |
| 3.813.125.400 IDR  | 234.763 US\$        | 19.03.2025       | BNP Paribas                    | 1         | (520)                           | (0,00)               |
| 2.040.261.733 IDR  | 127.761 US\$        | 06.01.2025       | Citibank NA                    | 2         | (1.223)                         | (0,00)               |
| 1.149.232.329 IDR  | 72.930 US\$         | 06.01.2025       | Deutsche Bank AG               | 1         | (1.654)                         | (0,00)               |
| 896.658.263 IDR    | 56.266 US\$         | 19.03.2025       | HSBC Bank Plc                  | 1         | (1.183)                         | (0,00)               |
| 3.621.716.000 IDR  | 229.556 US\$        | 06.01.2025       | HSBC Bank Plc                  | 1         | (4.936)                         | (0,01)               |
| 6.274.192 INR      | 73.398 US\$         | 19.03.2025       | BNP Paribas                    | 1         | (616)                           | (0,00)               |
| 22.314.152 INR     | 258.865 US\$        | 19.03.2025       | HSBC Bank Plc                  | 1         | (15)                            | (0,00)               |
| 15.316.736 ¥       | 102.835 US\$        | 06.03.2025       | Barclays Bank Plc              | 1         | (4.672)                         | (0,01)               |
| 29.148.529 KZT     | 57.042 US\$         | 14.05.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | (3.390)                         | (0,01)               |
| 1.224.530 MXN      | 60.245 US\$         | 04.02.2025       | BNP Paribas                    | 1         | (1.698)                         | (0,00)               |
| 9.981.951 MXN      | 484.310 US\$        | 04.02.2025       | Citibank NA                    | 2         | (7.057)                         | (0,01)               |
| 2.729.940 MXN      | 134.347 US\$        | 04.02.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | (3.824)                         | (0,01)               |
| 2.729.128 MXN      | 132.790 US\$        | 04.02.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (2.306)                         | (0,01)               |
| 2.503.774 MYR      | 565.987 US\$        | 19.03.2025       | BNP Paribas                    | 1         | (4.275)                         | (0,01)               |
| 491.138 MYR        | 110.187 US\$        | 19.03.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (2)                             | (0,00)               |
| 1.128.257 PLN      | 263.809 €           | 17.01.2025       | Citibank NA                    | 2         | (312)                           | (0,00)               |
| 137.253 SGD        | 102.813 US\$        | 14.02.2025       | Citibank NA                    | 1         | (2.027)                         | (0,01)               |
| 21.148.162 THB     | 652.413 US\$        | 02.01.2025       | Citibank NA                    | 1         | (32.141)                        | (0,06)               |
| 20.087.661 THB     | 596.729 US\$        | 19.03.2025       | Citibank NA                    | 2         | (4.630)                         | (0,01)               |
| 3.880.978 THB      | 121.432 US\$        | 02.01.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | (7.604)                         | (0,01)               |
| 2.792.238 THB      | 83.135 US\$         | 09.01.2025       | HSBC Bank Plc                  | 1         | (1.210)                         | (0,00)               |
| 39.866 THB         | 1.230 US\$          | 02.01.2025       | Standard Chartered Bank        | 1         | (61)                            | (0,00)               |
| 7.337.864 TWD      | 229.714 US\$        | 22.01.2025       | Deutsche Bank AG               | 2         | (6.527)                         | (0,01)               |
| 101.284 US\$       | 451.530.376 COP     | 16.01.2025       | BNP Paribas                    | 1         | (1.017)                         | (0,00)               |
| 108.647 US\$       | 3.736.462 THB       | 09.01.2025       | Citibank NA                    | 1         | (981)                           | (0,00)               |

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (2,13 %) (31. Dezember 2023: (0,43 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 274.578 US\$   | 4.478.134.418 IDR   | 19.03.2025       | Citibank NA                    | 1         | (517)                           | (0,00)               |
| 620.576 US\$   | 21.196.829 THB      | 02.01.2025       | HSBC Bank Plc                  | 1         | (1.123)                         | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i>  |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 16.127.603 AUD   | 10.419.077 US\$     | 13.03.2025       | Citibank NA                    | 2         | (432.759)                       | (0,74)               |
| 353.276 AUD  | 228.284 US\$        | 13.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (9.533)                         | (0,02)               |
| <i>Abgesicherte Klassen NOK</i>  |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 300.413.684 NOK  | 27.074.827 US\$     | 13.03.2025       | Citibank NA                    | 2         | (628.352)                       | (1,09)               |
| 4.633.741 NOK  | 417.707 US\$        | 13.03.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | (9.782)                         | (0,02)               |
| 160.994 NOK  | 14.405 US\$         | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp           | 3         | (232)                           | (0,00)               |
| 12.528 US\$  | 142.858 NOK         | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp           | 1         | (48)                            | (0,00)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                                |           | <b>(1.223.159)</b>              | <b>(2,12)</b>        |

### Futures-Kontrakte (0,41 %) (31. Dezember 2023: (0,55 %))

| Anzahl Kontrakte  | Beschreibung                                    | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens    |
|---|---|---------------------------------|-------------------------|
| 20  | Euro-BOBL Future March 2025                     | (19.669)                        | (0,03)                  |
| 1   | Euro-Schatz Future March 2025                   | (383)                           | (0,00)                  |
| 58  | US Treasury 5-Year Note (CBT) Future March 2025 | (26.281)                        | (0,05)                  |
| 29  | US Treasury Long Bond (CBT) Future March 2025   | (76.578)                        | (0,13)                  |
| 30  | US Treasury Ultra Bond (CBT) Future March 2025  | (115.599)                       | (0,20)                  |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten <sup>±</sup></b> |   |                                 | <b>(238.510) (0,41)</b> |

### Credit-Default-Swap-Kontrakte (0,01 %) (31. Dezember 2023: (0,00 %))

| Nominalwert   | Fälligkeit | Gegenpartei                 | Referenzverbindlichkeit                      | Zeitwert US\$  | % des Nettovermögens |
|---|------------|-----------------------------|--|----------------|----------------------|
| USD 676.577   | 20.12.2029 | ICE Clear U.S. <sup>1</sup> | Buying default protection on CDX.EM.IG.42.V1 | (4.783)        | (0,01)               |
| <b>Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt <sup>±</sup></b> |            |                             |  | <b>(4.783)</b> | <b>(0,01)</b>        |

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

### Zinsswap-Kontrakte (0,19 %) (31. Dezember 2023: (0,06 %))

| Nominalwert     | Fälligkeit | Gegenpartei                              | Erhalt/(Zahlung) <sup>#</sup> | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------------|------------|--|-------------------------------|-----------------|--------------------|---------------------------------|----------------------|
| KRW 743.496.739 | 19.12.2026 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 2,69 %          | 3M KWDCD           | (0)                             | (0,00)               |
| CLP 130.694.684 | 24.10.2033 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | Erhalt                        | 6,12 %          | 1D CLICP           | (6)                             | (0,00)               |
| HUF 4.379.518   | 21.03.2029 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 6,18 %          | 6M BUBOR           | (167)                           | (0,00)               |
| MXN 2.313.879   | 30.10.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 9,26 %          | 1D TIIE + 24bps    | (412)                           | (0,00)               |
| MXN 500.566     | 09.03.2029 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)                     | 8,77 %          | 1D TIIE + 24bps    | (524)                           | (0,00)               |
| CLP 17.013.289  | 09.11.2025 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 1,24 %          | 1D CLICP           | (533)                           | (0,00)               |
| CLP 94.826.734  | 13.04.2025 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | Erhalt                        | 7,51 %          | 1D CLICP           | (652)                           | (0,00)               |

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Zinsswap-Kontrakte (0,19 %) (31. Dezember 2023: (0,06 %)) (Fortsetzung)

|   | Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei                   | Erhalt/(Zahlung) <sup>#</sup> | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|-------------|------------|-------------------------------|-------------------------------|-----------------|--------------------|---------------------------------|----------------------|
| CZK   | 3.065.321   | 11.07.2029 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | Erhalt                        | 3,81 %          | 6M PRIBOR          | (785)                           | (0,00)               |
| CZK   | 3.698.242   | 08.02.2029 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 3,50 %          | 6M PRIBOR          | (917)                           | (0,00)               |
| MXN   | 2.369.982   | 08.10.2038 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | Erhalt                        | 9,77 %          | 1D TIIE + 24bps    | (1.258)                         | (0,00)               |
| MXN   | 2.318.248   | 17.08.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 8,91 %          | 1D TIIE + 24bps    | (1.481)                         | (0,00)               |
| MXN   | 2.318.249   | 17.08.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 8,94 %          | 1D TIIE + 24bps    | (1.503)                         | (0,00)               |
| HUF   | 26.407.856  | 10.12.2034 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 6,48 %          | 6M BUBOR           | (1.772)                         | (0,00)               |
| HUF   | 51.801.768  | 11.12.2029 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 6,26 %          | 6M BUBOR           | (2.014)                         | (0,00)               |
| MXN   | 500.566     | 19.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 0,00 %          | 28D MXIBOR         | (2.171)                         | (0,01)               |
| MXN   | 2.474.111   | 03.09.2029 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 8,80 %          | 1D TIIE + 24bps    | (2.786)                         | (0,01)               |
| MXN   | 4.279.674   | 26.02.2029 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 8,71 %          | 1D TIIE + 24bps    | (4.873)                         | (0,01)               |
| MXN   | 2.369.982   | 19.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 0,00 %          | 1D TIIE + 24bps    | (10.234)                        | (0,02)               |
| MXN   | 2.313.879   | 29.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 0,00 %          | 28D MXIBOR         | (10.282)                        | (0,02)               |
| MXN   | 2.474.111   | 29.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 0,00 %          | 28D MXIBOR         | (10.994)                        | (0,02)               |
| MXN   | 3.689.545   | 25.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 0,00 %          | 28D MXIBOR         | (16.272)                        | (0,03)               |
| MXN   | 4.279.674   | 08.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 0,00 %          | 28D MXIBOR         | (18.031)                        | (0,03)               |
| MXN   | 4.636.497   | 11.12.2025 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 0,00 %          | 28D MXIBOR         | (19.691)                        | (0,04)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Zinsswapkontrakten <sup>∞</sup></b> |             |            |                               |                               |                 |                    | <b>(107.358)</b>                | <b>(0,19)</b>        |

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

|   | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens |
|---|--------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(1.573.810)</b> | <b>(2,73)</b>        |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>51.313.881</b>  | <b>89,25</b>         |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>6.182.827</b>   | <b>10,75</b>         |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>57.496.708</b>  | <b>100,00</b>        |

| Portfolioanalyse  | US\$              | % des Gesamtvermögens |
|---|-------------------|-----------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 46.678.340        | 78,84                 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden            | 5.462.505         | 9,23                  |
| ± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden                          | 48.197            | 0,08                  |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap                            | (875.161)         | (1,48)                |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>51.313.881</b> | <b>86,67</b>          |

## Emerging Markets Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der<br>Anteile                              | Wertpapierbezeichnung  | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|-------------------|------------------------------|
| <b>Aktien 97,83 % (31. Dezember 2023: 96,27 %)</b> |  |                   |                              |
| <b>Brasilianischer Real</b>                        |  |                   |                              |
| 181.647  | Banco BTG Pactual SA*  | 799.056           | 0,76                         |
| 66.895   | Compania de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo SABESP* | 956.884           | 0,92                         |
| 149.830  | Embraer SA*  | 1.374.155         | 1,31                         |
| 124.827  | Petroleo Brasileiro SA - Preferred Shares*                   | 738.287           | 0,71                         |
| <b>Brasilianischer Real insgesamt</b>              |  | <b>3.868.382</b>  | <b>3,70</b>                  |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi</b>                  |  |                   |                              |
| 30.100   | Contemporary Ampere Technology Co Ltd Class A*               | 1.090.595         | 1,04                         |
| 10.400   | NAURA Technology Group Co Ltd Class A*                       | 553.892           | 0,53                         |
| 247.000  | Ningbo Sanxing Medical Electric Co Ltd Class A*              | 1.034.900         | 0,99                         |
| 61.100   | Proya Cosmetics Co Ltd Class A*                              | 704.920           | 0,68                         |
| 16.800   | Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co Ltd Class A*     | 583.532           | 0,56                         |
| 110.000  | Sieyuan Electric Co Ltd Class A*                             | 1.089.287         | 1,04                         |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt</b>        |  | <b>5.057.126</b>  | <b>4,84</b>                  |
| <b>Euro</b>  |  |                   |                              |
| 624.884  | Alpha Services & Holdings SA*                                | 1.046.308         | 1,00                         |
| <b>Euro insgesamt</b>                              |  | <b>1.046.308</b>  | <b>1,00</b>                  |
| <b>Hongkong-Dollar</b>                             |  |                   |                              |
| 266.624  | Alibaba Group Holding Ltd*                                   | 2.828.265         | 2,71                         |
| 25.500   | BYD Co Ltd - H Shares*                                       | 875.173           | 0,84                         |
| 2.039.000  | China Construction Bank Corp - H Shares*                     | 1.700.927         | 1,63                         |
| 273.500  | China Merchants Bank Co Ltd - H Shares*                      | 1.408.351         | 1,35                         |
| 47.950   | JD.com Inc Class A*  | 839.501           | 0,80                         |
| 103.000  | Meituan Class B*   | 2.011.483         | 1,92                         |
| 77.600   | Midea Group Co Ltd*  | 754.727           | 0,72                         |
| 145.000  | Ping An Insurance Group Co of China Ltd - H Shares*          | 859.590           | 0,82                         |
| 103.400  | Tencent Holdings Ltd*  | 5.550.731         | 5,31                         |
| 294.400  | Xiaomi Corp Class B*   | 1.307.526         | 1,25                         |
| <b>Hongkong-Dollar insgesamt</b>                   |  | <b>18.136.274</b> | <b>17,35</b>                 |
| <b>Ungarischer Forint</b>                          |  |                   |                              |
| 20.881   | OTP Bank Nyrt*   | 1.140.975         | 1,09                         |
| 33.893   | Richter Gedeon Nyrt*   | 887.629           | 0,85                         |
| <b>Ungarischer Forint insgesamt</b>                |  | <b>2.028.604</b>  | <b>1,94</b>                  |
| <b>Indische Rupie</b>                              |  |                   |                              |
| 97.780   | Anant Raj Ltd*   | 975.987           | 0,93                         |

## Emerging Markets Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile   | Wertpapierbezeichnung                      | Zeitwert US\$     | % des Nettovermögens |
|--|--|-------------------|----------------------|
| <b>Aktien 97,83 % (31. Dezember 2023: 96,27 %) (Fortsetzung)</b> |  |                   |                      |
| <b>Indische Rupie (Fortsetzung)</b>                              |  |                   |                      |
| 9.819  | Apollo Hospitals Enterprise Ltd*           | 836.775           | 0,80                 |
| 231.314  | ASK Automotive Ltd*                        | 1.282.965         | 1,23                 |
| 58.496   | AurionPro Solutions Ltd*                   | 1.180.664         | 1,13                 |
| 165.784  | Bharat Electronics Ltd*                    | 568.339           | 0,54                 |
| 32.294   | Bharti Airtel Ltd*                         | 601.040           | 0,57                 |
| 47.059   | Cholamandalam Investment & Finance Co Ltd* | 652.894           | 0,62                 |
| 115.247  | CMS Info Systems Ltd*                      | 659.602           | 0,63                 |
| 176.805  | Dam Capital Advisors Ltd**                 | 787.854           | 0,76                 |
| 18.247   | Doms Industries Ltd*                       | 558.405           | 0,53                 |
| 10.943   | Hindustan Aeronautics Ltd*                 | 534.408           | 0,51                 |
| 51.138   | ICICI Bank Ltd*                            | 766.648           | 0,73                 |
| 65.363   | IndusInd Bank Ltd*                         | 733.536           | 0,70                 |
| 22.232   | JB Chemicals & Pharmaceuticals Ltd*        | 476.106           | 0,46                 |
| 10.627   | Kaynes Technology India Ltd*               | 919.783           | 0,88                 |
| 4.989  | KEI Industries Ltd*                        | 258.145           | 0,25                 |
| 11.747   | Larsen & Toubro Ltd*                       | 495.319           | 0,47                 |
| 33.623   | Mahindra & Mahindra Ltd*                   | 1.184.019         | 1,13                 |
| 120.104  | PDS Ltd*                                   | 812.957           | 0,78                 |
| 80.468   | PNB Housing Finance Ltd*                   | 827.108           | 0,79                 |
| 125.122  | Premier Energies Ltd*                      | 1.979.562         | 1,89                 |
| 47.984   | Reliance Industries Ltd*                   | 681.532           | 0,65                 |
| 663.892  | SBFC Finance Ltd*                          | 703.333           | 0,67                 |
| 1.363.624  | SpiceJet Ltd*                              | 883.824           | 0,85                 |
| 40.079   | Sun Pharmaceutical Industries Ltd*         | 884.780           | 0,85                 |
| 72.185   | Tbo Tek Ltd*                               | 1.462.523         | 1,40                 |
| 340  | Unimech Aerospace & Manufacturing Ltd**    | 5.465             | 0,01                 |
| 41.533   | Venus Pipes & Tubes Ltd*                   | 730.107           | 0,70                 |
| 5.535  | Voltamp Transformers Ltd*                  | 654.270           | 0,63                 |
| 87.318   | XPRO India Ltd*                            | 1.518.640         | 1,45                 |
| 26.249   | Yasho Industries Ltd*                      | 607.064           | 0,58                 |
|  | <b>Indische Rupie insgesamt</b>            | <b>25.223.654</b> | <b>24,12</b>         |
| <b>Indonesische Rupiah</b>                                       |  |                   |                      |
| 4.676.600  | Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT*      | 1.258.601         | 1,20                 |
|  | <b>Indonesische Rupiah insgesamt</b>       | <b>1.258.601</b>  | <b>1,20</b>          |
| <b>Japanischer Yen</b>   |  |                   |                      |
| 2.300  | Disco Corp*                                | 610.856           | 0,58                 |
|  | <b>Japanischer Yen insgesamt</b>           | <b>610.856</b>    | <b>0,58</b>          |

## Emerging Markets Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile   | Wertpapierbezeichnung                                | Zeitwert US\$    | % des Nettovermögens |
|--|--|------------------|----------------------|
| <b>Aktien 97,83 % (31. Dezember 2023: 96,27 %) (Fortsetzung)</b> |  |                  |                      |
| <b>Mexikanischer Peso</b>  |  |                  |                      |
| 143.955  | Grupo Financiero Banorte SAB de CV Class O*          | 930.218          | 0,89                 |
| <b>Mexikanischer Peso insgesamt</b>                              |  | <b>930.218</b>   | <b>0,89</b>          |
| <b>Neuer taiwanesischer Dollar</b>                               |  |                  |                      |
| 43.000   | Accton Technology Corp*                              | 1.013.863        | 0,97                 |
| 330.000  | ASE Technology Holding Co Ltd*                       | 1.630.649        | 1,56                 |
| 82.000   | Delta Electronics Inc*                               | 1.076.759        | 1,03                 |
| 431.000  | Far EasTone Telecommunications Co Ltd*               | 1.175.293        | 1,12                 |
| 264.000  | Hon Hai Precision Industry Co Ltd*                   | 1.481.676        | 1,42                 |
| 35.000   | MediaTek Inc*  | 1.510.622        | 1,45                 |
| <b>Neuer taiwanesischer Dollar insgesamt</b>                     |  | <b>7.888.862</b> | <b>7,55</b>          |
| <b>Philippinischer Peso</b>                                      |  |                  |                      |
| 432.890  | BDO Unibank Inc*                                     | 1.070.871        | 1,02                 |
| <b>Philippinischer Peso insgesamt</b>                            |  | <b>1.070.871</b> | <b>1,02</b>          |
| <b>Polnischer Zloty</b>  |  |                  |                      |
| 136.200  | Zabka Group SA*                                      | 634.738          | 0,61                 |
| <b>Polnischer Zloty insgesamt</b>                                |  | <b>634.738</b>   | <b>0,61</b>          |
| <b>Britisches Pfund</b>  |  |                  |                      |
| 22.398   | Rio Tinto Plc*                                       | 1.324.861        | 1,27                 |
| <b>Britisches Pfund insgesamt</b>                                |  | <b>1.324.861</b> | <b>1,27</b>          |
| <b>Saudi-Arabischer Riyal</b>                                    |  |                  |                      |
| 70.414   | Al Rajhi Bank*                                       | 1.772.812        | 1,70                 |
| <b>Saudi-Arabischer Riyal insgesamt</b>                          |  | <b>1.772.812</b> | <b>1,70</b>          |
| <b>Südafrikanischer Rand</b>                                     |  |                  |                      |
| 47.573   | Bid Corp Ltd*  | 1.085.507        | 1,04                 |
| 91.273   | Standard Bank Group Ltd*                             | 1.072.639        | 1,02                 |
| <b>Südafrikanischer Rand insgesamt</b>                           |  | <b>2.158.146</b> | <b>2,06</b>          |
| <b>Südkoreanischer Won</b>                                       |  |                  |                      |
| 13.704   | DB Insurance Co Ltd*                                 | 952.158          | 0,91                 |
| 3.098  | HD Hyundai Electric Co Ltd*                          | 796.518          | 0,76                 |
| 5.067  | HD Korea Shipbuilding & Offshore Engineering Co Ltd* | 779.252          | 0,75                 |
| 19.500   | Kia Corp*  | 1.319.556        | 1,26                 |
| 51.303   | Samsung Electronics Co Ltd*                          | 1.830.841        | 1,75                 |
| 21.235   | Sanil Electric Co Ltd*                               | 974.610          | 0,93                 |

## Emerging Markets Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile   | Wertpapierbezeichnung                                |                       | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Aktien 97,83 % (31. Dezember 2023: 96,27 %) (Fortsetzung)</b>         |  |                       |                    |                              |
| <b>Südkoreanischer Won (Fortsetzung)</b>                                 |  |                       |                    |                              |
| 11.956   | SK Hynix Inc*  |                       | 1.370.042          | 1,31                         |
| <b>Südkoreanischer Won insgesamt</b>                                     |  |                       | <b>8.022.977</b>   | <b>7,67</b>                  |
| <b>VAE-Dirham</b>  |  |                       |                    |                              |
| 269.832  | Abu Dhabi Islamic Bank PJSC*                         |                       | 1.015.254          | 0,97                         |
| 1.338.202  | Adnoc Gas Plc*                                       |                       | 1.278.798          | 1,22                         |
| <b>Gesamt VAE-Dirham</b>   |  |                       | <b>2.294.052</b>   | <b>2,19</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>   |  |                       |                    |                              |
| 5.776  | Credicorp Ltd*                                       |                       | 1.058.856          | 1,01                         |
| 660  | MercadoLibre Inc*                                    |                       | 1.122.290          | 1,07                         |
| 11.684   | NetEase Inc ADR*                                     |                       | 1.042.330          | 1,00                         |
| 14.580   | NVIDIA Corp*   |                       | 1.957.948          | 1,87                         |
| 2.452  | Onto Innovation Inc*                                 |                       | 408.675            | 0,39                         |
| 11.595   | PDD Holdings Inc ADR*                                |                       | 1.124.599          | 1,08                         |
| 50.699   | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR*       |                       | 10.012.546         | 9,57                         |
| 11.255   | Trip.com Group Ltd ADR*                              |                       | 772.768            | 0,74                         |
| 16.246   | Yum China Holdings Inc*                              |                       | 782.570            | 0,75                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |  |                       | <b>18.282.582</b>  | <b>17,48</b>                 |
| <b>Vietnamesischer Dong</b>  |  |                       |                    |                              |
| 709.900  | Vietnam Technological & Commercial Joint Stock Bank* |                       | 686.641            | 0,66                         |
| <b>Vietnamesischer Dong insgesamt</b>                                    |  |                       | <b>686.641</b>     | <b>0,66</b>                  |
| <b>Aktien insgesamt</b>  |  |                       | <b>102.296.565</b> | <b>97,83</b>                 |
| <b>Immobilienaktiengesellschaften 0,83 % (31. Dezember 2023: 0,53 %)</b> |  |                       |                    |                              |
| <b>Mexikanischer Peso</b>  |  |                       |                    |                              |
| 595.975  | FIBRA Macquarie Mexico                               |                       | 869.911            | 0,83                         |
| <b>Immobilienaktiengesellschaften insgesamt *</b>                        |  |                       | <b>869.911</b>     | <b>0,83</b>                  |
| Anzahl der Anteile   | Wertpapierbezeichnung                                | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
| <b>Participatory Notes 3,01 % (31. Dezember 2023: 0,00 %)</b>            |  |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |  |                       |                    |                              |
| 115.349  | Unimech Aerospace & Manufacturing Ltd                | 09.01.2026            | 1.854.247          | 1,77                         |
| 38.746   | WAAREE Energies Ltd                                  | 05.11.2025            | 1.291.899          | 1,24                         |
| <b>Participatory Notes insgesamt **</b>                                  |  |                       | <b>3.146.146</b>   | <b>3,01</b>                  |
| <b>Anlagen insgesamt</b>   |  |                       | <b>106.312.622</b> | <b>101,67</b>                |

## Emerging Markets Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 0,84 % (31. Dezember 2023: 1,40 %)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens        |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|-----------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 153 AUD  | 94 US\$             | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | 0                              | 0,00                        |
| 196.912 US\$   | 300.400 AUD         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 11        | 10.915                         | 0,01                        |
| 3.988.155 US\$   | 5.922.540 AUD       | 16.01.2025       | UBS AG                      | 3         | 321.146                        | 0,31                        |
| 103.741 US\$   | 156.850 AUD         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 26        | 6.625                          | 0,01                        |
| <i>Abgesicherte Klassen CAD</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 390.722 US\$   | 549.280 CAD         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 3         | 8.614                          | 0,01                        |
| 718.443 US\$   | 993.188 CAD         | 16.01.2025       | Royal Bank of Canada        | 7         | 27.526                         | 0,03                        |
| 625.790 US\$   | 877.364 CAD         | 16.01.2025       | UBS AG                      | 6         | 15.448                         | 0,01                        |
| 68.476 US\$  | 95.231 CAD          | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | 2.228                          | 0,00                        |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 7.066 €  | 7.320 US\$          | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | 0                              | 0,00                        |
| 189.865 US\$   | 176.405 €           | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 5         | 7.101                          | 0,01                        |
| 712.056 US\$   | 668.499 €           | 16.01.2025       | UBS AG                      | 10        | 19.458                         | 0,02                        |
| 4.795.752 US\$   | 4.371.632 €         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 37        | 266.517                        | 0,25                        |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 8.939 US\$   | 6.947 £             | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 6         | 240                            | 0,00                        |
| 5.735 US\$   | 4.512 £             | 16.01.2025       | UBS AG                      | 2         | 84                             | 0,00                        |
| 39.134 US\$  | 30.575 £            | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 10        | 846                            | 0,00                        |
| <i>Abgesicherte Klassen ZAR</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 1.985.965 US\$   | 35.228.678 ZAR      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 14        | 121.357                        | 0,12                        |
| 66.501 US\$  | 1.219.557 ZAR       | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | 1.952                          | 0,00                        |
| 1.213.600 US\$   | 21.704.271 ZAR      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 49        | 64.816                         | 0,06                        |
| 1.157 ZAR  | 61 US\$             | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | 0                              | 0,00                        |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>~</sup></b>                        |                     |                  |                             |           | <b>874.873</b>                 | <b>0,84</b>                 |
|  |                     |                  |                             |           | <b>Zeitwert US\$</b>           | <b>% des Nettovermögens</b> |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |                     |                  |                             |           | <b>107.187.495</b>             | <b>102,51</b>               |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (1,88 %) (31. Dezember 2023: (0,87 %))

| Geforderter Betrag              | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 148.743 AUD                     | 97.847 US\$         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 5         | (5.751)                         | (0,00)               |
| 8.319.049 AUD                   | 5.601.008 US\$      | 16.01.2025       | UBS AG                      | 6         | (450.171)                       | (0,43)               |
| 286.128 AUD                     | 184.332 US\$        | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 54        | (7.173)                         | (0,01)               |
| 7.648 US\$                      | 12.369 AUD          | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (10)                            | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen CAD</i> |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 16.061.662 CAD                  | 11.776.432 US\$     | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 9         | (603.069)                       | (0,58)               |

## Emerging Markets Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Devisenterminkontrakte (1,88 %) (31. Dezember 2023: (0,87 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens         |
|---|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|------------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen CAD (Fortsetzung)</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                              |
| 203.602 CAD   | 143.874 US\$        | 16.01.2025       | Royal Bank of Canada        | 2         | (2.238)                         | (0,00)                       |
| 320.770 CAD   | 232.532 US\$        | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 2         | (9.388)                         | (0,01)                       |
| 50.172 US\$   | 72.201 CAD          | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | (54)                            | (0,00)                       |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                              |
| 319.825 €   | 341.001 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 4         | (9.647)                         | (0,01)                       |
| 8.253.372 €   | 9.093.522 US\$      | 16.01.2025       | UBS AG                      | 6         | (542.612)                       | (0,52)                       |
| 199.139 €   | 213.257 US\$        | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 30        | (6.942)                         | (0,01)                       |
| 19.100 US\$   | 18.445 €            | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | (10)                            | (0,00)                       |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                              |
| 1.505 £   | 1.902 US\$          | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (17)                            | (0,00)                       |
| 2.905 £   | 3.724 US\$          | 16.01.2025       | UBS AG                      | 2         | (87)                            | (0,00)                       |
| 150.751 £   | 197.323 US\$        | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 15        | (8.543)                         | (0,01)                       |
| 2.296 US\$  | 1.835 £             | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (2)                             | (0,00)                       |
| 715 US\$  | 571 £               | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | (0)                             | (0,00)                       |
| <i>Abgesicherte Klassen ZAR</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                              |
| 8.793 US\$  | 166.446 ZAR         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (17)                            | (0,00)                       |
| 71.468.416 ZAR  | 4.036.988 US\$      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 7         | (254.256)                       | (0,24)                       |
| 17.741.557 ZAR  | 1.004.451 US\$      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 62        | (65.414)                        | (0,06)                       |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>                          |                     |                  |                             |           | <b>(1.965.401)</b>              | <b>(1,88)</b>                |
|   |                     |                  |                             |           | <b>Zeitwert US\$</b>            | <b>% des Nettovermögens</b>  |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> |                     |                  |                             |           | <b>(1.965.401)</b>              | <b>(1,88)</b>                |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              |                     |                  |                             |           | <b>105.222.094</b>              | <b>100,63</b>                |
| <b>Sonstige Nettoverbindlichkeiten</b>  |                     |                  |                             |           | <b>(656.999)</b>                | <b>(0,63)</b>                |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   |                     |                  |                             |           | <b>104.565.095</b>              | <b>100,00</b>                |
| <b>Portfolioanalyse</b>   |                     |                  |                             |           | <b>US\$</b>                     | <b>% des Gesamtvermögens</b> |
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind   |                     |                  |                             |           | 102.373.157                     | 92,43                        |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden              |                     |                  |                             |           | 3.939.465                       | 3,56                         |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente   |                     |                  |                             |           | (1.090.528)                     | (0,98)                       |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  |                     |                  |                             |           | <b>105.222.094</b>              | <b>95,01</b>                 |

## Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                    | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|---------|-----------------------|-----------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 47,08 % (31. Dezember 2023: 45,11 %)</b> |  |         |                       |                 |                              |
| <b>Euro</b>  |  |         |                       |                 |                              |
| 200.000  | 888 Acquisitions Ltd**                   | 7,56 %  | 15.07.2027            | 196.183         | 0,28                         |
| 100.000  | Abertis Infraestructuras Finance BV*     | 4,87 %  | 31.12.2149            | 102.568         | 0,15                         |
| 300.000  | AccorInvest Group SA*                    | 5,50 %  | 15.11.2031            | 307.311         | 0,44                         |
| 100.000  | Achmea Bank NV*                          | 2,75 %  | 10.12.2027            | 99.839          | 0,14                         |
| 279.000  | Alexandrite Monnet UK Holdco Plc*        | 10,50 % | 15.05.2029            | 306.383         | 0,44                         |
| 200.000  | Almaviva-The Italian Innovation Co SpA*  | 5,00 %  | 30.10.2030            | 203.750         | 0,29                         |
| 100.000  | AMCO - Asset Management Co SpA*          | 0,75 %  | 20.04.2028            | 92.979          | 0,13                         |
| 110.000  | AMCO - Asset Management Co SpA*          | 4,63 %  | 06.02.2027            | 114.166         | 0,16                         |
| 200.000  | ArcelorMittal SA*                        | 3,50 %  | 13.12.2031            | 196.875         | 0,28                         |
| 100.000  | Arkema SA*                               | 3,50 %  | 12.09.2034            | 99.148          | 0,14                         |
| 200.000  | Aroundtown SA*                           | 0,38 %  | 15.04.2027            | 186.674         | 0,27                         |
| 200.000  | ASK Chemicals Deutschland Holding GmbH** | 10,00 % | 15.11.2029            | 197.430         | 0,28                         |
| 400.000  | ASR Nederland NV*                        | 6,63 %  | 31.12.2149            | 420.280         | 0,60                         |
| 400.000  | Athene Global Funding*                   | 0,83 %  | 08.01.2027            | 383.916         | 0,55                         |
| 500.000  | Banco BPM SpA*                           | 3,38 %  | 24.01.2030            | 509.879         | 0,72                         |
| 300.000  | Banco BPM SpA*                           | 3,88 %  | 09.09.2030            | 304.527         | 0,43                         |
| 300.000  | Banco BPM SpA*                           | 4,50 %  | 26.11.2036            | 303.029         | 0,43                         |
| 200.000  | Banco de Credito Social Cooperativo SA*  | 4,13 %  | 03.09.2030            | 205.599         | 0,29                         |
| 100.000  | Bank of New Zealand*                     | 2,55 %  | 29.06.2027            | 99.815          | 0,14                         |
| 90.000   | Banque Federative du Credit Mutuel SA*   | 2,88 %  | 31.12.2149            | 89.793          | 0,13                         |
| 100.000  | Barclays Plc*                            | 3,94 %  | 31.01.2036            | 100.393         | 0,14                         |
| 179.000  | BCP V Modular Services Finance II Plc**  | 4,75 %  | 30.11.2028            | 176.212         | 0,25                         |
| 400.000  | Becton Dickinson Euro Finance Sarl*      | 4,03 %  | 07.06.2036            | 413.022         | 0,59                         |
| 100.000  | BNP Paribas Fortis SA*                   | 3,75 %  | 30.10.2028            | 104.160         | 0,15                         |
| 350.000  | BNP Paribas Home Loan SFH SA*            | 2,52 %  | 29.10.2027            | 350.811         | 0,50                         |
| 100.000  | BNP Paribas SA*                          | 0,50 %  | 04.06.2026            | 98.971          | 0,14                         |
| 200.000  | Booking Holdings Inc*                    | 3,88 %  | 21.03.2045            | 199.178         | 0,28                         |
| 600.000  | BPCE SA*                                 | 4,13 %  | 08.03.2033            | 614.561         | 0,87                         |
| 400.000  | BPCE SFH SA*                             | 3,13 %  | 24.01.2028            | 406.436         | 0,58                         |
| 1.800.000  | Caisse de Refinancement de l'Habitat SA* | 3,13 %  | 23.02.2033            | 1.815.785       | 2,58                         |
| 100.000  | Canadian Imperial Bank of Commerce*      | 3,25 %  | 31.03.2027            | 101.513         | 0,14                         |
| 150.000  | CECONOMY AG*                             | 6,25 %  | 15.07.2029            | 155.424         | 0,22                         |
| 1.000.000  | Cie de Financement Foncier SA*           | 3,00 %  | 10.03.2033            | 1.001.009       | 1,42                         |
| 100.000  | Citycon Treasury BV*                     | 5,00 %  | 11.03.2030            | 100.703         | 0,14                         |
| 100.000  | Citycon Treasury BV*                     | 6,50 %  | 08.03.2029            | 106.309         | 0,15                         |
| 200.000  | Comcast Corp*                            | 3,55 %  | 26.09.2036            | 200.815         | 0,29                         |
| 100.000  | Commonwealth Bank of Australia*          | 0,75 %  | 28.02.2028            | 94.420          | 0,13                         |

## Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|-----------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 47,08 % (31. Dezember 2023: 45,11 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                 |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |   |         |                       |                 |                              |
| 100.000  | Commonwealth Bank of Australia <sup>*</sup>             | 3,25 %  | 24.10.2025            | 100.608         | 0,14                         |
| 200.000  | CPI Property Group SA <sup>*</sup>                      | 1,50 %  | 27.01.2031            | 159.250         | 0,23                         |
| 400.000  | CPI Property Group SA <sup>*</sup>                      | 4,88 %  | 31.12.2149            | 384.500         | 0,55                         |
| 100.000  | Credit Agricole Home Loan SFH SA <sup>*</sup>           | 2,88 %  | 12.01.2034            | 99.064          | 0,14                         |
| 200.000  | Credit Agricole Home Loan SFH SA <sup>*</sup>           | 3,00 %  | 11.12.2032            | 200.819         | 0,29                         |
| 400.000  | Crelan SA <sup>*</sup>                                  | 5,38 %  | 30.04.2035            | 420.294         | 0,60                         |
| 300.000  | Crelan SA <sup>*</sup>                                  | 6,00 %  | 28.02.2030            | 330.161         | 0,47                         |
| 400.000  | Cullinan Holdco Scsp <sup>**</sup>                      | 4,63 %  | 15.10.2026            | 376.850         | 0,54                         |
| 100.000  | Danske Bank A/S <sup>*</sup>                            | 1,38 %  | 12.02.2030            | 99.760          | 0,14                         |
| 300.000  | Electricite de France SA <sup>*</sup>                   | 4,75 %  | 17.06.2044            | 315.041         | 0,45                         |
| 200.000  | EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG <sup>*</sup>         | 1,88 %  | 29.06.2080            | 195.456         | 0,28                         |
| 100.000  | Engineering - Ingegneria Informatica - SpA <sup>*</sup> | 11,13 % | 15.05.2028            | 105.688         | 0,15                         |
| 300.000  | Eroski S Coop <sup>*</sup>                              | 10,63 % | 30.04.2029            | 327.193         | 0,46                         |
| 200.000  | Fiber Bidco SpA <sup>*</sup>                            | 6,68 %  | 15.01.2030            | 201.941         | 0,29                         |
| 200.000  | Forvia SE <sup>*</sup>                                  | 5,50 %  | 15.06.2031            | 199.887         | 0,28                         |
| 200.000  | Fressnapf Holding SE <sup>**</sup>                      | 5,25 %  | 31.10.2031            | 206.531         | 0,29                         |
| 380.000  | Grifols SA <sup>*</sup>                                 | 2,25 %  | 15.11.2027            | 363.654         | 0,52                         |
| 200.000  | Gruenthal GmbH <sup>**</sup>                            | 4,63 %  | 15.11.2031            | 202.591         | 0,29                         |
| 279.000  | Grupo Antolin-Irausa SA <sup>*</sup>                    | 3,50 %  | 30.04.2028            | 207.388         | 0,29                         |
| 500.000  | Heimstaden Bostad AB <sup>*</sup>                       | 3,38 %  | 31.12.2149            | 486.706         | 0,69                         |
| 279.000  | Iceland Bondco Plc <sup>**</sup>                        | 8,52 %  | 15.12.2027            | 282.854         | 0,40                         |
| 300.000  | Islandsbanki HF <sup>*</sup>                            | 4,63 %  | 27.03.2028            | 310.752         | 0,44                         |
| 209.000  | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau <sup>*</sup>            | 0,00 %  | 15.09.2031            | 177.171         | 0,25                         |
| 1.217.000  | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau <sup>*</sup>            | 1,25 %  | 30.06.2027            | 1.187.641       | 1,69                         |
| 340.000  | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau <sup>*</sup>            | 2,50 %  | 15.10.2031            | 340.130         | 0,48                         |
| 361.000  | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau <sup>*</sup>            | 2,75 %  | 15.03.2028            | 366.041         | 0,52                         |
| 1.560.000  | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau <sup>*</sup>            | 2,88 %  | 28.12.2029            | 1.590.396       | 2,26                         |
| 200.000  | Landsbankinn HF <sup>*</sup>                            | 3,75 %  | 08.10.2029            | 200.109         | 0,28                         |
| 300.000  | Landsbankinn HF <sup>*</sup>                            | 5,00 %  | 13.05.2028            | 314.853         | 0,45                         |
| 100.000  | Leasys SpA <sup>*</sup>                                 | 3,38 %  | 25.01.2029            | 99.851          | 0,14                         |
| 200.000  | Linde Plc <sup>*</sup>                                  | 3,50 %  | 04.06.2034            | 204.336         | 0,29                         |
| 200.000  | Luminor Bank AS <sup>*</sup>                            | 5,40 %  | 14.10.2035            | 203.650         | 0,29                         |
| 279.000  | Maxeda DIY Holding BV <sup>**</sup>                     | 5,88 %  | 01.10.2026            | 207.994         | 0,30                         |
| 400.000  | Medtronic Inc <sup>*</sup>                              | 4,15 %  | 15.10.2053            | 417.932         | 0,59                         |
| 300.000  | Mobico Group Plc <sup>*</sup>                           | 4,88 %  | 26.09.2031            | 301.510         | 0,43                         |
| 500.000  | Morgan Stanley <sup>*</sup>                             | 3,96 %  | 21.03.2035            | 512.348         | 0,73                         |
| 300.000  | MSD Netherlands Capital BV <sup>*</sup>                 | 3,75 %  | 30.05.2054            | 296.897         | 0,42                         |

## Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                      | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|--|--------|-----------------------|-----------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 47,08 % (31. Dezember 2023: 45,11 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                 |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |  |        |                       |                 |                              |
| 100.000  | National Australia Bank Ltd <sup>*</sup>                   | 2,35 % | 30.08.2029            | 98.243          | 0,14                         |
| 150.000  | National Australia Bank Ltd <sup>*</sup>                   | 3,15 % | 05.02.2031            | 152.788         | 0,22                         |
| 100.000  | NIBC Bank NV <sup>*</sup>                                  | 4,50 % | 12.06.2035            | 100.033         | 0,14                         |
| 200.000  | Nidda Healthcare Holding GmbH <sup>**</sup>                | 5,63 % | 21.02.2030            | 206.742         | 0,29                         |
| 400.000  | Norddeutsche Landesbank-Girozentrale <sup>*</sup>          | 5,63 % | 23.08.2034            | 414.796         | 0,59                         |
| 200.000  | OEG Finance Plc <sup>**</sup>                              | 7,25 % | 27.09.2029            | 209.532         | 0,30                         |
| 100.000  | Permanent TSB Group Holdings Plc <sup>*</sup>              | 3,00 % | 19.08.2031            | 99.044          | 0,14                         |
| 279.000  | Picard Groupe SAS <sup>**</sup>                            | 6,38 % | 01.07.2029            | 290.880         | 0,41                         |
| 279.000  | Pinnacle Bidco Plc <sup>*</sup>                            | 8,25 % | 11.10.2028            | 296.481         | 0,42                         |
| 100.000  | Project Grand UK Plc <sup>*</sup>                          | 9,00 % | 01.06.2029            | 105.390         | 0,15                         |
| 300.000  | Public Property Invest AS <sup>*</sup>                     | 4,63 % | 12.03.2030            | 300.361         | 0,43                         |
| 400.000  | PVH Corp <sup>*</sup>                                      | 4,13 % | 16.07.2029            | 411.688         | 0,59                         |
| 200.000  | Rakuten Group Inc <sup>*</sup>                             | 4,25 % | 31.12.2149            | 187.610         | 0,27                         |
| 100.000  | RCI Banque SA <sup>*</sup>                                 | 5,50 % | 09.10.2034            | 102.331         | 0,15                         |
| 279.000  | Rossini Sarl <sup>*</sup>                                  | 6,75 % | 31.12.2029            | 295.574         | 0,42                         |
| 200.000  | SCOR SE <sup>*</sup>                                       | 6,00 % | 31.12.2149            | 203.125         | 0,29                         |
| 400.000  | Sogecap SA <sup>*</sup>                                    | 6,50 % | 16.05.2044            | 447.135         | 0,64                         |
| 430.000  | Southern Co <sup>*</sup>                                   | 1,88 % | 15.09.2081            | 404.162         | 0,57                         |
| 400.000  | Southern Gas Networks Plc <sup>*</sup>                     | 3,50 % | 16.10.2030            | 398.893         | 0,57                         |
| 100.000  | Stellantis NV <sup>*</sup>                                 | 3,50 % | 19.09.2030            | 99.695          | 0,14                         |
| 300.000  | Stellantis NV <sup>*</sup>                                 | 4,00 % | 19.03.2034            | 298.380         | 0,42                         |
| 100.000  | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd <sup>*</sup>                | 4,09 % | 19.04.2028            | 103.753         | 0,15                         |
| 200.000  | TAG Immobilien AG <sup>*</sup>                             | 4,25 % | 04.03.2030            | 203.443         | 0,29                         |
| 200.000  | Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH <sup>**</sup>       | 5,38 % | 15.07.2029            | 207.363         | 0,29                         |
| 300.000  | TenneT Holding BV <sup>*</sup>                             | 0,88 % | 16.06.2035            | 241.654         | 0,34                         |
| 400.000  | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV <sup>*</sup> | 4,38 % | 09.05.2030            | 410.440         | 0,58                         |
| 400.000  | Timken Co <sup>*</sup>                                     | 4,13 % | 23.05.2034            | 401.421         | 0,57                         |
| 775.000  | Toronto-Dominion Bank <sup>*</sup>                         | 2,86 % | 15.04.2031            | 777.351         | 1,10                         |
| 379.000  | Toronto-Dominion Bank <sup>*</sup>                         | 3,36 % | 16.02.2027            | 379.017         | 0,54                         |
| 200.000  | Transportes Aereos Portugueses SA <sup>*</sup>             | 5,13 % | 15.11.2029            | 205.267         | 0,29                         |
| 100.000  | TUI Cruises GmbH <sup>**</sup>                             | 5,00 % | 15.05.2030            | 101.623         | 0,14                         |
| 650.000  | UBS Group AG <sup>*</sup>                                  | 2,13 % | 13.10.2026            | 646.010         | 0,92                         |
| 100.000  | UniCredit Bank Austria AG <sup>*</sup>                     | 2,88 % | 10.11.2028            | 100.718         | 0,14                         |
| 400.000  | Verizon Communications Inc <sup>*</sup>                    | 3,75 % | 28.02.2036            | 406.144         | 0,58                         |
| 400.000  | Virgin Money UK Plc <sup>*</sup>                           | 4,00 % | 18.03.2028            | 408.187         | 0,58                         |
| 100.000  | Volkswagen Financial Services AG <sup>*</sup>              | 3,88 % | 19.11.2031            | 100.034         | 0,14                         |
| 400.000  | Warnermedia Holdings Inc <sup>*</sup>                      | 4,69 % | 17.05.2033            | 402.374         | 0,57                         |

## Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                     | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR   | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|---|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 47,08 % (31. Dezember 2023: 45,11 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                   |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |   |        |                       |                   |                              |
| 379.000  | Westpac Banking Corp*                     | 0,38 % | 02.04.2026            | 369.249           | 0,52                         |
| 100.000  | Ziggo Bond Co BV**                        | 6,13 % | 15.11.2032            | 100.750           | 0,14                         |
| <b>Total Corporate Bonds</b>   |   |        |                       | <b>33.145.394</b> | <b>47,08</b>                 |
| <b>Staatsanleihen 49,15 % (31. Dezember 2023: 51,07 %)</b>                     |   |        |                       |                   |                              |
| <b>Euro</b>  |   |        |                       |                   |                              |
| 100.000  | Acquirente Unico SpA*                     | 2,80 % | 20.02.2026            | 99.806            | 0,14                         |
| 400.000  | Adif Alta Velocidad*                      | 3,25 % | 31.05.2029            | 404.713           | 0,58                         |
| 175.000  | Autonomous Community of Madrid Spain*     | 2,08 % | 12.03.2030            | 169.378           | 0,24                         |
| 50.000   | Autonomous Community of Madrid Spain*     | 3,46 % | 30.04.2034            | 51.262            | 0,07                         |
| 400.000  | Bank Gospodarstwa Krajowego*              | 3,88 % | 13.03.2035            | 398.942           | 0,57                         |
| 100.000  | Bank Gospodarstwa Krajowego*              | 4,00 % | 08.09.2027            | 102.830           | 0,15                         |
| 379.000  | Bank Gospodarstwa Krajowego*              | 4,38 % | 13.03.2039            | 384.731           | 0,55                         |
| 1.000.000  | Bpifrance SACA*                           | 2,88 % | 25.11.2029            | 1.001.934         | 1,42                         |
| 400.000  | Bpifrance SACA*                           | 3,38 % | 25.05.2034            | 402.514           | 0,57                         |
| 154.000  | Bulgaria Government International Bond*   | 3,63 % | 05.09.2032            | 157.761           | 0,22                         |
| 189.000  | Bulgaria Government International Bond*   | 4,13 % | 23.09.2029            | 198.608           | 0,28                         |
| 252.000  | Bulgaria Government International Bond*   | 4,38 % | 13.05.2031            | 269.782           | 0,38                         |
| 239.000  | Bulgaria Government International Bond*   | 4,88 % | 13.05.2036            | 262.845           | 0,37                         |
| 348.378  | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe* | 1,25 % | 15.08.2048            | 268.243           | 0,38                         |
| 700.000  | Cassa Depositi e Prestiti SpA*            | 3,88 % | 12.07.2031            | 722.987           | 1,03                         |
| 310.000  | Denmark Government International Bond*    | 2,25 % | 02.10.2026            | 309.955           | 0,44                         |
| 78.000   | European Financial Stability Facility*    | 2,88 % | 16.02.2033            | 79.094            | 0,11                         |
| 339.566  | European Stability Mechanism*             | 1,00 % | 23.06.2027            | 328.928           | 0,47                         |
| 510.000  | European Stability Mechanism*             | 2,38 % | 30.09.2027            | 510.973           | 0,73                         |
| 3.163.984  | European Stability Mechanism*             | 2,63 % | 18.09.2029            | 3.186.377         | 4,53                         |
| 173.558  | European Union*                           | 2,00 % | 04.10.2027            | 172.308           | 0,25                         |
| 451.000  | European Union*                           | 2,50 % | 04.12.2031            | 446.632           | 0,63                         |
| 222.602  | European Union*                           | 3,00 % | 04.12.2034            | 224.465           | 0,32                         |
| 2.661.698  | European Union*                           | 3,13 % | 04.12.2030            | 2.740.430         | 3,89                         |
| 2.118.346  | European Union*                           | 3,25 % | 04.07.2034            | 2.184.661         | 3,10                         |
| 86.779   | European Union*                           | 3,25 % | 04.02.2050            | 85.796            | 0,12                         |
| 373.523  | European Union*                           | 3,38 % | 04.10.2038            | 383.554           | 0,55                         |
| 147.145  | European Union*                           | 4,00 % | 04.04.2044            | 160.930           | 0,23                         |
| 264.182  | French Republic Government Bond OAT*      | 0,50 % | 25.05.2072            | 90.715            | 0,13                         |
| 183.093  | French Republic Government Bond OAT*      | 0,75 % | 25.05.2052            | 93.299            | 0,13                         |
| 40.000   | French Republic Government Bond OAT*      | 1,25 % | 25.05.2034            | 33.913            | 0,05                         |

## Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                             | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|---|--------|-----------------------|-----------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 49,15 % (31. Dezember 2023: 51,07 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                 |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |   |        |                       |                 |                              |
| 2.439.312  | French Republic Government Bond OAT*              | 1,50 % | 25.05.2050            | 1.591.024       | 2,26                         |
| 42.146   | French Republic Government Bond OAT*              | 1,75 % | 25.05.2066            | 25.617          | 0,04                         |
| 447.000  | Hellenic Republic Government Bond*                | 3,38 % | 15.06.2034            | 452.298         | 0,64                         |
| 152.000  | Hellenic Republic Government Bond*                | 4,13 % | 15.06.2054            | 158.062         | 0,23                         |
| 546.000  | Hellenic Republic Government Bond*                | 4,38 % | 18.07.2038            | 593.958         | 0,84                         |
| 55.000   | Instituto de Credito Oficial*                     | 3,80 % | 31.05.2029            | 57.626          | 0,08                         |
| 82.966   | Ireland Government Bond*                          | 0,55 % | 22.04.2041            | 58.346          | 0,08                         |
| 57.714   | Ireland Government Bond*                          | 3,00 % | 18.10.2043            | 59.012          | 0,08                         |
| 322.000  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**               | 1,20 % | 15.08.2025            | 319.685         | 0,45                         |
| 299.206  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**               | 1,40 % | 26.05.2025            | 298.701         | 0,42                         |
| 414.000  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*                | 1,45 % | 01.03.2036            | 334.682         | 0,48                         |
| 240.139  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**               | 1,60 % | 22.11.2028            | 238.432         | 0,34                         |
| 380.000  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*                | 1,85 % | 01.07.2025            | 379.018         | 0,54                         |
| 222.710  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*                | 2,00 % | 14.03.2028            | 223.798         | 0,32                         |
| 1.200.000  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**               | 2,50 % | 01.12.2032            | 1.140.361       | 1,62                         |
| 471.000  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*                | 3,00 % | 01.08.2029            | 476.501         | 0,68                         |
| 540.000  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*                | 3,40 % | 28.03.2025            | 540.913         | 0,77                         |
| 667.000  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**               | 3,45 % | 15.07.2027            | 682.848         | 0,97                         |
| 275.000  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**               | 3,85 % | 01.02.2035            | 283.303         | 0,40                         |
| 357.000  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**               | 4,05 % | 30.10.2037            | 371.810         | 0,53                         |
| 207.000  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**               | 4,15 % | 01.10.2039            | 214.535         | 0,31                         |
| 238.000  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**               | 4,30 % | 01.10.2054            | 243.795         | 0,35                         |
| 316.449  | Kingdom of Belgium Government Bond*               | 0,35 % | 22.06.2032            | 265.106         | 0,38                         |
| 186.276  | Kingdom of Belgium Government Bond*               | 0,40 % | 22.06.2040            | 121.772         | 0,17                         |
| 293.847  | Kingdom of Belgium Government Bond*               | 1,45 % | 22.06.2037            | 243.285         | 0,35                         |
| 166.322  | Kingdom of Belgium Government Bond*               | 3,00 % | 22.06.2033            | 168.013         | 0,24                         |
| 450.000  | Latvia Government International Bond*             | 0,25 % | 23.01.2030            | 393.505         | 0,56                         |
| 380.000  | Lithuania Government International Bond*          | 3,50 % | 13.02.2034            | 388.791         | 0,55                         |
| 438.484  | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT*                | 1,65 % | 16.07.2032            | 411.307         | 0,58                         |
| 88.830   | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT*                | 1,95 % | 15.06.2029            | 87.752          | 0,13                         |
| 209.000  | Republic of Austria Government Bond*              | 0,90 % | 20.02.2032            | 185.691         | 0,26                         |
| 518.000  | Republic of Poland Government International Bond* | 3,13 % | 22.10.2031            | 521.481         | 0,74                         |
| 412.000  | Republic of Poland Government International Bond* | 3,88 % | 22.10.2039            | 415.083         | 0,59                         |
| 197.000  | Romanian Government International Bond**          | 2,88 % | 26.05.2028            | 189.113         | 0,27                         |
| 258.000  | Romanian Government International Bond*           | 5,25 % | 30.05.2032            | 252.295         | 0,36                         |
| 285.000  | Romanian Government International Bond*           | 6,38 % | 18.09.2033            | 297.457         | 0,42                         |
| 329.000  | Romanian Government International Bond*           | 6,63 % | 27.09.2029            | 355.011         | 0,50                         |

-  
-  
-

## Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                    | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR   | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|--|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 49,15 % (31. Dezember 2023: 51,07 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                   |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |  |        |                       |                   |                              |
| 1.800.000  | SFIL SA*                                 | 3,13 % | 17.09.2029            | 1.820.306         | 2,59                         |
| 240.000  | Slovakia Government Bond*                | 3,00 % | 06.11.2031            | 240.667           | 0,34                         |
| 928.242  | Slovakia Government Bond*                | 3,75 % | 06.03.2034            | 956.337           | 1,36                         |
| 447.740  | Slovakia Government Bond*                | 3,75 % | 23.02.2035            | 460.343           | 0,65                         |
| 264.000  | Slovenia Government Bond*                | 3,00 % | 10.03.2034            | 263.601           | 0,37                         |
| 146.000  | Spain Government Bond*                   | 0,50 % | 31.10.2031            | 126.167           | 0,18                         |
| 445.000  | Spain Government Bond*                   | 1,25 % | 31.10.2030            | 411.893           | 0,59                         |
| 71.000   | Spain Government Bond*                   | 2,90 % | 31.10.2046            | 64.403            | 0,09                         |
| 190.000  | Spain Government Bond*                   | 3,15 % | 30.04.2033            | 193.482           | 0,27                         |
| 71.000   | Spain Government Bond*                   | 3,25 % | 30.04.2034            | 72.323            | 0,10                         |
| 435.000  | Spain Government Bond*                   | 3,55 % | 31.10.2033            | 454.656           | 0,65                         |
| 41.000   | Spain Government Bond*                   | 4,00 % | 31.10.2054            | 43.229            | 0,06                         |
| 123.000  | Spain Government Bond*                   | 4,20 % | 31.01.2037            | 135.219           | 0,19                         |
| 458.000  | State of North Rhine-Westphalia Germany* | 0,13 % | 04.06.2031            | 392.266           | 0,55                         |
| <b>Staatsanleihen insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>34.603.245</b> | <b>49,15</b>                 |
| <b>Anlagen insgesamt</b>   |  |        |                       | <b>67.748.639</b> | <b>96,23</b>                 |

Futures-Kontrakte 0,20 % (31. Dezember 2023: 0,31 %)

| Anzahl<br>Kontrakte   | Beschreibung                | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn EUR | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-----------------------------|-------------------------------------|------------------------------|
| (47)  | Euro-Bund Future March 2025 | 141.000                             | 0,20                         |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten *</b> |                             | <b>141.000</b>                      | <b>0,20</b>                  |

Zinsswap-Kontrakte 0,00 % (31. Dezember 2023: 0,07 %)

| Nominalwert  | Fälligkeit | Gegenpartei                   | Erhalt/(Zahlung)# | Fester<br>Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn EUR | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|------------|-------------------------------|-------------------|--------------------|--------------------|-------------------------------------|------------------------------|
| EUR 565.000  | 25.10.2029 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)         | 2,12 %             | 1D ESTR            | 1.698                               | 0,00                         |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Zinsswapkontrakten **</b> |            |                               |                   |                    |                    | <b>1.698</b>                        | <b>0,00</b>                  |

#Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

|  |  |  |  | Zeitwert<br>EUR   | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|--|--|--|-------------------|------------------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |  |  |  | <b>67.891.337</b> | <b>96,43</b>                 |

## Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Futures-Kontrakte (0,32 %) (31. Dezember 2023: (0,18 %))

| Anzahl Kontrakte  | Beschreibung                             | Nicht realisierter Verlust EUR | % des Nettovermögens |
|---|--|--------------------------------|----------------------|
| 30  | Euro-BOBL Future March 2025              | (26.350)                       | (0,04)               |
| 20  | Euro-BTP Future March 2025               | (52.120)                       | (0,07)               |
| 10  | Euro-Buxl 30-Year Bond Future March 2025 | (79.000)                       | (0,11)               |
| 12  | Euro-OAT Future March 2025               | (30.240)                       | (0,04)               |
| 138   | Euro-Schatz Future March 2025            | (39.160)                       | (0,06)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten <sup>‡</sup></b> |  | <b>(226.870)</b>               | <b>(0,32)</b>        |

### Zinsswap-Kontrakte (0,01 %) (31. Dezember 2023: (0,04 %))

| Nominalwert   | Fälligkeit | Gegenpartei                   | Erhalt/(Zahlung) <sup>#</sup> | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Verlust EUR | % des Nettovermögens |
|---|------------|-------------------------------|-------------------------------|-----------------|--------------------|--------------------------------|----------------------|
| EUR 801.196   | 30.08.2032 | LCH Clearmet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 2,22 %          | 6M EURIBOR         | (6.230)                        | (0,01)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Zinsswapkontrakten <sup>∞</sup></b> |            |                               |                               |                 |                    | <b>(6.230)</b>                 | <b>(0,01)</b>        |

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

### Credit-Default-Swap-Kontrakte (0,34 %) (31. Dezember 2023: (0,52 %))

| Nominalwert   | Fälligkeit | Gegenpartei                 | Referenzverbindlichkeit                                     | Zeitwert EUR     | % des Nettovermögens |
|---|------------|-----------------------------|---|------------------|----------------------|
| EUR 3.050.000   | 20.12.2029 | ICE Clear U.S. <sup>1</sup> | Buying default protection on iTRAXX Europe Crossover S42.V1 | (239.328)        | (0,34)               |
| <b>Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt <sup>‡</sup></b> |            |                             |   | <b>(239.328)</b> | <b>(0,34)</b>        |

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

|   | Zeitwert EUR      | % des Nettovermögens |
|---|-------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(472.428)</b>  | <b>(0,67)</b>        |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>67.418.909</b> | <b>95,76</b>         |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>2.981.623</b>  | <b>4,24</b>          |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>70.400.532</b> | <b>100,00</b>        |

| Portfolioanalyse  | Zeitwert EUR      | % des Gesamtvermögens |
|---|-------------------|-----------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 60.802.521        | 85,64                 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden            | 6.946.118         | 9,78                  |
| ± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden                          | (85.870)          | (0,12)                |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap                            | (243.860)         | (0,34)                |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>67.418.909</b> | <b>94,96</b>          |

## Euro Bond Absolute Return - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag  | Wertpapierbezeichnung  | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 4,51 % (31. Dezember 2023: 0,46 %)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>Euro</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 100.000   | Auto ABS Italian Stella Loans S.r.l. Series 2024-1 Class B                             | 4,06 %  | 29.12.2036            | 100.404          | 0,11                         |
| 164.483   | Auto1 Car Funding Sarl Series 2024-1 Class A   | 3,55 %  | 15.12.2033            | 164.694          | 0,19                         |
| 96.361  | Bbva Consumer Auto FT Series 2024-1 Class B  | 3,97 %  | 19.03.2038            | 96.507           | 0,11                         |
| 244.112   | Brignole Co Series 2024 Class C  | 4,80 %  | 24.02.2042            | 246.229          | 0,28                         |
| 186.171   | Brignole CQ Series 2024 Class B  | 4,33 %  | 24.09.2040            | 186.874          | 0,21                         |
| 200.000   | Golden Bar Securitisation S.r.l. Series 2024-1 Class C                                 | 4,99 %  | 22.09.2043            | 201.452          | 0,23                         |
| 376.000   | Jeronimo Funding DAC Series 1 Class C  | 5,21 %  | 25.10.2064            | 368.213          | 0,42                         |
| 530.000   | Kinbane DAC Series 2024-RPL2X Class B  | 4,40 %  | 24.01.2063            | 531.925          | 0,60                         |
| 100.000   | Noria DE Series 2024-DE1 Class B   | 3,80 %  | 25.02.2043            | 99.916           | 0,11                         |
| 100.000   | Pepper Iberia Consumer Series 2024-1 Class B   | 4,15 %  | 25.04.2037            | 100.174          | 0,11                         |
| 100.000   | Quarzo S.r.l. Series 2024-1 Class C  | 5,19 %  | 15.06.2041            | 101.099          | 0,11                         |
| 100.000   | Red & Black Auto Germany UG Series 11 Class B  | 4,05 %  | 15.09.2033            | 100.315          | 0,11                         |
| 400.000   | Shamrock Residential DAC Series 2024-1X Class B  | 4,49 %  | 24.12.2078            | 401.567          | 0,45                         |
| 600.000   | Tagus - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Vasco Finance No. 2 Series 2 Class A | 4,03 %  | 27.10.2042            | 600.523          | 0,68                         |
| 200.000   | Tagus - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Vasco Finance No. 2 Series 2 Class B | 4,65 %  | 27.10.2042            | 200.273          | 0,23                         |
| 500.000   | Thunder Logistics DAC Series 2024-1X Class A   | 4,21 %  | 17.11.2036            | 496.482          | 0,56                         |
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) insgesamt **</b>                       |  |         |                       | <b>3.996.647</b> | <b>4,51</b>                  |
| <b>Unternehmensanleihen 46,56 % (31. Dezember 2023: 54,54 %)</b>                          |  |         |                       |                  |                              |
| <b>Dänische Krone</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 500.000   | Jyske Realkredit A/S*  | 4,00 %  | 01.10.2056            | 66.598           | 0,08                         |
| 3.200.000   | Nykredit Realkredit AS*  | 3,50 %  | 01.10.2053            | 420.038          | 0,47                         |
| 4.088.934   | Nykredit Realkredit AS*  | 4,00 %  | 01.10.2053            | 551.604          | 0,62                         |
| 343.000   | Nykredit Realkredit AS*  | 4,00 %  | 01.10.2056            | 45.912           | 0,05                         |
| 25.188.649  | Nykredit Realkredit AS Series REGS*  | 4,00 %  | 01.10.2056            | 3.388.856        | 3,83                         |
| <b>Dänische Krone insgesamt</b>   |  |         |                       | <b>4.473.008</b> | <b>5,05</b>                  |
| <b>Euro</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 200.000   | 888 Acquisitions Ltd**   | 7,56 %  | 15.07.2027            | 196.183          | 0,22                         |
| 100.000   | Abertis Infraestructuras Finance BV*   | 4,87 %  | 31.12.2149            | 102.568          | 0,12                         |
| 400.000   | AccorInvest Group SA*  | 5,50 %  | 15.11.2031            | 409.748          | 0,46                         |
| 100.000   | Achmea Bank NV*  | 2,75 %  | 10.12.2027            | 99.839           | 0,11                         |
| 200.000   | Alexandrite Monnet UK Holdco Plc*  | 10,50 % | 15.05.2029            | 219.630          | 0,25                         |
| 300.000   | Almaviva-The Italian Innovation Co SpA*  | 5,00 %  | 30.10.2030            | 305.625          | 0,35                         |
| 250.000   | AMCO - Asset Management Co SpA*  | 0,75 %  | 20.04.2028            | 232.447          | 0,26                         |
| 150.000   | AMCO - Asset Management Co SpA*  | 4,63 %  | 06.02.2027            | 155.681          | 0,18                         |
| 100.000   | ANZ New Zealand Int'l Ltd*   | 3,95 %  | 17.07.2026            | 102.325          | 0,12                         |
| 200.000   | ArcelorMittal SA*  | 3,50 %  | 13.12.2031            | 196.875          | 0,22                         |
| 200.000   | Arkema SA*   | 1,50 %  | 31.12.2149            | 194.699          | 0,22                         |

## Euro Bond Absolute Return - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                    | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|--|---------|-----------------------|-----------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 46,56 % (31. Dezember 2023: 54,54 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                 |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |  |         |                       |                 |                              |
| 100.000  | Arkema SA*                               | 3,50 %  | 12.09.2034            | 99.148          | 0,11                         |
| 300.000  | Aroundtown Finance Sarl*                 | 7,13 %  | 31.12.2149            | 294.805         | 0,33                         |
| 300.000  | Aroundtown SA*                           | 0,38 %  | 15.04.2027            | 280.010         | 0,32                         |
| 200.000  | Aroundtown SA*                           | 1,45 %  | 09.07.2028            | 185.617         | 0,21                         |
| 300.000  | ASK Chemicals Deutschland Holding GmbH** | 10,00 % | 15.11.2029            | 296.145         | 0,33                         |
| 300.000  | ASR Nederland NV*                        | 6,63 %  | 31.12.2149            | 315.210         | 0,36                         |
| 300.000  | Athene Global Funding*                   | 0,83 %  | 08.01.2027            | 287.937         | 0,33                         |
| 200.000  | Balder Finland OYJ*                      | 2,00 %  | 18.01.2031            | 179.342         | 0,20                         |
| 760.000  | Banco BPM SpA*                           | 3,38 %  | 24.01.2030            | 775.017         | 0,88                         |
| 300.000  | Banco BPM SpA*                           | 3,88 %  | 09.09.2030            | 304.527         | 0,34                         |
| 300.000  | Banco BPM SpA*                           | 4,50 %  | 26.11.2036            | 303.029         | 0,34                         |
| 100.000  | Banco BPM SpA**                          | 5,00 %  | 18.06.2034            | 103.593         | 0,12                         |
| 200.000  | Banco de Credito Social Cooperativo SA*  | 4,13 %  | 03.09.2030            | 205.599         | 0,23                         |
| 400.000  | Bank of New Zealand*                     | 2,55 %  | 29.06.2027            | 399.261         | 0,45                         |
| 200.000  | Banque Federative du Credit Mutuel SA*   | 2,88 %  | 31.12.2149            | 199.540         | 0,23                         |
| 100.000  | Barclays Plc*                            | 3,94 %  | 31.01.2036            | 100.393         | 0,11                         |
| 100.000  | Bayerische Landesbank*                   | 7,00 %  | 05.01.2034            | 110.502         | 0,13                         |
| 400.000  | BNP Paribas Home Loan SFH SA*            | 2,52 %  | 29.10.2027            | 400.927         | 0,45                         |
| 300.000  | Booking Holdings Inc*                    | 3,88 %  | 21.03.2045            | 298.767         | 0,34                         |
| 100.000  | BPCE SFH SA*                             | 3,13 %  | 24.01.2028            | 101.609         | 0,11                         |
| 100.000  | Caisse de Refinancement de l'Habitat SA* | 3,00 %  | 11.01.2030            | 100.996         | 0,11                         |
| 500.000  | Canadian Imperial Bank of Commerce*      | 3,25 %  | 31.03.2027            | 507.564         | 0,57                         |
| 150.000  | CECONOMY AG*                             | 6,25 %  | 15.07.2029            | 155.424         | 0,18                         |
| 700.000  | Cie de Financement Foncier SA*           | 3,00 %  | 10.03.2033            | 700.706         | 0,79                         |
| 100.000  | Citycon Treasury BV*                     | 5,00 %  | 11.03.2030            | 100.703         | 0,11                         |
| 200.000  | Citycon Treasury BV*                     | 6,50 %  | 08.03.2029            | 212.617         | 0,24                         |
| 200.000  | Comcast Corp*                            | 3,55 %  | 26.09.2036            | 200.815         | 0,23                         |
| 300.000  | Commonwealth Bank of Australia*          | 0,75 %  | 28.02.2028            | 283.261         | 0,32                         |
| 200.000  | CPI Property Group SA*                   | 1,50 %  | 27.01.2031            | 159.250         | 0,18                         |
| 400.000  | CPI Property Group SA*                   | 4,88 %  | 31.12.2149            | 384.500         | 0,43                         |
| 300.000  | CPI Property Group SA*                   | 6,00 %  | 27.01.2032            | 301.979         | 0,34                         |
| 100.000  | Credit Mutuel Home Loan SFH SA*          | 2,75 %  | 08.12.2027            | 100.356         | 0,11                         |
| 400.000  | Crelan SA*                               | 5,38 %  | 30.04.2035            | 420.294         | 0,48                         |
| 200.000  | Crelan SA*                               | 6,00 %  | 28.02.2030            | 220.107         | 0,25                         |
| 300.000  | Cullinan Holdco Scsp**                   | 4,63 %  | 15.10.2026            | 282.638         | 0,32                         |
| 100.000  | Duomo Bidco SpA**                        | 7,30 %  | 15.07.2031            | 100.910         | 0,11                         |
| 200.000  | Electricite de France SA*                | 2,88 %  | 31.12.2149            | 195.722         | 0,22                         |
| 100.000  | EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG*      | 2,13 %  | 31.08.2081            | 85.421          | 0,10                         |
| 200.000  | Enel SpA*                                | 1,88 %  | 31.12.2149            | 175.412         | 0,20                         |

## Euro Bond Absolute Return - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                       | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|-----------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 46,56 % (31. Dezember 2023: 54,54 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                 |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |   |         |                       |                 |                              |
| 100.000  | Energia Group Roi Financeco DAC**           | 6,88 %  | 31.07.2028            | 104.947         | 0,12                         |
| 100.000  | Engineering - Ingegneria Informatica - SpA* | 11,13 % | 15.05.2028            | 105.688         | 0,12                         |
| 300.000  | Eroski S Coop*                              | 10,63 % | 30.04.2029            | 327.193         | 0,37                         |
| 608.000  | European Investment Bank*                   | 2,88 %  | 15.10.2031            | 621.226         | 0,70                         |
| 100.000  | Fiber Bidco SpA*                            | 6,68 %  | 15.01.2030            | 100.971         | 0,11                         |
| 200.000  | Forvia SE*                                  | 5,50 %  | 15.06.2031            | 199.887         | 0,23                         |
| 200.000  | Fressnapf Holding SE**                      | 5,25 %  | 31.10.2031            | 206.531         | 0,23                         |
| 100.000  | Goldstory SAS*                              | 7,06 %  | 01.02.2030            | 100.980         | 0,11                         |
| 166.000  | Grand City Properties Finance Sarl*         | 6,13 %  | 31.12.2149            | 164.635         | 0,19                         |
| 100.000  | Grand City Properties SA*                   | 1,50 %  | 31.12.2149            | 95.803          | 0,11                         |
| 300.000  | Grifols SA*                                 | 2,25 %  | 15.11.2027            | 287.095         | 0,32                         |
| 200.000  | Gruenthal GmbH**                            | 4,63 %  | 15.11.2031            | 202.591         | 0,23                         |
| 200.000  | Grupo Antolin-Irausa SA*                    | 3,50 %  | 30.04.2028            | 148.665         | 0,17                         |
| 600.000  | Heimstaden Bostad AB*                       | 3,38 %  | 31.12.2149            | 584.047         | 0,66                         |
| 400.000  | Iceland Bondco Plc**                        | 8,52 %  | 15.12.2027            | 405.526         | 0,46                         |
| 300.000  | Islandsbanki HF*                            | 4,63 %  | 27.03.2028            | 310.752         | 0,35                         |
| 100.000  | Italmatch Chemicals SpA*                    | 10,00 % | 06.02.2028            | 105.894         | 0,12                         |
| 879.000  | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau*            | 0,75 %  | 28.06.2028            | 833.177         | 0,94                         |
| 277.000  | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau*            | 2,50 %  | 15.10.2031            | 277.106         | 0,31                         |
| 1.325.000  | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau*            | 2,63 %  | 26.04.2029            | 1.337.111       | 1,51                         |
| 260.000  | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau*            | 2,75 %  | 15.03.2028            | 263.630         | 0,30                         |
| 450.000  | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau*            | 2,75 %  | 20.02.2031            | 456.320         | 0,52                         |
| 300.000  | Landsbankinn HF*                            | 3,75 %  | 08.10.2029            | 300.164         | 0,34                         |
| 300.000  | Landsbankinn HF*                            | 5,00 %  | 13.05.2028            | 314.853         | 0,36                         |
| 190.000  | Landsbankinn HF*                            | 6,38 %  | 12.03.2027            | 201.738         | 0,23                         |
| 100.000  | Leasys SpA*                                 | 3,38 %  | 25.01.2029            | 99.851          | 0,11                         |
| 200.000  | Luminor Bank AS*                            | 5,40 %  | 14.10.2035            | 203.650         | 0,23                         |
| 100.000  | Maxedo DIY Holding BV**                     | 5,88 %  | 01.10.2026            | 74.550          | 0,08                         |
| 281.000  | Medtronic Inc*                              | 4,15 %  | 15.10.2053            | 293.597         | 0,33                         |
| 300.000  | Mobico Group Plc*                           | 4,88 %  | 26.09.2031            | 301.510         | 0,34                         |
| 400.000  | Morgan Stanley*                             | 3,96 %  | 21.03.2035            | 409.878         | 0,46                         |
| 200.000  | Motability Operations Group Plc*            | 4,00 %  | 17.01.2030            | 207.282         | 0,23                         |
| 200.000  | MSD Netherlands Capital BV*                 | 3,75 %  | 30.05.2054            | 197.932         | 0,22                         |
| 400.000  | National Australia Bank Ltd*                | 2,35 %  | 30.08.2029            | 392.973         | 0,44                         |
| 100.000  | National Australia Bank Ltd*                | 3,15 %  | 05.02.2031            | 101.859         | 0,12                         |
| 200.000  | NIBC Bank NV*                               | 4,50 %  | 12.06.2035            | 200.066         | 0,23                         |
| 200.000  | Nidda Healthcare Holding GmbH**             | 5,63 %  | 21.02.2030            | 206.742         | 0,23                         |
| 500.000  | Norddeutsche Landesbank-Girozentrale*       | 5,63 %  | 23.08.2034            | 518.496         | 0,59                         |
| 200.000  | OEG Finance Plc**                           | 7,25 %  | 27.09.2029            | 209.532         | 0,24                         |
| 400.000  | Permanent TSB Group Holdings Plc*           | 3,00 %  | 19.08.2031            | 396.176         | 0,45                         |

## Euro Bond Absolute Return - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                          | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR   | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|--|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 46,56 % (31. Dezember 2023: 54,54 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                   |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |  |        |                       |                   |                              |
| 200.000  | Picard Groupe SAS**                            | 6,38 % | 01.07.2029            | 208.516           | 0,24                         |
| 200.000  | Project Grand UK Plc*                          | 9,00 % | 01.06.2029            | 210.780           | 0,24                         |
| 300.000  | Public Property Invest AS*                     | 4,63 % | 12.03.2030            | 300.361           | 0,34                         |
| 243.000  | PVH Corp*                                      | 4,13 % | 16.07.2029            | 250.100           | 0,28                         |
| 200.000  | Rakuten Group Inc*                             | 4,25 % | 31.12.2149            | 187.610           | 0,21                         |
| 100.000  | Rossini Sarl*                                  | 6,75 % | 31.12.2029            | 105.941           | 0,12                         |
| 300.000  | SCOR SE*                                       | 6,00 % | 31.12.2149            | 304.688           | 0,34                         |
| 200.000  | Sogecap SA*                                    | 6,50 % | 16.05.2044            | 223.567           | 0,25                         |
| 470.000  | Southern Co*                                   | 1,88 % | 15.09.2081            | 441.759           | 0,50                         |
| 300.000  | Southern Gas Networks Plc*                     | 3,50 % | 16.10.2030            | 299.170           | 0,34                         |
| 100.000  | Stellantis NV*                                 | 3,50 % | 19.09.2030            | 99.695            | 0,11                         |
| 400.000  | Stellantis NV*                                 | 4,00 % | 19.03.2034            | 397.840           | 0,45                         |
| 100.000  | Sumitomo Mitsui Banking Corp*                  | 3,60 % | 16.02.2026            | 100.897           | 0,11                         |
| 300.000  | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd*                | 4,09 % | 19.04.2028            | 311.258           | 0,35                         |
| 200.000  | Syensqo SA*                                    | 2,50 % | 31.12.2149            | 197.405           | 0,22                         |
| 100.000  | Synthomer Plc*                                 | 7,38 % | 02.05.2029            | 104.732           | 0,12                         |
| 200.000  | TAG Immobilien AG*                             | 4,25 % | 04.03.2030            | 203.443           | 0,23                         |
| 300.000  | Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH**       | 5,38 % | 15.07.2029            | 311.044           | 0,35                         |
| 300.000  | TenneT Holding BV*                             | 0,88 % | 16.06.2035            | 241.654           | 0,27                         |
| 300.000  | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV* | 4,38 % | 09.05.2030            | 307.830           | 0,35                         |
| 394.000  | Timken Co*                                     | 4,13 % | 23.05.2034            | 395.400           | 0,45                         |
| 697.000  | Toronto-Dominion Bank*                         | 2,86 % | 15.04.2031            | 699.114           | 0,79                         |
| 300.000  | Toronto-Dominion Bank*                         | 3,36 % | 16.02.2027            | 300.013           | 0,34                         |
| 300.000  | TotalEnergies SE*                              | 2,13 % | 31.12.2149            | 260.118           | 0,29                         |
| 300.000  | Transportes Aereos Portugueses SA*             | 5,13 % | 15.11.2029            | 307.901           | 0,35                         |
| 200.000  | TUI Cruises GmbH**                             | 5,00 % | 15.05.2030            | 203.245           | 0,23                         |
| 500.000  | UBS Group AG*                                  | 2,13 % | 13.10.2026            | 496.931           | 0,56                         |
| 400.000  | UniCredit Bank Austria AG*                     | 2,88 % | 10.11.2028            | 402.871           | 0,46                         |
| 400.000  | UniCredit SpA**                                | 3,88 % | 31.12.2149            | 387.937           | 0,44                         |
| 200.000  | Verizon Communications Inc*                    | 3,75 % | 28.02.2036            | 203.072           | 0,23                         |
| 500.000  | Virgin Money UK Plc*                           | 4,00 % | 18.03.2028            | 510.234           | 0,58                         |
| 100.000  | Volkswagen Financial Services AG*              | 3,88 % | 19.11.2031            | 100.034           | 0,11                         |
| 500.000  | Volkswagen International Finance NV*           | 1,88 % | 30.03.2027            | 485.972           | 0,55                         |
| 200.000  | Volkswagen International Finance NV*           | 4,38 % | 31.12.2149            | 184.534           | 0,21                         |
| 500.000  | Warnermedia Holdings Inc*                      | 4,69 % | 17.05.2033            | 502.968           | 0,57                         |
| 250.000  | Westpac Banking Corp*                          | 0,38 % | 02.04.2026            | 243.568           | 0,28                         |
| 100.000  | Ziggo Bond Co BV**                             | 6,13 % | 15.11.2032            | 100.750           | 0,11                         |
| <b>Euro insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>34.608.849</b> | <b>39,10</b>                 |

## Euro Bond Absolute Return - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                     | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR   | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|---|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 46,56 % (31. Dezember 2023: 54,54 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                   |                              |
| <b>Britisches Pfund</b>  |   |        |                       |                   |                              |
| 281.000  | AA Bond Co Ltd*                           | 6,85 % | 31.07.2031            | 347.790           | 0,39                         |
| 200.000  | Electricite de France SA*                 | 6,00 % | 31.12.2149            | 241.439           | 0,27                         |
| 200.000  | Electricite de France SA*                 | 7,38 % | 31.12.2149            | 246.290           | 0,28                         |
| 100.000  | Hammerson Plc*                            | 5,88 % | 08.10.2036            | 116.236           | 0,13                         |
| 400.000  | NGG Finance Plc*                          | 5,63 % | 18.06.2073            | 483.302           | 0,55                         |
| 300.000  | OSB Group Plc*                            | 8,88 % | 16.01.2030            | 396.191           | 0,45                         |
| 300.000  | Wessex Water Services Finance Plc*        | 1,50 % | 17.09.2029            | 303.051           | 0,34                         |
| <b>Britisches Pfund insgesamt</b>  |   |        |                       | <b>2.134.299</b>  | <b>2,41</b>                  |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>  |   |        |                       | <b>41.216.156</b> | <b>46,56</b>                 |
| <b>Staatsanleihen 41,33 % (31. Dezember 2023: 42,49 %)</b>                     |   |        |                       |                   |                              |
| <b>Tschechische Krone</b>  |   |        |                       |                   |                              |
| 21.880.000   | Czech Republic Government Bond*           | 4,50 % | 11.11.2032            | 893.757           | 1,01                         |
| 24.400.000   | Czech Republic Government Bond*           | 4,90 % | 14.04.2034            | 1.025.234         | 1,16                         |
| <b>Tschechische Krone insgesamt</b>  |   |        |                       | <b>1.918.991</b>  | <b>2,17</b>                  |
| <b>Euro</b>  |   |        |                       |                   |                              |
| 210.000  | Acquirente Unico SpA*                     | 2,80 % | 20.02.2026            | 209.593           | 0,24                         |
| 300.000  | Adif Alta Velocidad*                      | 3,25 % | 31.05.2029            | 303.535           | 0,34                         |
| 140.000  | Autonomous Community of Madrid Spain*     | 3,46 % | 30.04.2034            | 143.532           | 0,16                         |
| 600.000  | Bank Gospodarstwa Krajowego*              | 3,88 % | 13.03.2035            | 598.414           | 0,68                         |
| 300.000  | Bank Gospodarstwa Krajowego*              | 4,00 % | 08.09.2027            | 308.490           | 0,35                         |
| 200.000  | Bank Gospodarstwa Krajowego*              | 4,00 % | 13.03.2032            | 205.670           | 0,23                         |
| 484.000  | Bank Gospodarstwa Krajowego*              | 4,38 % | 13.03.2039            | 491.319           | 0,56                         |
| 100.000  | Bank Gospodarstwa Krajowego*              | 4,38 % | 11.06.2054            | 102.519           | 0,12                         |
| 500.000  | Bpifrance SACA*                           | 3,38 % | 25.05.2034            | 503.142           | 0,57                         |
| 338.000  | Bulgaria Government International Bond*   | 3,63 % | 05.09.2032            | 346.254           | 0,39                         |
| 450.000  | Bulgaria Government International Bond*   | 4,13 % | 23.09.2029            | 472.876           | 0,53                         |
| 500.000  | Bulgaria Government International Bond*   | 4,38 % | 13.05.2031            | 535.281           | 0,60                         |
| 482.000  | Bulgaria Government International Bond*   | 4,50 % | 27.01.2033            | 524.239           | 0,59                         |
| 545.000  | Bulgaria Government International Bond*   | 4,88 % | 13.05.2036            | 599.375           | 0,68                         |
| 2.000.000  | Bundesobligation*                         | 2,10 % | 12.04.2029            | 1.998.651         | 2,26                         |
| 1.000.000  | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe* | 2,10 % | 15.11.2029            | 997.750           | 1,13                         |
| 365.000  | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe* | 2,30 % | 15.02.2033            | 365.870           | 0,41                         |
| 100.150  | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe* | 2,50 % | 15.08.2046            | 98.830            | 0,11                         |
| 400.000  | Cassa Depositi e Prestiti SpA*            | 4,75 % | 18.10.2030            | 428.204           | 0,48                         |
| 400.000  | Croatia Government International Bond*    | 3,38 % | 12.03.2034            | 412.649           | 0,47                         |
| 360.000  | Denmark Government International Bond*    | 2,25 % | 02.10.2026            | 359.948           | 0,41                         |
| 646.874  | European Stability Mechanism*             | 2,38 % | 30.09.2027            | 648.109           | 0,73                         |
| 1.700.000  | European Stability Mechanism*             | 2,63 % | 18.09.2029            | 1.712.032         | 1,93                         |

## Euro Bond Absolute Return - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                             | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR   | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|---|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 41,33 % (31. Dezember 2023: 42,49 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                   |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |   |        |                       |                   |                              |
| 1.000.000  | European Union*                                   | 1,63 % | 04.12.2029            | 960.348           | 1,09                         |
| 559.161  | European Union*                                   | 2,50 % | 04.12.2031            | 553.746           | 0,63                         |
| 416.629  | European Union*                                   | 3,00 % | 04.12.2034            | 420.117           | 0,47                         |
| 1.206.034  | European Union*                                   | 3,13 % | 04.12.2030            | 1.241.708         | 1,40                         |
| 81.132   | European Union*                                   | 3,25 % | 04.02.2050            | 80.213            | 0,09                         |
| 210.509  | European Union*                                   | 3,38 % | 04.10.2039            | 214.631           | 0,24                         |
| 167.749  | European Union*                                   | 4,00 % | 04.04.2044            | 183.464           | 0,21                         |
| 696.740  | French Republic Government Bond OAT*              | 0,10 % | 01.03.2028            | 678.885           | 0,77                         |
| 154.593  | French Republic Government Bond OAT*              | 0,50 % | 25.05.2072            | 53.085            | 0,06                         |
| 328.917  | French Republic Government Bond OAT*              | 1,25 % | 25.05.2038            | 253.976           | 0,29                         |
| 880.000  | Hellenic Republic Government Bond*                | 3,38 % | 15.06.2034            | 890.430           | 1,01                         |
| 563.000  | Hellenic Republic Government Bond*                | 4,38 % | 18.07.2038            | 612.451           | 0,69                         |
| 235.000  | Instituto de Credito Oficial†                     | 3,80 % | 31.05.2029            | 246.221           | 0,28                         |
| 391.270  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**               | 1,40 % | 26.05.2025            | 390.609           | 0,44                         |
| 130.000  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*                | 1,45 % | 01.03.2036            | 105.093           | 0,12                         |
| 300.174  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**               | 1,60 % | 22.11.2028            | 298.040           | 0,34                         |
| 575.000  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**               | 3,15 % | 15.11.2031            | 574.494           | 0,65                         |
| 607.000  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**               | 3,45 % | 15.07.2027            | 621.422           | 0,70                         |
| 356.000  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**               | 4,05 % | 30.10.2037            | 370.769           | 0,42                         |
| 137.000  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**               | 4,15 % | 01.10.2039            | 141.987           | 0,16                         |
| 150.000  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**               | 4,30 % | 01.10.2054            | 153.652           | 0,17                         |
| 1.050.000  | Kingdom of Belgium Government Bond*               | 1,00 % | 22.06.2031            | 948.404           | 1,07                         |
| 450.000  | Latvia Government International Bond*             | 0,25 % | 23.01.2030            | 393.505           | 0,44                         |
| 494.000  | Lithuania Government International Bond*          | 3,50 % | 03.07.2031            | 510.832           | 0,58                         |
| 885.000  | Republic of Poland Government International Bond* | 3,13 % | 22.10.2031            | 890.947           | 1,01                         |
| 449.000  | Republic of Poland Government International Bond* | 3,88 % | 22.10.2039            | 452.360           | 0,51                         |
| 300.000  | Romanian Government International Bond*           | 5,13 % | 24.09.2031            | 293.641           | 0,33                         |
| 352.000  | Romanian Government International Bond*           | 5,25 % | 30.05.2032            | 344.216           | 0,39                         |
| 400.000  | Romanian Government International Bond*           | 6,38 % | 18.09.2033            | 417.483           | 0,47                         |
| 425.000  | Romanian Government International Bond*           | 6,63 % | 27.09.2029            | 458.600           | 0,52                         |
| 950.000  | Slovakia Government Bond*                         | 3,00 % | 06.11.2031            | 952.641           | 1,08                         |
| 878.008  | Slovakia Government Bond*                         | 3,75 % | 06.03.2034            | 904.582           | 1,02                         |
| 493.379  | Slovakia Government Bond*                         | 3,75 % | 23.02.2035            | 507.267           | 0,57                         |
| 812.000  | Spain Government Bond*                            | 0,50 % | 31.10.2031            | 701.695           | 0,79                         |
| 357.000  | Spain Government Bond*                            | 0,70 % | 30.04.2032            | 307.757           | 0,35                         |
| 253.000  | Spain Government Bond*                            | 1,25 % | 31.10.2030            | 234.177           | 0,26                         |
| 570.000  | Spain Government Bond*                            | 3,55 % | 31.10.2033            | 595.756           | 0,67                         |
| 431.000  | State of North Rhine-Westphalia Germany*          | 0,13 % | 04.06.2031            | 369.142           | 0,42                         |
| <b>Euro insgesamt</b>  |   |        |                       | <b>30.694.628</b> | <b>34,68</b>                 |

## Euro Bond Absolute Return - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                           | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR   | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|---|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 41,33 % (31. Dezember 2023: 42,49 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                   |                              |
| <b>Japanischer Yen</b>   |   |        |                       |                   |                              |
| 35.000.000   | Japan Government Thirty Year Bond*              | 2,20 % | 20.06.2054            | 213.140           | 0,24                         |
| <b>Japanischer Yen insgesamt</b>   |   |        |                       | <b>213.140</b>    | <b>0,24</b>                  |
| <b>Polnischer Zloty</b>  |   |        |                       |                   |                              |
| 4.134.000  | Republic of Poland Government Bond*             | 4,75 % | 25.07.2029            | 936.211           | 1,06                         |
| 2.240.000  | Republic of Poland Government Bond*             | 5,00 % | 25.10.2034            | 491.309           | 0,55                         |
| <b>Polnischer Zloty insgesamt</b>  |   |        |                       | <b>1.427.520</b>  | <b>1,61</b>                  |
| <b>Britisches Pfund</b>  |   |        |                       |                   |                              |
| 600.000  | United Kingdom Gilt*                            | 4,13 % | 22.07.2029            | 719.010           | 0,81                         |
| <b>Britisches Pfund insgesamt</b>  |   |        |                       | <b>719.010</b>    | <b>0,81</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>   |   |        |                       |                   |                              |
| 1.663.497  | United States Treasury Inflation Indexed Bonds* | 2,13 % | 15.04.2029            | 1.608.865         | 1,82                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |   |        |                       | <b>1.608.865</b>  | <b>1,82</b>                  |
| <b>Staatsanleihen insgesamt</b>  |   |        |                       | <b>36.582.154</b> | <b>41,33</b>                 |
| <b>Anlagen insgesamt</b>   |   |        |                       | <b>81.794.957</b> | <b>92,40</b>                 |

Devisenterminkontrakte 2,26 % (31. Dezember 2023: 0,08 %)

| Geforderter<br>Betrag | Zu zahlender<br>Betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn EUR | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|-----------------------|------------------------|-----------------------|--------------------------------|-----------|-------------------------------------|------------------------------|
| 5.422.390 CZK         | 213.898 €              | 16.01.2025            | Goldman Sachs International    | 1         | 1.422                               | 0,00                         |
| 745.886 CZK           | 29.456 €               | 16.01.2025            | Westpac Banking Corp           | 1         | 163                                 | 0,00                         |
| 223.351 €             | 35.832.629 ¥           | 16.01.2025            | BNP Paribas                    | 1         | 2.937                               | 0,00                         |
| 3.667.625 €           | 27.322.516 DKK         | 16.01.2025            | Deutsche Bank AG               | 2         | 3.244                               | 0,00                         |
| 1.711 €               | 268.992 ¥              | 16.01.2025            | Deutsche Bank AG               | 1         | 56                                  | 0,00                         |
| 298.268 €             | 1.272.373 PLN          | 16.01.2025            | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 1.077                               | 0,00                         |
| 201.895 €             | 1.505.254 DKK          | 16.01.2025            | State Street Bank and Trust Co | 1         | 17                                  | 0,00                         |
| 753.140 €             | 5.613.386 DKK          | 16.01.2025            | Westpac Banking Corp           | 1         | 296                                 | 0,00                         |
| 837.418 £             | 1.009.047 €            | 16.01.2025            | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 3.126                               | 0,00                         |
| 14.776 £              | 17.796 €               | 16.01.2025            | Westpac Banking Corp           | 1         | 64                                  | 0,00                         |
| 1.854.718 PLN         | 426.766 €              | 16.01.2025            | Citibank NA                    | 2         | 6.444                               | 0,01                         |
| 1.221.086 PLN         | 279.197 €              | 16.01.2025            | Goldman Sachs International    | 1         | 6.015                               | 0,01                         |
| 937.458 PLN           | 214.537 €              | 16.01.2025            | State Street Bank and Trust Co | 1         | 4.428                               | 0,01                         |
| 315.968 US\$          | 288.668 €              | 16.01.2025            | BNP Paribas                    | 1         | 16.305                              | 0,02                         |
| 933 US\$              | 839 €                  | 16.01.2025            | Standard Chartered Bank        | 1         | 62                                  | 0,00                         |

## Euro Bond Absolute Return - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 2,26 % (31. Dezember 2023: 0,08 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn EUR | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|-------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen USD</i>   |                     |                  |                             |           |                               |                      |
| 33.225.117 US\$   | 30.150.914 €        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 2         | 1.918.083                     | 2,17                 |
| 478.286 US\$  | 427.144 €           | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | 34.499                        | 0,04                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>™</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>1.998.238</b>              | <b>2,26</b>          |

### Futures-Kontrakte 0,43 % (31. Dezember 2023: 0,14 %)

| Anzahl Kontrakte   | Beschreibung  | Nicht realisierter Gewinn EUR | % des Nettovermögens |             |
|--|---|-------------------------------|----------------------|-------------|
| (8)  | 10-Year Mini Japanese Government Bond Future March 2025 | 541                           | 0,00                 |             |
| 10   | Canadian 5-Year Bond Future March 2025                  | 3.424                         | 0,00                 |             |
| (27)   | Euro-BTP Future March 2025                              | 66.330                        | 0,07                 |             |
| (43)   | Euro-Bund Future March 2025                             | 129.000                       | 0,15                 |             |
| (19)   | Euro-Buxl 30-Year Bond Future March 2025                | 149.720                       | 0,17                 |             |
| (14)   | Euro-OAT Future March 2025                              | 29.230                        | 0,03                 |             |
| (6)  | US Treasury 5-Year Note (CBT) Future March 2025         | 4.844                         | 0,01                 |             |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten <sup>‡</sup></b> |   |                               | <b>383.089</b>       | <b>0,43</b> |

### Zinsswap-Kontrakte 0,01 % (31. Dezember 2023: 0,33 %)

| Nominalwert  | Fälligkeit | Gegenpartei                   | Erhalt/(Zahlung) <sup>#</sup> | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Gewinn EUR | % des Nettovermögens |
|--|------------|-------------------------------|-------------------------------|-----------------|--------------------|-------------------------------|----------------------|
| EUR 1.500.000  | 25.10.2029 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 2,12 %          | 1D €STR            | 4.507                         | 0,01                 |
| EUR 800.000  | 25.10.2027 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 2,07 %          | 1D €STR            | 1.710                         | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Zinsswapkontrakten <sup>™</sup></b> |            |                               |                               |                 |                    | <b>6.217</b>                  | <b>0,01</b>          |

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

|  | Zeitwert EUR      | % des Nettovermögens |
|--|-------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> | <b>84.182.501</b> | <b>95,10</b>         |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (0,20 %) (31. Dezember 2023: (3,29 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei         | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust EUR | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|---------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 7.646.779 CZK      | 304.105 €           | 16.01.2025       | JPMorgan Chase Bank | 1         | (456)                          | (0,00)               |

## Euro Bond Absolute Return - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (0,20 %) (31. Dezember 2023: (3,29 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust EUR | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 411.529 DKK  | 55.219 €            | 16.01.2025       | BNP Paribas                    | 1         | (26)                           | (0,00)               |
| 1.006.737 €  | 845.404 £           | 16.01.2025       | BNP Paribas                    | 3         | (15.089)                       | (0,02)               |
| 343.359 €  | 1.494.851 PLN       | 16.01.2025       | BNP Paribas                    | 2         | (5.797)                        | (0,01)               |
| 323.487 €  | 8.169.125 CZK       | 16.01.2025       | Citibank NA                    | 2         | (905)                          | (0,00)               |
| 488.733 €  | 530.670 US\$        | 16.01.2025       | Citibank NA                    | 1         | (23.472)                       | (0,03)               |
| 731.855 €  | 18.532.346 CZK      | 16.01.2025       | Deutsche Bank AG               | 1         | (4.054)                        | (0,00)               |
| 680.516 €  | 2.942.325 PLN       | 16.01.2025       | Deutsche Bank AG               | 2         | (6.729)                        | (0,01)               |
| 476.122 €  | 2.082.285 PLN       | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 2         | (10.242)                       | (0,01)               |
| 313.770 €  | 7.935.967 CZK       | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | (1.363)                        | (0,00)               |
| 2.695.948 €  | 2.254.865 £         | 16.01.2025       | Standard Chartered Bank        | 2         | (29.468)                       | (0,03)               |
| 665.888 €  | 740.691 US\$        | 16.01.2025       | Standard Chartered Bank        | 1         | (49.030)                       | (0,07)               |
| 127.300 €  | 134.285 US\$        | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (2.313)                        | (0,00)               |
| 315.842 €  | 8.007.070 CZK       | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 2         | (2.114)                        | (0,00)               |
| 51.000 €   | 222.984 PLN         | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (1.083)                        | (0,00)               |
| 382.728 €  | 1.671.680 PLN       | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 2         | (7.730)                        | (0,01)               |
| 308.609 €  | 7.806.500 CZK       | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 1         | (1.383)                        | (0,00)               |
| 483.718 €  | 512.901 US\$        | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 1         | (11.335)                       | (0,01)               |
| 1.008.941 ¥  | 6.417 €             | 16.01.2025       | Deutsche Bank AG               | 1         | (211)                          | (0,00)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                                |           | <b>(172.800)</b>               | <b>(0,20)</b>        |

### Futures-Kontrakte (0,03 %) (31. Dezember 2023: (0,89 %))

| Anzahl Kontrakte  | Beschreibung                  | Nicht realisierter Verlust EUR | % des Nettovermögens |
|---|-------------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 11  | Euro-BOBL Future March 2025   | (2.720)                        | (0,00)               |
| 91  | Euro-Schatz Future March 2025 | (25.060)                       | (0,03)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten <sup>*</sup></b> |                               | <b>(27.780)</b>                | <b>(0,03)</b>        |

### Zinsswap-Kontrakte (0,01 %) (31. Dezember 2023: (0,00 %))

| Nominalwert   | Fälligkeit | Gegenpartei                   | Erhalt/(Zahlung) <sup>#</sup> | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Verlust EUR | % des Nettovermögens |
|---|------------|-------------------------------|-------------------------------|-----------------|--------------------|--------------------------------|----------------------|
| GBP 810.000   | 15.10.2029 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 3,83 %          | 1D SONIA           | (9.491)                        | (0,01)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Zinsswapkontrakten <sup>∞</sup></b> |            |                               |                               |                 |                    | <b>(9.491)</b>                 | <b>(0,01)</b>        |

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

## Euro Bond Absolute Return - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Credit-Default-Swap-Kontrakte (0,31 %) (31. Dezember 2023: (0,53 %))

|   | Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei                 | Referenzverbindlichkeit                                     | Zeitwert<br>EUR  | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|---|-------------|------------|-----------------------------|---|------------------|------------------------------|
| EUR   | 3.460.000   | 20.12.2029 | ICE Clear U.S. <sup>1</sup> | Buying default protection on iTRAXX Europe Crossover S42.V1 | (271.500)        | (0,31)                       |
| <b>Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt <sup>±</sup></b> |             |            |                             |   | <b>(271.500)</b> | <b>(0,31)</b>                |

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

|   | Zeitwert<br>EUR   | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|---|-------------------|------------------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(481.571)</b>  | <b>(0,55)</b>                |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>83.700.930</b> | <b>94,55</b>                 |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>4.821.244</b>  | <b>5,45</b>                  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>88.522.174</b> | <b>100,00</b>                |

| Portfolioanalyse  | EUR               | % des<br>Gesamtver-<br>mögens |
|---|-------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 71.645.957        | 80,09                         |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden            | 10.149.000        | 11,35                         |
| ± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden                          | 355.309           | 0,40                          |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap                            | 1.550.664         | 1,73                          |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>83.700.930</b> | <b>93,57</b>                  |

## European High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag  | Wertpapierbezeichnung                                 | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 0,86 % (31. Dezember 2023: 0,59 %)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>Euro</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 500.000   | Aurium CLO VII DAC Series 7X Class E                  | 8,88 %  | 15.05.2034            | 506.368          | 0,09                         |
| 1.000.000   | Avoca CLO XXIX DAC Series 29X Class E                 | 9,38 %  | 15.04.2037            | 1.010.876        | 0,19                         |
| 400.000   | Blackrock European CLO XIV DAC Series 14X Class E     | 10,46 % | 15.07.2036            | 400.594          | 0,07                         |
| 500.000   | Contego CLO XII DAC Series 12X Class E                | 11,21 % | 25.01.2038            | 508.649          | 0,09                         |
| 300.000   | CVC Cordatus Loan Fund XXVII DAC Series 27X Class F   | 13,17 % | 15.04.2035            | 310.521          | 0,06                         |
| 500.000   | Fidelity Grand Harbour CLO DAC Series 2023-2X Class E | 9,43 %  | 15.04.2038            | 505.495          | 0,09                         |
| 500.000   | OCP Euro CLO 2020-4 DAC Series 2020-4X Class ER       | 8,64 %  | 22.09.2034            | 509.720          | 0,09                         |
| 300.000   | Otranto Park CLO DAC Series 1X Class E                | 10,07 % | 15.05.2035            | 300.984          | 0,05                         |
| 375.000   | RRE 5 Loan Management DAC Series 5X Class DR          | 9,14 %  | 15.01.2037            | 384.458          | 0,07                         |
| 350.000   | Vesey Park CLO DAC Series 1X Class E                  | 12,89 % | 16.11.2032            | 359.033          | 0,06                         |
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) insgesamt **</b>                       |   |         |                       | <b>4.796.698</b> | <b>0,86</b>                  |
| <b>Unternehmensanleihen 94,41 % (31. Dezember 2023: 94,13 %)</b>                          |   |         |                       |                  |                              |
| <b>Euro</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 2.852.000   | A2A SpA*  | 5,00 %  | 31.12.2149            | 2.950.086        | 0,53                         |
| 500.000   | Abertis Infraestructuras Finance BV*                  | 3,25 %  | 31.12.2149            | 497.370          | 0,09                         |
| 2.000.000   | Abertis Infraestructuras Finance BV*                  | 4,87 %  | 31.12.2149            | 2.051.368        | 0,37                         |
| 600.000   | Accor SA*   | 4,88 %  | 31.12.2149            | 610.040          | 0,11                         |
| 2.300.000   | Accor SA*   | 7,25 %  | 31.12.2149            | 2.554.581        | 0,46                         |
| 1.768.000   | AccorInvest Group SA*                                 | 5,50 %  | 15.11.2031            | 1.811.085        | 0,32                         |
| 1.815.000   | Ahlstrom Holding 3 Oy*                                | 3,63 %  | 04.02.2028            | 1.791.686        | 0,32                         |
| 3.300.000   | Air France-KLM*                                       | 4,63 %  | 23.05.2029            | 3.403.557        | 0,61                         |
| 1.351.000   | Alexandrite Monnet UK Holdco Plc*                     | 10,50 % | 15.05.2029            | 1.483.599        | 0,26                         |
| 2.070.000   | Almaviva-The Italian Innovation Co SpA*               | 5,00 %  | 30.10.2030            | 2.108.813        | 0,38                         |
| 1.217.000   | Almirall SA*  | 2,13 %  | 30.09.2026            | 1.205.461        | 0,21                         |
| 1.705.000   | Altice Financing SA*                                  | 3,00 %  | 15.01.2028            | 1.326.736        | 0,24                         |
| 1.736.000   | Altice Financing SA**                                 | 4,25 %  | 15.08.2029            | 1.326.412        | 0,24                         |
| 429.000   | Altice France SA**                                    | 2,13 %  | 15.02.2025            | 405.228          | 0,07                         |
| 3.223.000   | Altice France SA**                                    | 4,13 %  | 15.01.2029            | 2.447.063        | 0,44                         |
| 3.287.000   | Amber Finco Plc*                                      | 6,63 %  | 15.07.2029            | 3.483.850        | 0,62                         |
| 1.900.000   | Aramark International Finance Sarl*                   | 3,13 %  | 01.04.2025            | 1.899.753        | 0,34                         |
| 1.245.000   | Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc* | 2,13 %  | 15.08.2026            | 1.116.640        | 0,20                         |
| 1.293.000   | Arena Luxembourg Finance Sarl*                        | 1,88 %  | 01.02.2028            | 1.235.228        | 0,22                         |
| 2.167.000   | Ashland Services BV**                                 | 2,00 %  | 30.01.2028            | 2.075.195        | 0,37                         |
| 2.442.000   | ASK Chemicals Deutschland Holding GmbH**              | 10,00 % | 15.11.2029            | 2.410.620        | 0,43                         |
| 2.714.000   | Assemblin Caverion Group AB**                         | 6,74 %  | 01.07.2031            | 2.726.764        | 0,49                         |
| 1.690.000   | Azelis Finance NV*                                    | 4,75 %  | 25.09.2029            | 1.743.615        | 0,31                         |

## European High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                     | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|--------|-----------------------|-----------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 94,41 % (31. Dezember 2023: 94,13 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                 |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |   |        |                       |                 |                              |
| 765.000  | Balder Finland OYJ*                       | 1,38 % | 24.05.2030            | 671.294         | 0,12                         |
| 1.011.000  | Balder Finland OYJ*                       | 2,00 % | 18.01.2031            | 906.575         | 0,16                         |
| 467.000  | Banijay Entertainment SAS**               | 7,00 % | 01.05.2029            | 493.273         | 0,09                         |
| 1.395.183  | Banijay SAS**                             | 6,50 % | 01.03.2026            | 1.398.845       | 0,25                         |
| 2.000.000  | Bayer AG*                                 | 5,38 % | 25.03.2082            | 1.960.591       | 0,35                         |
| 1.000.000  | Bayer AG*                                 | 5,50 % | 13.09.2054            | 1.001.313       | 0,18                         |
| 400.000  | Bayer AG*                                 | 7,00 % | 25.09.2083            | 422.700         | 0,08                         |
| 806.000  | BCP V Modular Services Finance II Plc**   | 4,75 % | 30.11.2028            | 793.447         | 0,14                         |
| 2.690.000  | BCP V Modular Services Finance Plc**      | 6,75 % | 30.11.2029            | 2.444.537       | 0,44                         |
| 1.293.000  | BE Semiconductor Industries NV**          | 4,50 % | 15.07.2031            | 1.355.136       | 0,24                         |
| 1.230.000  | Belden Inc*                               | 3,88 % | 15.03.2028            | 1.231.952       | 0,22                         |
| 2.601.000  | Benteler International AG*                | 9,38 % | 15.05.2028            | 2.751.234       | 0,49                         |
| 3.099.000  | Bertrand Franchise Finance SAS*           | 6,96 % | 18.07.2030            | 3.124.954       | 0,56                         |
| 5.158.000  | Birkenstock Financing Sarl*               | 5,25 % | 30.04.2029            | 5.237.111       | 0,93                         |
| 3.062.000  | Boels Topholding BV**                     | 5,75 % | 15.05.2030            | 3.210.890       | 0,57                         |
| 2.582.000  | British Telecommunications Plc*           | 5,13 % | 03.10.2054            | 2.680.100       | 0,48                         |
| 3.767.000  | Bubbles Bidco SpA**                       | 6,50 % | 30.09.2031            | 3.797.645       | 0,68                         |
| 1.495.000  | Canpack SA/Canpack US LLC*                | 2,38 % | 01.11.2027            | 1.456.037       | 0,26                         |
| 2.026.000  | Castello BC Bidco SpA**                   | 7,51 % | 14.11.2031            | 2.038.632       | 0,36                         |
| 5.054.000  | Castellum AB*                             | 3,13 % | 31.12.2149            | 4.865.023       | 0,87                         |
| 1.708.000  | Castle UK Finco Plc**                     | 8,27 % | 15.05.2028            | 1.720.964       | 0,31                         |
| 4.262.000  | CECONOMY AG*                              | 6,25 % | 15.07.2029            | 4.416.125       | 0,79                         |
| 2.009.000  | Cerba Healthcare SACA*                    | 3,50 % | 31.05.2028            | 1.664.743       | 0,30                         |
| 2.475.000  | Cheplapharm Arzneimittel GmbH*            | 7,50 % | 15.05.2030            | 2.442.516       | 0,44                         |
| 1.229.000  | Citycon OYJ*                              | 7,88 % | 31.12.2149            | 1.195.203       | 0,21                         |
| 2.615.000  | Clarios Global LP/Clarios US Finance Co** | 4,38 % | 15.05.2026            | 2.618.138       | 0,47                         |
| 2.698.000  | Constellium SE*                           | 5,38 % | 15.08.2032            | 2.746.038       | 0,49                         |
| 1.938.000  | CPI Property Group SA*                    | 1,50 % | 27.01.2031            | 1.543.132       | 0,28                         |
| 536.000  | CPI Property Group SA*                    | 1,75 % | 14.01.2030            | 452.585         | 0,08                         |
| 1.861.000  | CPI Property Group SA*                    | 3,75 % | 31.12.2149            | 1.637.343       | 0,29                         |
| 1.986.000  | CPI Property Group SA*                    | 4,88 % | 31.12.2149            | 1.934.821       | 0,34                         |
| 2.357.000  | CPI Property Group SA*                    | 6,00 % | 27.01.2032            | 2.372.544       | 0,42                         |
| 2.663.000  | CT Investment GmbH*                       | 6,38 % | 15.04.2030            | 2.786.017       | 0,50                         |
| 1.607.000  | Ctec II GmbH**                            | 5,25 % | 15.02.2030            | 1.486.033       | 0,26                         |
| 3.511.000  | Cullinan Holdco Scsp**                    | 4,63 % | 15.10.2026            | 3.307.801       | 0,59                         |
| 3.000.000  | EDP SA*                                   | 4,75 % | 29.05.2054            | 3.073.500       | 0,55                         |
| 1.100.000  | EDP SA*                                   | 5,94 % | 23.04.2083            | 1.157.941       | 0,21                         |

## European High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                       | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|-----------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 94,41 % (31. Dezember 2023: 94,13 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                 |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |   |         |                       |                 |                              |
| 6.600.000  | Electricite de France SA*                   | 2,63 %  | 31.12.2149            | 6.258.295       | 1,12                         |
| 2.200.000  | Electricite de France SA*                   | 3,38 %  | 31.12.2149            | 2.055.380       | 0,37                         |
| 100.000  | Electricite de France SA*                   | 5,00 %  | 31.12.2149            | 101.062         | 0,02                         |
| 1.000.000  | Electricite de France SA*                   | 5,63 %  | 31.12.2149            | 1.035.720       | 0,18                         |
| 3.000.000  | Electricite de France SA*                   | 7,50 %  | 31.12.2149            | 3.316.621       | 0,59                         |
| 4.047.000  | Elior Group SA*                             | 3,75 %  | 15.07.2026            | 4.021.787       | 0,72                         |
| 1.180.000  | EMRLD Borrower LP/Emerald Co-Issuer Inc**   | 6,38 %  | 15.12.2030            | 1.250.593       | 0,22                         |
| 2.248.000  | Energizer Gamma Acquisition BV**            | 3,50 %  | 30.06.2029            | 2.168.662       | 0,39                         |
| 1.494.000  | Engineering - Ingegneria Informatica - SpA* | 11,13 % | 15.05.2028            | 1.578.971       | 0,28                         |
| 3.975.000  | Ephios Subco 3 Sarl**                       | 7,88 %  | 31.01.2031            | 4.336.254       | 0,77                         |
| 4.067.000  | Eroski S Coop*                              | 10,63 % | 30.04.2029            | 4.435.653       | 0,79                         |
| 2.931.000  | Eurofins Scientific SE*                     | 6,75 %  | 31.12.2149            | 3.089.626       | 0,55                         |
| 3.529.000  | Fastighets AB Balder*                       | 2,87 %  | 02.06.2081            | 3.441.935       | 0,61                         |
| 2.822.000  | Fedrigoni SpA**                             | 6,13 %  | 15.06.2031            | 2.845.070       | 0,51                         |
| 419.000  | Fiber Bidco SpA*                            | 6,68 %  | 15.01.2030            | 423.067         | 0,08                         |
| 1.649.000  | Fiber Midco SpA*                            | 10,00 % | 15.06.2029            | 1.714.651       | 0,31                         |
| 1.690.000  | Flora Food Management BV**                  | 6,88 %  | 02.07.2029            | 1.767.145       | 0,31                         |
| 2.165.000  | Flos B&b Italia SpA*                        | 6,72 %  | 15.12.2029            | 2.172.063       | 0,39                         |
| 3.136.000  | Fnac Darty SA*                              | 6,00 %  | 01.04.2029            | 3.293.321       | 0,59                         |
| 1.515.000  | Food Service Project SA*                    | 5,50 %  | 21.01.2027            | 1.537.117       | 0,27                         |
| 1.289.000  | Forvia SE*                                  | 2,38 %  | 15.06.2029            | 1.159.671       | 0,21                         |
| 400.000  | Forvia SE*                                  | 3,13 %  | 15.06.2026            | 395.850         | 0,07                         |
| 1.100.000  | Forvia SE*                                  | 5,13 %  | 15.06.2029            | 1.102.758       | 0,20                         |
| 1.110.000  | Forvia SE*                                  | 5,50 %  | 15.06.2031            | 1.109.371       | 0,20                         |
| 1.398.000  | Forvia SE*                                  | 7,25 %  | 15.06.2026            | 1.447.637       | 0,26                         |
| 3.078.000  | Fressnapf Holding SE**                      | 5,25 %  | 31.10.2031            | 3.178.516       | 0,57                         |
| 1.220.634  | Globalworth Real Estate Investments Ltd*    | 6,25 %  | 31.03.2029            | 1.230.247       | 0,22                         |
| 1.554.438  | Globalworth Real Estate Investments Ltd*    | 6,25 %  | 31.03.2030            | 1.561.918       | 0,28                         |
| 1.475.000  | Goldstory SAS*                              | 6,75 %  | 01.02.2030            | 1.544.883       | 0,28                         |
| 4.020.000  | Grifols SA*                                 | 3,88 %  | 15.10.2028            | 3.642.614       | 0,65                         |
| 2.108.000  | Grifols SA*                                 | 7,50 %  | 01.05.2030            | 2.212.662       | 0,39                         |
| 2.035.000  | Gruenthal GmbH**                            | 4,13 %  | 15.05.2028            | 2.045.710       | 0,36                         |
| 2.056.000  | Gruenthal GmbH**                            | 4,63 %  | 15.11.2031            | 2.082.635       | 0,37                         |
| 400.000  | Grupo Antolin-Irausa SA*                    | 3,50 %  | 30.04.2028            | 297.331         | 0,05                         |
| 960.000  | Grupo Antolin-Irausa SA*                    | 10,38 % | 30.01.2030            | 808.210         | 0,14                         |
| 1.927.000  | Guala Closures SpA*                         | 3,25 %  | 15.06.2028            | 1.869.308       | 0,33                         |
| 1.200.000  | Heimstaden AB*                              | 4,38 %  | 06.03.2027            | 1.104.000       | 0,20                         |
| 1.100.000  | Heimstaden AB*                              | 6,75 %  | 31.12.2149            | 787.737         | 0,14                         |
| 1.410.000  | Heimstaden Bostad AB*                       | 2,63 %  | 31.12.2149            | 1.309.804       | 0,23                         |
| 1.611.000  | Heimstaden Bostad AB*                       | 3,00 %  | 31.12.2149            | 1.479.645       | 0,26                         |

## European High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                     | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|-----------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 94,41 % (31. Dezember 2023: 94,13 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                 |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |   |         |                       |                 |                              |
| 806.000  | Heimstaden Bostad AB*                                     | 3,63 %  | 31.12.2149            | 771.574         | 0,14                         |
| 1.961.000  | Heimstaden Bostad AB*                                     | 6,25 %  | 31.12.2149            | 1.978.512       | 0,35                         |
| 1.813.000  | Heimstaden Bostad Treasury BV*                            | 1,63 %  | 13.10.2031            | 1.545.069       | 0,28                         |
| 1.895.000  | Holding d'Infrastructures des Metiers de l'Environnement* | 4,88 %  | 24.10.2029            | 1.947.563       | 0,35                         |
| 1.740.000  | House of HR Group BV**                                    | 9,00 %  | 03.11.2029            | 1.740.352       | 0,31                         |
| 1.051.000  | HT Troplast GmbH**  | 9,38 %  | 15.07.2028            | 1.114.664       | 0,20                         |
| 1.611.491  | IHO Verwaltungs GmbH*                                     | 7,00 %  | 15.11.2031            | 1.651.672       | 0,29                         |
| 607.532  | IHO Verwaltungs GmbH*                                     | 8,75 %  | 15.05.2028            | 642.579         | 0,11                         |
| 1.128.000  | Iliad Holding SASU**                                      | 5,38 %  | 15.04.2030            | 1.162.545       | 0,21                         |
| 1.499.000  | Iliad Holding SASU**                                      | 5,63 %  | 15.10.2028            | 1.538.881       | 0,27                         |
| 2.726.000  | Iliad Holding SASU*                                       | 6,88 %  | 15.04.2031            | 2.930.979       | 0,52                         |
| 1.797.000  | IMA Industria Macchine Automatiche SpA*                   | 3,75 %  | 15.01.2028            | 1.770.800       | 0,32                         |
| 2.004.000  | INEOS Quattro Finance 2 Plc*                              | 8,50 %  | 15.03.2029            | 2.149.240       | 0,38                         |
| 1.317.000  | IQVIA Inc**   | 2,88 %  | 15.06.2028            | 1.290.751       | 0,23                         |
| 1.350.000  | Italmatch Chemicals SpA*                                  | 10,00 % | 06.02.2028            | 1.429.571       | 0,25                         |
| 1.243.000  | Jaguar Land Rover Automotive Plc*                         | 4,50 %  | 15.07.2028            | 1.253.581       | 0,22                         |
| 400.000  | Jaguar Land Rover Automotive Plc*                         | 6,88 %  | 15.11.2026            | 423.159         | 0,08                         |
| 989.000  | Kapla Holding SAS*  | 6,39 %  | 31.07.2030            | 994.400         | 0,18                         |
| 1.535.000  | Koninklijke KPN NV*                                       | 6,00 %  | 31.12.2149            | 1.634.529       | 0,29                         |
| 2.071.000  | Kronos International Inc**                                | 9,50 %  | 15.03.2029            | 2.283.083       | 0,41                         |
| 6.884.000  | Lorca Telecom Bondco SA*                                  | 4,00 %  | 18.09.2027            | 6.896.907       | 1,23                         |
| 2.669.000  | Loxam SAS*  | 5,75 %  | 15.07.2027            | 2.672.343       | 0,48                         |
| 2.504.000  | Lune Holdings Sarl**                                      | 5,63 %  | 15.11.2028            | 1.911.491       | 0,34                         |
| 2.142.000  | Mangrove Luxco III Sarl*                                  | 8,18 %  | 15.07.2029            | 2.167.972       | 0,39                         |
| 2.325.000  | Manuchar Group Sarl**                                     | 7,25 %  | 30.06.2027            | 2.293.801       | 0,41                         |
| 2.216.000  | Matterhorn Telecom SA**                                   | 3,13 %  | 15.09.2026            | 2.200.488       | 0,39                         |
| 2.659.000  | Monitchem HoldCo 3 SA*                                    | 8,75 %  | 01.05.2028            | 2.757.197       | 0,49                         |
| 1.471.000  | Mooney Group SpA**  | 6,72 %  | 17.12.2026            | 1.469.529       | 0,26                         |
| 2.265.000  | Motel One GmbH**  | 7,75 %  | 02.04.2031            | 2.443.624       | 0,44                         |
| 3.981.000  | Motion Finco Sarl*  | 7,38 %  | 15.06.2030            | 4.059.287       | 0,72                         |
| 3.136.000  | Multiversity SpA*   | 7,30 %  | 30.10.2028            | 3.159.433       | 0,56                         |
| 1.416.000  | Neinor Homes SA*  | 5,88 %  | 15.02.2030            | 1.479.281       | 0,26                         |
| 2.427.000  | Neopharmed Gentili SpA*                                   | 7,13 %  | 08.04.2030            | 2.580.053       | 0,46                         |
| 600.000  | Nexans SA*  | 4,13 %  | 29.05.2029            | 615.707         | 0,11                         |
| 1.400.000  | Nexans SA*  | 4,25 %  | 11.03.2030            | 1.435.058       | 0,26                         |
| 1.629.000  | Nidda Healthcare Holding GmbH**                           | 5,63 %  | 21.02.2030            | 1.683.914       | 0,30                         |
| 878.000  | Nidda Healthcare Holding GmbH**                           | 6,89 %  | 23.10.2030            | 887.658         | 0,16                         |
| 1.724.000  | Nobian Finance BV*  | 3,63 %  | 15.07.2026            | 1.711.070       | 0,30                         |
| 1.902.000  | Odido Group Holding BV**                                  | 5,50 %  | 15.01.2030            | 1.894.867       | 0,34                         |
| 400.000  | Olympus Water US Holding Corp*                            | 3,88 %  | 01.10.2028            | 391.396         | 0,07                         |

## European High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                             | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|--------|-----------------------|-----------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 94,41 % (31. Dezember 2023: 94,13 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                 |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |   |        |                       |                 |                              |
| 1.854.000  | Olympus Water US Holding Corp <sup>*</sup>        | 5,38 % | 01.10.2029            | 1.778.902       | 0,32                         |
| 2.918.000  | Olympus Water US Holding Corp <sup>*</sup>        | 9,63 % | 15.11.2028            | 3.115.182       | 0,56                         |
| 2.997.000  | Ontex Group NV <sup>*</sup>                       | 3,50 % | 15.07.2026            | 2.988.841       | 0,53                         |
| 3.070.000  | Optics Bidco SpA <sup>**</sup>                    | 1,63 % | 18.01.2029            | 2.843.588       | 0,51                         |
| 894.000  | Optics Bidco SpA <sup>*</sup>                     | 2,38 % | 12.10.2027            | 865.648         | 0,15                         |
| 1.334.000  | Optics Bidco SpA <sup>*</sup>                     | 6,88 % | 15.02.2028            | 1.454.394       | 0,26                         |
| 2.992.000  | Optics Bidco SpA <sup>*</sup>                     | 7,88 % | 31.07.2028            | 3.387.683       | 0,60                         |
| 1.035.000  | Orsted AS <sup>*</sup>                            | 1,50 % | 18.02.3021            | 870.077         | 0,15                         |
| 1.325.000  | Orsted AS <sup>*</sup>                            | 1,75 % | 09.12.3019            | 1.249.649       | 0,22                         |
| 2.890.000  | Orsted AS <sup>*</sup>                            | 5,13 % | 14.03.3024            | 3.003.830       | 0,54                         |
| 1.114.000  | Pachelbel Bidco SpA <sup>**</sup>                 | 7,13 % | 17.05.2031            | 1.196.366       | 0,21                         |
| 1.730.875  | PCF GmbH <sup>*</sup>                             | 4,75 % | 15.04.2029            | 1.442.589       | 0,26                         |
| 1.227.000  | Perrigo Finance Unlimited Co <sup>*</sup>         | 5,38 % | 30.09.2032            | 1.273.197       | 0,23                         |
| 3.680.000  | PEU Finance Plc <sup>*</sup>                      | 7,25 % | 01.07.2028            | 3.859.325       | 0,69                         |
| 1.254.000  | Picard Groupe SAS <sup>**</sup>                   | 6,38 % | 01.07.2029            | 1.307.396       | 0,23                         |
| 1.255.000  | PLT VII Finance Sarl <sup>*</sup>                 | 6,00 % | 15.06.2031            | 1.324.295       | 0,24                         |
| 1.020.000  | PLT VII Finance Sarl <sup>*</sup>                 | 6,39 % | 15.06.2031            | 1.024.962       | 0,18                         |
| 3.371.000  | Primo Water Holdings Inc <sup>**</sup>            | 3,88 % | 31.10.2028            | 3.314.022       | 0,59                         |
| 345.000  | ProGroup AG <sup>*</sup>                          | 5,13 % | 15.04.2029            | 340.321         | 0,06                         |
| 3.940.000  | ProGroup AG <sup>*</sup>                          | 5,38 % | 15.04.2031            | 3.866.962       | 0,69                         |
| 922.000  | Project Grand UK Plc <sup>*</sup>                 | 9,00 % | 01.06.2029            | 971.696         | 0,17                         |
| 3.500.000  | Proximus SADP <sup>*</sup>                        | 4,75 % | 31.12.2149            | 3.493.438       | 0,62                         |
| 1.063.000  | Q-Park Holding I BV <sup>*</sup>                  | 5,13 % | 01.03.2029            | 1.099.012       | 0,20                         |
| 825.000  | Q-Park Holding I BV <sup>**</sup>                 | 5,13 % | 15.02.2030            | 849.614         | 0,15                         |
| 2.297.000  | Rakuten Group Inc <sup>*</sup>                    | 4,25 % | 31.12.2149            | 2.154.701       | 0,38                         |
| 3.326.000  | RAY Financing LLC <sup>*</sup>                    | 6,50 % | 15.07.2031            | 3.485.355       | 0,62                         |
| 2.600.000  | Roquette Freres SA <sup>*</sup>                   | 5,49 % | 31.12.2149            | 2.654.769       | 0,47                         |
| 1.350.000  | Rossini Sarl <sup>*</sup>                         | 6,56 % | 31.12.2029            | 1.369.271       | 0,24                         |
| 1.703.000  | Rossini Sarl <sup>*</sup>                         | 6,75 % | 31.12.2029            | 1.804.167       | 0,32                         |
| 1.316.000  | Sammontana Italia SpA <sup>**</sup>               | 6,97 % | 15.10.2031            | 1.325.541       | 0,24                         |
| 4.135.000  | Sappi Papier Holding GmbH <sup>*</sup>            | 3,13 % | 15.04.2026            | 4.112.154       | 0,73                         |
| 900.000  | Schaeffler AG <sup>*</sup>                        | 3,38 % | 12.10.2028            | 884.884         | 0,16                         |
| 1.600.000  | Schaeffler AG <sup>*</sup>                        | 4,50 % | 28.03.2030            | 1.611.374       | 0,29                         |
| 1.000.000  | Schaeffler AG <sup>*</sup>                        | 4,75 % | 14.08.2029            | 1.026.609       | 0,18                         |
| 1.306.106  | Sigma Holdco BV <sup>**</sup>                     | 5,75 % | 15.05.2026            | 1.296.029       | 0,23                         |
| 1.233.000  | Stonegate Pub Co Financing 2019 PLC <sup>**</sup> | 9,65 % | 31.07.2029            | 1.277.354       | 0,23                         |
| 2.765.000  | Summer BC Holdco B Sarl <sup>**</sup>             | 5,75 % | 31.10.2026            | 2.765.518       | 0,49                         |
| 1.718.000  | Summit Properties Ltd <sup>*</sup>                | 2,00 % | 31.01.2025            | 1.686.700       | 0,30                         |
| 685.000  | Sunrise HoldCo IV BV <sup>*</sup>                 | 3,88 % | 15.06.2029            | 668.542         | 0,12                         |
| 3.413.000  | Synthomer Plc <sup>*</sup>                        | 7,38 % | 02.05.2029            | 3.574.503       | 0,64                         |

## European High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                          | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|--------|-----------------------|-----------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 94,41 % (31. Dezember 2023: 94,13 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                 |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |  |        |                       |                 |                              |
| 4.948.126  | Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH**       | 6,00 % | 30.07.2026            | 4.963.768       | 0,89                         |
| 1.398.000  | Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH**       | 5,38 % | 15.07.2029            | 1.449.464       | 0,26                         |
| 2.042.000  | Telecom Italia SpA**                           | 1,63 % | 18.01.2029            | 1.918.553       | 0,34                         |
| 939.000  | Telecom Italia SpA*                            | 6,88 % | 15.02.2028            | 1.025.578       | 0,18                         |
| 1.104.000  | Telecom Italia SpA*                            | 7,88 % | 31.07.2028            | 1.250.509       | 0,22                         |
| 1.600.000  | Telefonica Europe BV*                          | 2,88 % | 31.12.2149            | 1.565.975       | 0,28                         |
| 1.900.000  | Telefonica Europe BV*                          | 5,75 % | 31.12.2149            | 2.036.291       | 0,36                         |
| 3.400.000  | Telefonica Europe BV*                          | 6,14 % | 31.12.2149            | 3.677.317       | 0,66                         |
| 1.400.000  | Telefonica Europe BV*                          | 6,75 % | 31.12.2149            | 1.573.180       | 0,28                         |
| 5.206.000  | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV* | 4,38 % | 09.05.2030            | 5.341.877       | 0,95                         |
| 1.072.000  | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV* | 4,50 % | 01.03.2025            | 1.073.380       | 0,19                         |
| 991.000  | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV* | 6,00 % | 31.01.2025            | 991.575         | 0,18                         |
| 3.489.000  | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV* | 7,38 % | 15.09.2029            | 4.026.982       | 0,72                         |
| 1.920.000  | TI Automotive Finance Plc**                    | 3,75 % | 15.04.2029            | 1.911.900       | 0,34                         |
| 2.395.800  | TK Elevator Holdco GmbH**                      | 6,63 % | 15.07.2028            | 2.406.725       | 0,43                         |
| 4.899.000  | TK Elevator Midco GmbH**                       | 4,38 % | 15.07.2027            | 4.900.225       | 0,87                         |
| 2.900.000  | Transportes Aereos Portugueses SA*             | 5,13 % | 15.11.2029            | 2.976.378       | 0,53                         |
| 1.769.000  | Trivium Packaging Finance BV*                  | 3,75 % | 15.08.2026            | 1.758.452       | 0,31                         |
| 1.229.000  | Trivium Packaging Finance BV*                  | 6,77 % | 15.08.2026            | 1.232.748       | 0,22                         |
| 2.747.000  | TUI Cruises GmbH**                             | 5,00 % | 15.05.2030            | 2.791.576       | 0,50                         |
| 4.003.000  | UGI International LLC**                        | 2,50 % | 01.12.2029            | 3.734.379       | 0,67                         |
| 1.025.000  | United Group BV**                              | 5,25 % | 01.02.2030            | 1.019.902       | 0,18                         |
| 1.778.000  | United Group BV**                              | 6,50 % | 31.10.2031            | 1.815.449       | 0,32                         |
| 1.822.000  | United Group BV**                              | 6,75 % | 15.02.2031            | 1.888.448       | 0,34                         |
| 854.000  | UPCB Finance VII Ltd*                          | 3,63 % | 15.06.2029            | 848.662         | 0,15                         |
| 1.000.000  | Valeo SE*                                      | 4,50 % | 11.04.2030            | 1.000.307       | 0,18                         |
| 500.000  | Veolia Environnement SA*                       | 2,25 % | 31.12.2149            | 490.804         | 0,09                         |
| 1.600.000  | Veolia Environnement SA*                       | 2,50 % | 31.12.2149            | 1.497.960       | 0,27                         |
| 3.795.000  | Verisure Holding AB*                           | 3,25 % | 15.02.2027            | 3.747.031       | 0,67                         |
| 2.994.000  | Verisure Midholding AB*                        | 5,25 % | 15.02.2029            | 3.003.963       | 0,54                         |
| 2.767.000  | VF Corp*                                       | 4,25 % | 07.03.2029            | 2.770.144       | 0,49                         |
| 1.466.000  | Virgin Media Finance Plc**                     | 3,75 % | 15.07.2030            | 1.356.134       | 0,24                         |
| 2.932.000  | Vmed O2 UK Financing I Plc**                   | 5,63 % | 15.04.2032            | 2.992.558       | 0,53                         |
| 400.000  | Vodafone Group Plc*                            | 2,63 % | 27.08.2080            | 395.699         | 0,07                         |
| 1.249.000  | Vodafone Group Plc*                            | 3,00 % | 27.08.2080            | 1.181.254       | 0,21                         |
| 2.047.000  | Vodafone Group Plc*                            | 4,20 % | 03.10.2078            | 2.090.141       | 0,37                         |
| 2.600.000  | Volkswagen International Finance NV*           | 3,88 % | 31.12.2149            | 2.425.319       | 0,43                         |
| 400.000  | Volkswagen International Finance NV*           | 3,88 % | 31.12.2149            | 390.712         | 0,07                         |
| 3.500.000  | Walgreens Boots Alliance Inc*                  | 2,13 % | 20.11.2026            | 3.383.638       | 0,60                         |
| 1.911.000  | Zegona Finance Plc*                            | 6,75 % | 15.07.2029            | 2.039.133       | 0,36                         |

## European High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR    | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 94,41 % (31. Dezember 2023: 94,13 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                    |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |   |         |                       |                    |                              |
| 1.900.000  | ZF Europe Finance BV*   | 4,75 %  | 31.01.2029            | 1.852.365          | 0,33                         |
| 1.900.000  | ZF Europe Finance BV*   | 6,13 %  | 13.03.2029            | 1.946.806          | 0,35                         |
| 2.700.000  | ZF Finance GmbH*  | 3,75 %  | 21.09.2028            | 2.570.062          | 0,46                         |
| 4.970.000  | Ziggo Bond Co BV*   | 3,38 %  | 28.02.2030            | 4.541.111          | 0,81                         |
| <b>Euro insgesamt</b>  |   |         |                       | <b>453.712.457</b> | <b>80,91</b>                 |
| <b>Britisches Pfund</b>  |   |         |                       |                    |                              |
| 1.123.484  | AA Bond Co Ltd*   | 6,50 %  | 31.01.2026            | 1.362.190          | 0,24                         |
| 710.000  | AA Bond Co Ltd*   | 6,85 %  | 31.07.2031            | 878.757            | 0,16                         |
| 2.349.000  | Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl* | 4,88 %  | 01.06.2028            | 2.647.045          | 0,47                         |
| 483.000  | B&M European Value Retail SA*   | 4,00 %  | 15.11.2028            | 549.577            | 0,10                         |
| 1.087.000  | B&M European Value Retail SA*   | 6,50 %  | 27.11.2031            | 1.307.415          | 0,23                         |
| 1.538.000  | B&M European Value Retail SA*   | 8,13 %  | 15.11.2030            | 1.988.274          | 0,35                         |
| 2.560.000  | Bellis Acquisition Co Plc**   | 8,13 %  | 14.05.2030            | 3.000.893          | 0,54                         |
| 1.025.000  | Bellis Finco Plc**  | 4,00 %  | 16.02.2027            | 1.172.323          | 0,21                         |
| 394.000  | British Telecommunications Plc*   | 8,38 %  | 20.12.2083            | 509.960            | 0,09                         |
| 1.105.000  | Constellation Automotive Financing Plc*                                       | 4,88 %  | 15.07.2027            | 1.274.483          | 0,23                         |
| 2.248.000  | Co-operative Group Holdings 2011 Ltd*   | 7,50 %  | 08.07.2026            | 2.791.317          | 0,50                         |
| 1.632.000  | CPI Property Group SA*  | 2,75 %  | 22.01.2028            | 1.803.700          | 0,32                         |
| 806.000  | CPUK Finance Ltd*   | 4,50 %  | 28.08.2027            | 928.035            | 0,17                         |
| 2.893.000  | CPUK Finance Ltd**  | 6,50 %  | 28.08.2026            | 3.491.798          | 0,62                         |
| 1.470.000  | Deuce Finco Plc**   | 5,50 %  | 15.06.2027            | 1.741.998          | 0,31                         |
| 2.373.000  | Edge Finco Plc**  | 8,13 %  | 15.08.2031            | 2.940.016          | 0,52                         |
| 700.000  | Electricite de France SA*   | 7,38 %  | 31.12.2149            | 862.016            | 0,15                         |
| 1.155.000  | Iceland Bondco Plc**  | 4,38 %  | 15.05.2028            | 1.283.479          | 0,23                         |
| 826.000  | Iceland Bondco Plc**  | 10,88 % | 15.12.2027            | 1.070.983          | 0,19                         |
| 1.869.000  | Iron Mountain UK Plc*   | 3,88 %  | 15.11.2025            | 2.224.043          | 0,40                         |
| 1.479.000  | Kier Group Plc*   | 9,00 %  | 15.02.2029            | 1.887.785          | 0,34                         |
| 2.728.000  | Maison Finco Plc**  | 6,00 %  | 31.10.2027            | 3.246.692          | 0,58                         |
| 1.720.000  | Market Bidco Finco Plc**  | 5,50 %  | 04.11.2027            | 1.989.266          | 0,36                         |
| 1.225.000  | Miller Homes Group Finco Plc**  | 7,00 %  | 15.05.2029            | 1.442.930          | 0,26                         |
| 1.563.000  | Mobico Group Plc*   | 4,25 %  | 31.12.2149            | 1.812.031          | 0,32                         |
| 2.398.000  | MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp*                                | 2,50 %  | 24.03.2026            | 2.580.138          | 0,46                         |
| 3.353.000  | NGG Finance Plc*  | 5,63 %  | 18.06.2073            | 4.051.277          | 0,72                         |
| 1.300.000  | Ocado Group Plc*  | 6,25 %  | 06.08.2029            | 1.472.526          | 0,26                         |
| 927.000  | Ocado Group Plc*  | 10,50 % | 08.08.2029            | 1.139.813          | 0,20                         |
| 1.523.000  | Pinewood Finco Plc**  | 3,63 %  | 15.11.2027            | 1.747.152          | 0,31                         |
| 2.352.000  | Pinnacle Bidco Plc*   | 10,00 % | 11.10.2028            | 3.027.477          | 0,54                         |
| 1.740.000  | RAC Bond Co Plc**   | 5,25 %  | 04.11.2027            | 2.039.175          | 0,36                         |
| 1.796.000  | Sherwood Financing Plc*   | 9,63 %  | 15.12.2029            | 2.172.197          | 0,39                         |

## European High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                         | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR    | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 94,41 % (31. Dezember 2023: 94,13 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                    |                              |
| <b>Britisches Pfund (Fortsetzung)</b>  |   |         |                       |                    |                              |
| 1.120.000  | Travis Perkins Plc*                           | 3,75 %  | 17.02.2026            | 1.325.348          | 0,24                         |
| 3.284.000  | TVL Finance Plc*                              | 10,25 % | 28.04.2028            | 4.131.251          | 0,74                         |
| 712.000  | Virgin Media O2 Vendor Financing Notes V DAC* | 7,88 %  | 15.03.2032            | 860.697            | 0,15                         |
| 806.000  | Virgin Media Secured Finance Plc*             | 4,25 %  | 15.01.2030            | 858.610            | 0,15                         |
| 2.409.000  | Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC** | 4,88 %  | 15.07.2028            | 2.722.649          | 0,49                         |
| 1.950.000  | Vmed O2 UK Financing I Plc**                  | 4,50 %  | 15.07.2031            | 2.019.427          | 0,36                         |
| 1.491.000  | Zenith Finco Plc**                            | 6,50 %  | 30.06.2027            | 1.346.884          | 0,24                         |
| <b>Britisches Pfund insgesamt</b>  |   |         |                       | <b>75.701.627</b>  | <b>13,50</b>                 |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>  |   |         |                       | <b>529.414.084</b> | <b>94,41</b>                 |
| <b>Anlagen insgesamt</b>   |   |         |                       | <b>534.210.782</b> | <b>95,27</b>                 |

Devisenterminkontrakte 0,47 % (31. Dezember 2023: 0,15 %)

| Geforderter<br>Betrag  | Zu zahlender<br>Betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn EUR | % des<br>Nettöver-<br>mögens          |
|--|------------------------|-----------------------|-----------------------------|-----------|-------------------------------------|---------------------------------------|
| 11.890.685 £   | 14.331.825 €           | 16.01.2025            | Westpac Banking Corp        | 1         | 40.241                              | 0,01                                  |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i>  |                        |                       |                             |           |                                     |                                       |
| 15.622 CHF   | 16.624 €               | 16.01.2025            | Westpac Banking Corp        | 2         | 39                                  | 0,00                                  |
| 7.269 €  | 6.791 CHF              | 16.01.2025            | Goldman Sachs International | 1         | 24                                  | 0,00                                  |
| 691.252 €  | 646.251 CHF            | 16.01.2025            | Westpac Banking Corp        | 4         | 1.931                               | 0,00                                  |
| <i>Abgesicherte Klassen USD</i>  |                        |                       |                             |           |                                     |                                       |
| 42.185.488 US\$  | 38.282.499 €           | 16.01.2025            | Goldman Sachs International | 4         | 2.435.080                           | 0,42                                  |
| 7.062.329 US\$   | 6.616.413 €            | 16.01.2025            | Westpac Banking Corp        | 32        | 200.174                             | 0,04                                  |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>                        |                        |                       |                             |           | <b>2.677.489</b>                    | <b>0,47</b>                           |
|  |                        |                       |                             |           | <b>Zeitwert<br/>EUR</b>             | <b>% des<br/>Nettöver-<br/>mögens</b> |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |                        |                       |                             |           | <b>536.888.271</b>                  | <b>95,74</b>                          |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,37 %) (31. Dezember 2023: (0,31 %))

| Geforderter<br>Betrag           | Zu zahlender<br>Betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht<br>realisierter<br>Verlust EUR | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|---------------------------------|------------------------|-----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------------|------------------------------|
| 86.648.805 €                    | 72.592.534 £           | 16.01.2025            | UBS AG                      | 4         | (1.092.535)                          | (0,19)                       |
| 262.974 €                       | 295.155 US\$           | 16.01.2025            | Westpac Banking Corp        | 1         | (21.910)                             | (0,00)                       |
| 3.649.069 €                     | 3.044.236 £            | 16.01.2025            | Westpac Banking Corp        | 1         | (30.446)                             | (0,01)                       |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i> |                        |                       |                             |           |                                      |                              |
| 3.274.595 CHF                   | 3.504.758 €            | 16.01.2025            | Goldman Sachs International | 2         | (11.920)                             | (0,00)                       |
| 462.235 CHF                     | 497.821 €              | 16.01.2025            | Westpac Banking Corp        | 20        | (4.778)                              | (0,00)                       |
| <i>Abgesicherte Klassen USD</i> |                        |                       |                             |           |                                      |                              |
| 14.338.327 €                    | 15.806.873 US\$        | 16.01.2025            | Goldman Sachs International | 1         | (918.521)                            | (0,17)                       |

## European High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (0,37 %) (31. Dezember 2023: (0,31 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei          | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust EUR | % des Nettovermögens         |
|---|---------------------|------------------|----------------------|-----------|--------------------------------|------------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen USD (Fortsetzung)</i>   |                     |                  |                      |           |                                |                              |
| 415.092 €   | 436.768 US\$        | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp | 14        | (6.478)                        | (0,00)                       |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>                          |                     |                  |                      |           | <b>(2.086.588)</b>             | <b>(0,37)</b>                |
|   |                     |                  |                      |           | <b>Zeitwert EUR</b>            | <b>% des Nettovermögens</b>  |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> |                     |                  |                      |           | <b>(2.086.588)</b>             | <b>(0,37)</b>                |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              |                     |                  |                      |           | <b>534.801.683</b>             | <b>95,37</b>                 |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  |                     |                  |                      |           | <b>25.951.871</b>              | <b>4,63</b>                  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   |                     |                  |                      |           | <b>560.753.554</b>             | <b>100,00</b>                |
| <b>Portfolioanalyse</b>   |                     |                  |                      |           | <b>EUR</b>                     | <b>% des Gesamtvermögens</b> |
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind   |                     |                  |                      |           | 369.187.054                    | 65,44                        |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden              |                     |                  |                      |           | 165.023.728                    | 29,25                        |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente   |                     |                  |                      |           | 590.901                        | 0,10                         |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  |                     |                  |                      |           | <b>534.801.683</b>             | <b>94,79</b>                 |

## European Sustainable Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der<br>Anteile                              | Wertpapierbezeichnung           | Zeitwert<br>EUR   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---------------------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Aktien 99,15 % (31. Dezember 2023: 99,49 %)</b> |                                 |                   |                              |
| <b>Dänische Krone</b>                              |                                 |                   |                              |
| 46.552   | Netcompany Group A/S            | 2.116.211         | 1,43                         |
| 85.161   | Novo Nordisk A/S Class B        | 7.128.291         | 4,80                         |
| <b>Dänische Krone insgesamt</b>                    |                                 | <b>9.244.502</b>  | <b>6,23</b>                  |
| <b>Euro</b>  |                                 |                   |                              |
| 2.809  | Adyen NV                        | 4.036.533         | 2,72                         |
| 12.490   | ASML Holding NV                 | 8.476.963         | 5,71                         |
| 31.323   | Beiersdorf AG                   | 3.884.052         | 2,61                         |
| 68.860   | Dassault Systemes SE            | 2.306.810         | 1,55                         |
| 11.027   | DiaSorin SpA                    | 1.097.848         | 0,74                         |
| 14.947   | EssilorLuxottica SA             | 3.521.513         | 2,37                         |
| 67.134   | Euronext NV                     | 7.270.612         | 4,90                         |
| 6.214  | Ferrari NV                      | 2.562.654         | 1,72                         |
| 1.457  | Hermes International SCA        | 3.383.154         | 2,28                         |
| 13.885   | L'Oreal SA                      | 4.746.587         | 3,20                         |
| 127.618  | RELX Plc                        | 5.579.459         | 3,76                         |
| 7.327  | Reply SpA                       | 1.123.962         | 0,76                         |
| 13.065   | Sartorius Stedim Biotech        | 2.465.366         | 1,66                         |
| 32.414   | Schneider Electric SE           | 7.808.533         | 5,26                         |
| 53.662   | Scout24 SE                      | 4.566.636         | 3,07                         |
| 92.985   | Zalando SE                      | 3.011.784         | 2,03                         |
| <b>Euro insgesamt</b>                              |                                 | <b>65.842.466</b> | <b>44,34</b>                 |
| <b>Norwegische Krone</b>                           |                                 |                   |                              |
| 72.736   | Bakkafrost P/F                  | 3.921.133         | 2,64                         |
| <b>Norwegische Krone insgesamt</b>                 |                                 | <b>3.921.133</b>  | <b>2,64</b>                  |
| <b>Britisches Pfund</b>                            |                                 |                   |                              |
| 192.454  | 3i Group Plc                    | 8.295.787         | 5,59                         |
| 39.393   | AstraZeneca Plc                 | 4.987.417         | 3,36                         |
| 120.221  | Compass Group Plc               | 3.870.627         | 2,61                         |
| 166.384  | CVS Group Plc                   | 1.690.378         | 1,14                         |
| 27.855   | Diploma Plc                     | 1.431.809         | 0,96                         |
| 788.084  | Haleon Plc                      | 3.597.223         | 2,42                         |
| 50.389   | London Stock Exchange Group Plc | 6.877.494         | 4,63                         |
| 282.020  | Sage Group Plc                  | 4.342.114         | 2,92                         |
| <b>Britisches Pfund insgesamt</b>                  |                                 | <b>35.092.849</b> | <b>23,63</b>                 |

## European Sustainable Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl<br>der Anteile   | Wertpapierbezeichnung              | Zeitwert<br>EUR         | % des<br>Nettöver-<br>mögens           |
|---|------------------------------------|-------------------------|--|
| <b>Aktien 99,15 % (31. Dezember 2023: 99,49 %) (Fortsetzung)</b>  |                                    |                         |  |
| <b>Schwedische Krone</b>  |                                    |                         |  |
| 189.545   | Assa Abloy AB Class B              | 5.413.916               | 3,64                                   |
| 266.525   | Atlas Copco AB Class A             | 3.933.291               | 2,65                                   |
|   | <b>Schwedische Krone insgesamt</b> | <b>9.347.207</b>        | <b>6,29</b>                            |
| <b>Schweizer Franken</b>  |                                    |                         |  |
| 27.208  | Galderma Group AG                  | 2.917.891               | 1,96                                   |
| 73.187  | Nestle SA                          | 5.839.849               | 3,93                                   |
| 4.346   | Partners Group Holding AG          | 5.696.351               | 3,84                                   |
| 31.497  | Straumann Holding AG               | 3.834.664               | 2,58                                   |
| 4.306   | Tecan Group AG                     | 929.641                 | 0,63                                   |
| 5.577   | VAT Group AG                       | 2.037.245               | 1,37                                   |
|   | <b>Schweizer Franken insgesamt</b> | <b>21.255.641</b>       | <b>14,31</b>                           |
| <b>US-Dollar</b>  |                                    |                         |  |
| 5.866   | Spotify Technology SA              | 2.534.361               | 1,71                                   |
|   | <b>US-Dollar insgesamt</b>         | <b>2.534.361</b>        | <b>1,71</b>                            |
|   | <b>Aktien insgesamt *</b>          | <b>147.238.159</b>      | <b>99,15</b>                           |
|   | <b>Anlagen insgesamt</b>           | <b>147.238.159</b>      | <b>99,15</b>                           |
|   |                                    | <b>Zeitwert<br/>EUR</b> | <b>% des<br/>Nettöver-<br/>mögens</b>  |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>  |                                    | <b>147.238.159</b>      | <b>99,15</b>                           |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>            |                                    | <b>147.238.159</b>      | <b>99,15</b>                           |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  |                                    | <b>1.261.874</b>        | <b>0,85</b>                            |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                 |                                    | <b>148.500.033</b>      | <b>100,00</b>                          |
| <b>Portfolioanalyse</b>   |                                    | <b>EUR</b>              | <b>% des<br/>Gesamtver-<br/>mögens</b> |
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind |                                    | 147.238.159             | 99,05                                  |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  |                                    | <b>147.238.159</b>      | <b>99,05</b>                           |

## Event Driven - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag  | Wertpapierbezeichnung                    | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Schatzwechsel 28,65 % (31. Dezember 2023: 91,00 %)</b>       |  |        |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar</b>  |  |        |                       |                   |                              |
| 10.000.000  | United States Treasury Bill              | 0,00 % | 07.01.2025            | 9.994.323         | 3,52                         |
| 22.425.000  | United States Treasury Bill              | 0,00 % | 21.01.2025            | 22.374.809        | 7,89                         |
| 26.355.000  | United States Treasury Bill              | 0,00 % | 27.02.2025            | 26.182.507        | 9,22                         |
| 23.000.000  | United States Treasury Bill              | 0,00 % | 18.03.2025            | 22.800.784        | 8,02                         |
| <b>Schatzwechsel insgesamt **</b>                               |  |        |                       | <b>81.352.423</b> | <b>28,65</b>                 |
| <b>Unternehmensanleihen 68,94 % (31. Dezember 2023: 0,00 %)</b> |  |        |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar</b>  |  |        |                       |                   |                              |
| 5.400.000   | American Express Co**                    | 5,90 % | 30.10.2026            | 5.440.916         | 1,92                         |
| 2.369.000   | Amgen Inc**                              | 5,25 % | 02.03.2025            | 2.370.468         | 0,83                         |
| 4.715.000   | AT&T Inc*                                | 1,70 % | 25.03.2026            | 4.547.890         | 1,60                         |
| 5.100.000   | Bank of America Corp**                   | 1,20 % | 24.10.2026            | 4.956.430         | 1,75                         |
| 2.781.000   | Bank of America Corp*                    | 4,00 % | 22.01.2025            | 2.779.695         | 0,98                         |
| 2.356.000   | Bank of New York Mellon Corp*            | 3,00 % | 24.02.2025            | 2.350.373         | 0,83                         |
| 2.960.000   | Bristol-Myers Squibb Co**                | 4,96 % | 20.02.2026            | 2.967.781         | 1,04                         |
| 3.365.000   | Broadcom Inc**                           | 3,15 % | 15.11.2025            | 3.322.435         | 1,17                         |
| 2.525.000   | Capital One Financial Corp*              | 3,20 % | 05.02.2025            | 2.524.509         | 0,89                         |
| 2.195.000   | Capital One Financial Corp**             | 4,99 % | 24.07.2026            | 2.193.910         | 0,77                         |
| 6.835.000   | Caterpillar Financial Services Corp**    | 5,01 % | 14.05.2027            | 6.842.114         | 2,41                         |
| 7.645.000   | Citibank NA**                            | 5,19 % | 19.11.2027            | 7.660.881         | 2,70                         |
| 2.585.000   | Comcast Corp**                           | 3,38 % | 15.08.2025            | 2.563.545         | 0,90                         |
| 1.945.000   | Comcast Corp**                           | 3,95 % | 15.10.2025            | 1.935.657         | 0,68                         |
| 1.695.000   | Consolidated Edison Co of New York Inc** | 5,00 % | 18.11.2027            | 1.705.455         | 0,60                         |
| 2.560.000   | Corebridge Global Funding**              | 5,70 % | 25.09.2026            | 2.586.283         | 0,91                         |
| 2.590.000   | CVS Health Corp*                         | 3,88 % | 20.07.2025            | 2.574.152         | 0,91                         |
| 2.190.000   | Enbridge Energy Partners LP*             | 5,88 % | 15.10.2025            | 2.202.015         | 0,78                         |
| 2.181.000   | Fox Corp**                               | 3,05 % | 07.04.2025            | 2.170.818         | 0,76                         |
| 3.565.000   | General Electric Co**                    | 5,20 % | 05.05.2026            | 3.572.009         | 1,26                         |
| 4.000.000   | Georgia Power Co**                       | 5,26 % | 08.05.2025            | 4.008.812         | 1,41                         |
| 7.635.000   | Goldman Sachs Bank USA**                 | 5,22 % | 21.05.2027            | 7.654.863         | 2,70                         |
| 2.850.000   | Home Depot Inc**                         | 4,73 % | 24.12.2025            | 2.856.098         | 1,01                         |
| 3.800.000   | Intel Corp**                             | 3,40 % | 25.03.2025            | 3.787.274         | 1,33                         |
| 2.505.000   | John Deere Capital Corp**                | 4,89 % | 06.03.2026            | 2.508.330         | 0,88                         |
| 2.840.000   | John Deere Capital Corp**                | 5,04 % | 11.06.2027            | 2.849.496         | 1,00                         |
| 7.145.000   | JPMorgan Chase & Co**                    | 5,16 % | 22.09.2027            | 7.183.058         | 2,53                         |
| 480.000   | JPMorgan Chase & Co**                    | 5,49 % | 22.04.2027            | 482.252           | 0,17                         |
| 4.295.000   | Lowe's Cos Inc*                          | 4,00 % | 15.04.2025            | 4.286.718         | 1,51                         |
| 3.375.000   | Marsh & McLennan Cos Inc**               | 5,21 % | 08.11.2027            | 3.402.220         | 1,20                         |
| 7.635.000   | Morgan Stanley**                         | 5,43 % | 18.02.2026            | 7.643.614         | 2,69                         |

## Event Driven - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag  | Wertpapierbezeichnung                   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|---|---|--------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 68,94 % (31. Dezember 2023: 0,00 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>  |   |        |                       |                    |                              |
| 120.000   | Morgan Stanley Bank NA**                | 5,41 % | 16.07.2025            | 120.276            | 0,04                         |
| 3.085.000   | New York Life Global Funding**          | 5,03 % | 28.08.2026            | 3.097.532          | 1,09                         |
| 5.025.000   | NextEra Energy Capital Holdings Inc**   | 6,05 % | 01.03.2025            | 5.034.333          | 1,77                         |
| 2.265.000   | Pacific Gas & Electric Co**             | 3,45 % | 01.07.2025            | 2.247.742          | 0,79                         |
| 480.000   | Pacific Gas & Electric Co*              | 3,50 % | 15.06.2025            | 476.692            | 0,17                         |
| 1.500.000   | PepsiCo Inc**                           | 4,89 % | 13.02.2026            | 1.503.547          | 0,53                         |
| 3.000.000   | Pepsico Singapore Financing I Pte Ltd** | 5,04 % | 16.02.2027            | 3.012.006          | 1,06                         |
| 2.940.000   | Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd*  | 4,65 % | 19.05.2025            | 2.941.678          | 1,04                         |
| 5.210.000   | PNC Bank NA**                           | 4,87 % | 15.01.2027            | 5.212.959          | 1,84                         |
| 1.140.000   | Protective Life Global Funding**        | 5,38 % | 28.03.2025            | 1.142.215          | 0,40                         |
| 4.875.000   | Royal Bank of Canada**                  | 5,33 % | 18.10.2027            | 4.881.288          | 1,72                         |
| 2.489.000   | RTX Corp*                               | 3,95 % | 16.08.2025            | 2.478.115          | 0,87                         |
| 7.379.000   | Simon Property Group LP*                | 3,50 % | 01.09.2025            | 7.329.026          | 2,58                         |
| 2.885.000   | Spectra Energy Partners LP*             | 3,50 % | 15.03.2025            | 2.875.790          | 1,01                         |
| 4.805.000   | State Street Corp**                     | 5,17 % | 22.10.2027            | 4.817.885          | 1,70                         |
| 875.000   | State Street Corp**                     | 5,38 % | 03.08.2026            | 881.552            | 0,31                         |
| 5.275.000   | T-Mobile USA Inc*                       | 3,50 % | 15.04.2025            | 5.251.937          | 1,85                         |
| 1.300.000   | Toyota Motor Credit Corp**              | 5,10 % | 10.04.2026            | 1.300.898          | 0,46                         |
| 2.130.000   | Toyota Motor Credit Corp**              | 5,28 % | 07.08.2026            | 2.144.243          | 0,76                         |
| 4.085.000   | Truist Financial Corp*                  | 1,20 % | 05.08.2025            | 4.003.857          | 1,41                         |
| 1.475.000   | UBS Group AG**                          | 1,31 % | 02.02.2027            | 1.418.020          | 0,50                         |
| 2.910.000   | UBS Group AG**                          | 2,19 % | 05.06.2026            | 2.875.852          | 1,01                         |
| 3.659.000   | UniteHealth Group Inc**                 | 5,14 % | 15.07.2026            | 3.671.748          | 1,29                         |
| 3.500.000   | US Bank NA*                             | 2,05 % | 21.01.2025            | 3.494.826          | 1,23                         |
| 2.115.000   | US Bank NA**                            | 5,30 % | 22.10.2027            | 2.114.969          | 0,74                         |
| 7.445.000   | Wells Fargo Bank NA**                   | 5,49 % | 11.12.2026            | 7.529.543          | 2,65                         |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>   |   |        |                       | <b>195.788.600</b> | <b>68,94</b>                 |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  |   |        |                       | <b>277.141.023</b> | <b>97,59</b>                 |

### Devisenterminkontrakte 0,05 % (31. Dezember 2023: 3,21 %)

| Geforderter<br>Betrag           | Zu zahlender<br>Betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|---------------------------------|------------------------|-----------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------------|------------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> |                        |                       |                                |           |                                      |                              |
| 10.659 US\$                     | 10.194 €               | 16.01.2025            | State Street Bank and Trust Co | 1         | 97                                   | 0,00                         |
| 16.677 US\$                     | 15.912 €               | 16.01.2025            | Westpac Banking Corp           | 4         | 192                                  | 0,00                         |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> |                        |                       |                                |           |                                      |                              |
| 344.808 £                       | 431.473 US\$           | 16.01.2025            | Westpac Banking Corp           | 2         | 315                                  | 0,00                         |
| 2.828.475 US\$                  | 2.205.359 £            | 16.01.2025            | State Street Bank and Trust Co | 2         | 66.798                               | 0,02                         |
| 1.648.738 US\$                  | 1.269.693 £            | 16.01.2025            | Westpac Banking Corp           | 16        | 58.756                               | 0,02                         |

## Event Driven - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 0,05 % (31. Dezember 2023: 3,21 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen JPY</i>   |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 318.137 US\$  | 48.308.907 ¥        | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 2         | 10.266                         | 0,01                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                                |           | <b>136.424</b>                 | <b>0,05</b>          |

### Total Return Swap-Kontrakte 0,04 % (31. Dezember 2023: 0,76 %)

| Nominalwert  | Datum der Schließung | Variabler Zinssatz | Referenzunternehmen  | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|----------------------|--------------------|--|--------------------------------|----------------------|
| USD 40.000.000   | 28.10.2026           | 0,25 <sup>1</sup>  | Alphas Managed Accounts Platform CXIV Limited <sup>2</sup> | 139.204                        | 0,04                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Total Return Swap-Kontrakten <sup>∞</sup></b> |                      |                    |  | <b>139.204</b>                 | <b>0,04</b>          |

<sup>1</sup> Feste Finanzierungskosten.

<sup>2</sup> Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist Morgan Stanley.

|  |  |  |  | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens |
|--|--|--|--|--------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |  |  |  | <b>277.416.651</b> | <b>97,68</b>         |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (3,56 %) (31. Dezember 2023: (0,12 %))

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 345 €  | 378 US\$            | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (20)                            | (0,00)               |
| 1.727.347 €  | 1.815.023 US\$      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 8         | (25.407)                        | (0,01)               |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>  |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 141.643.008 £  | 185.597.483 US\$    | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 3         | (8.224.007)                     | (2,90)               |
| 39.925.026 £   | 50.884.076 US\$     | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 88        | (887.680)                       | (0,31)               |
| 1.755.040 US\$   | 1.402.478 £         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 1         | (1.223)                         | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen JPY</i>  |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 38.178.540 ¥   | 250.424 US\$        | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 2         | (7.114)                         | (0,00)               |
| 3.580.000.000 ¥  | 23.777.740 US\$     | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 2         | (962.520)                       | (0,34)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                                |           | <b>(10.107.971)</b>             | <b>(3,56)</b>        |

## Event Driven - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

**Total Return Swap-Kontrakte (0,18 %) (31. Dezember 2023: (0,00 %))**

|   | Nominalwert | Datum der Schließung | Variabler Zinssatz | Referenzunternehmen  | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|-------------|----------------------|--------------------|--|---------------------------------|----------------------|
| USD   | 199.648.592 | 28.10.2026           | 0,25 <sup>1</sup>  | Alphas Managed Accounts Platform CXIV Limited <sup>2</sup> | (527.124)                       | (0,18)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Total Return Swap-Kontrakten <sup>∞</sup></b> |             |                      |                    |  | <b>(527.124)</b>                | <b>(0,18)</b>        |

<sup>1</sup> Feste Finanzierungskosten.

<sup>2</sup> Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist Morgan Stanley.

|   | Zeitwert US\$       | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(10.635.095)</b> | <b>(3,74)</b>        |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>266.781.556</b>  | <b>93,94</b>         |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>17.215.135</b>   | <b>6,06</b>          |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>283.996.691</b>  | <b>100,00</b>        |

| Portfolioanalyse  | US\$               | % des Gesamtvermögens |
|---|--------------------|-----------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 50.117.273         | 16,50                 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden            | 227.023.750        | 74,73                 |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente   | (10.359.467)       | (3,41)                |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>266.781.556</b> | <b>87,82</b>          |

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung  | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Agency Bonds 0,87 % (31. Dezember 2023: 1,05 %)</b>                                     |  |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |  |        |                       |                  |                              |
| 370.000  | Federal Home Loan Banks*   | 5,50 % | 15.07.2036            | 393.891          | 0,39                         |
| 140.000  | Federal National Mortgage Association**                              | 0,75 % | 08.10.2027            | 127.090          | 0,12                         |
| 365.000  | Federal National Mortgage Association**                              | 0,88 % | 05.08.2030            | 301.545          | 0,30                         |
| 55.000   | Tennessee Valley Authority*  | 5,88 % | 01.04.2036            | 59.634           | 0,06                         |
| <b>Agency Bonds insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>882.160</b>   | <b>0,87</b>                  |
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 13,07 % (31. Dezember 2023: 9,99 %)</b> |  |        |                       |                  |                              |
| <b>Euro</b>  |  |        |                       |                  |                              |
| 509.955  | Clavel Residential 3 DAC Series 2023-1X Class A                      | 4,07 % | 28.01.2076            | 528.897          | 0,52                         |
| 80.349   | Dutch Property Finance BV Series 2022-2 Class A                      | 3,54 % | 28.04.2062            | 83.631           | 0,08                         |
| 600.000  | Italian Stella Loans SRL Series 2024-2 Class B                       | 3,81 % | 27.05.2039            | 622.462          | 0,61                         |
| 399.918  | Last Mile Securities - PE 2021 DAC Series 2021-1X Class A2           | 4,06 % | 17.08.2031            | 413.440          | 0,41                         |
| 61.087   | Red & Black Auto Italy SRL Series 2 Class A1                         | 3,86 % | 28.07.2034            | 63.642           | 0,06                         |
| 249.427  | Shamrock Residential 2023-1 DAC Series 2023-1X Class A               | 3,78 % | 24.06.2071            | 258.951          | 0,26                         |
| 344.205  | Stresa Securitisation SRL Series 1 Class A                           | 4,04 % | 22.12.2045            | 349.203          | 0,34                         |
| <b>Euro insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>2.320.226</b> | <b>2,28</b>                  |
| <b>Britisches Pfund</b>  |  |        |                       |                  |                              |
| 120.000  | Mortimer BTL 2021-1 Plc Series 2021-1 Class C                        | 6,18 % | 23.06.2053            | 150.362          | 0,15                         |
| 353.148  | Parkmore Point RMBS 2022-1 Plc Series 2022-1X Class A                | 6,23 % | 25.07.2045            | 443.993          | 0,43                         |
| 262.000  | Vantage Data Centers Jersey Borrower Spv Ltd Series 2024-1A Class A2 | 6,17 % | 28.05.2039            | 334.188          | 0,33                         |
| <b>Britisches Pfund insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>928.543</b>   | <b>0,91</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>   |  |        |                       |                  |                              |
| 184.000  | 1211 Avenue of the Americas Trust Series 2015-1211 Class A1A2        | 3,90 % | 10.08.2035            | 181.622          | 0,18                         |
| 290.000  | BANK 2017-BNK9 Class A4  | 3,54 % | 15.11.2054            | 278.658          | 0,27                         |
| 271.932  | BRAVO Series 2024-NQM6 Class A1                                      | 5,41 % | 01.08.2064            | 270.890          | 0,27                         |
| 56.000   | BXP Trust 2017-GM Class C  | 3,42 % | 13.06.2039            | 52.604           | 0,05                         |
| 238.941  | CD 2017-CD6 Mortgage Trust Class ASB                                 | 3,33 % | 13.11.2050            | 234.641          | 0,23                         |
| 259.692  | Chase Home Lending Mortgage Trust Series 2024-10 Class A4A           | 5,50 % | 25.10.2055            | 257.559          | 0,25                         |
| 263.000  | Chase Home Lending Mortgage Trust Series 2024-11 Class A4            | 6,00 % | 25.11.2055            | 264.383          | 0,26                         |
| 229.434  | COLT Mortgage Loan Trust 2024-2 Class A1                             | 6,13 % | 25.04.2069            | 230.842          | 0,23                         |
| 259.611  | COLT Mortgage Loan Trust 2024-INV2 Class A1                          | 6,42 % | 25.05.2069            | 262.697          | 0,26                         |
| 88.788   | COMM 2014-UBS3 Mortgage Trust Class XA                               | 0,44 % | 10.06.2047            | 1                | 0,00                         |
| 405.000  | Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R01 Class 1M2               | 6,47 % | 25.12.2041            | 411.056          | 0,40                         |
| 510.000  | Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R01 Class 1M2               | 8,31 % | 25.12.2042            | 544.897          | 0,54                         |
| 1.768.711  | CSAIL 2015-C2 Commercial Mortgage Trust Class XA                     | 0,67 % | 15.06.2057            | 1.609            | 0,00                         |
| 505.000  | CSAIL 2018-CX12 Commercial Mortgage Trust Class A4                   | 4,22 % | 15.08.2051            | 486.282          | 0,48                         |
| 99.136   | EFMT Series 2024-INV2 Class A3                                       | 5,44 % | 25.10.2069            | 98.048           | 0,10                         |

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung  | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|--|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 13,07 % (31. Dezember 2023: 9,99 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |        |                       |                   |                              |
| 47.959   | Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 2M2                       | 9,03 % | 25.05.2029            | 49.879            | 0,05                         |
| 484.745  | Fannie Mae REMICS Class HF   | 5,97 % | 25.12.2054            | 488.226           | 0,48                         |
| 306.570  | Fannie Mae REMICS Class PI   | 3,50 % | 25.12.2042            | 50.606            | 0,05                         |
| 458.575  | Freddie Mac REMICS Class FA  | 5,67 % | 25.11.2054            | 455.200           | 0,45                         |
| 512.941  | Freddie Mac REMICS Class HS  | 1,74 % | 15.03.2042            | 65.486            | 0,06                         |
| 550.000  | Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA3 Class M1B                        | 7,47 % | 25.04.2042            | 570.132           | 0,56                         |
| 137.236  | Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-HQA1 Class M1A                        | 6,67 % | 25.03.2042            | 138.306           | 0,14                         |
| 550.000  | Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-HQA1 Class M1B                        | 8,07 % | 25.03.2042            | 575.397           | 0,57                         |
| 321.539  | Freddie Mac Strips Class S1  | 1,24 % | 15.09.2043            | 29.777            | 0,03                         |
| 896.660  | Government National Mortgage Association Class AI                        | 2,00 % | 20.02.2051            | 108.720           | 0,11                         |
| 438.446  | Government National Mortgage Association Class IT                        | 3,50 % | 20.02.2043            | 71.221            | 0,07                         |
| 539.406  | Government National Mortgage Association Class LI                        | 4,00 % | 20.09.2051            | 105.765           | 0,10                         |
| 290.454  | Government National Mortgage Association Class NC                        | 1,50 % | 20.07.2051            | 233.950           | 0,23                         |
| 293.763  | Government National Mortgage Association Class WK                        | 1,00 % | 20.06.2050            | 218.751           | 0,21                         |
| 2.213.890  | GS Mortgage Securities Trust 2015-GC30 Class XA                          | 0,68 % | 10.05.2050            | 202               | 0,00                         |
| 180.000  | Hudson Yards 2016-10HY Mortgage Trust Class A                            | 2,84 % | 10.08.2038            | 173.253           | 0,17                         |
| 71.881   | JP Morgan Mortgage Trust 2023-HE3 Class A1                               | 6,20 % | 25.05.2054            | 72.539            | 0,07                         |
| 177.274  | JP Morgan Mortgage Trust 2024-HE1 Class A1                               | 6,10 % | 25.08.2054            | 178.412           | 0,18                         |
| 169.000  | MetroNet Infrastructure Issuer LLC Series 2024-1A Class A2               | 6,23 % | 20.04.2054            | 172.602           | 0,17                         |
| 160.000  | Morgan Stanley Capital I Trust 2017-H1 Class C                           | 4,28 % | 15.06.2050            | 142.957           | 0,14                         |
| 177.000  | Morgan Stanley Capital I Trust 2018-L1 Class AS                          | 4,64 % | 15.10.2051            | 171.589           | 0,17                         |
| 124.335  | Morgan Stanley Residential Mortgage Loan Trust Series 2024-NQM3 Class A3 | 5,40 % | 25.07.2069            | 123.305           | 0,12                         |
| 210.890  | New Residential Mortgage Loan Trust 2017-2A Class B1                     | 4,50 % | 25.03.2057            | 206.537           | 0,20                         |
| 262.924  | New Residential Mortgage Loan Trust 2024-RPL1 Class A                    | 3,80 % | 25.01.2064            | 244.737           | 0,24                         |
| 280.000  | New Residential Mortgage Loan Trust 2024-RTL2 Class A1                   | 5,44 % | 25.09.2039            | 276.435           | 0,27                         |
| 125.079  | OBX Trust Series 2024-NQM14 Class A3                                     | 5,35 % | 25.09.2064            | 123.547           | 0,12                         |
| 192.117  | OBX Trust Series 2024-NQM4 Class A1                                      | 6,07 % | 25.01.2064            | 193.236           | 0,19                         |
| 237.769  | OBX Trust Series 2024-NQM6 Class A1                                      | 6,45 % | 25.02.2064            | 240.322           | 0,24                         |
| 286.875  | Taco Bell Funding LLC Class A23  | 4,97 % | 25.05.2046            | 286.538           | 0,28                         |
| 276.000  | Trafigura Securitisation Finance Plc Series 2024-1A Class A2             | 5,98 % | 15.11.2027            | 279.951           | 0,27                         |
| 252.350  | Verus Securitization Trust 2024-4 Class A1                               | 6,22 % | 25.06.2069            | 254.448           | 0,25                         |
| 180.000  | Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-NXS6 Class B                  | 3,81 % | 15.11.2049            | 171.425           | 0,17                         |
| 67.929   | WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C21 Class XA                        | 0,50 % | 15.08.2047            | 135               | 0,00                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |  |        |                       | <b>10.049.375</b> | <b>9,88</b>                  |
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) insgesamt **</b>                                      |  |        |                       | <b>13.298.144</b> | <b>13,07</b>                 |
| <b>Unternehmensanleihen 30,91 % (31. Dezember 2023: 26,54 %)</b>   |  |        |                       |                   |                              |
| <b>Australischer Dollar</b>  |  |        |                       |                   |                              |
| 650.000  | Inter-American Development Bank <sup>†</sup>                             | 4,70 % | 03.10.2030            | 407.370           | 0,40                         |

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                        | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 30,91 % (31. Dezember 2023: 26,54 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                  |                              |
| <b>Australischer Dollar (Fortsetzung)</b>                                      |  |        |                       |                  |                              |
| 540.000  | International Finance Corp*                  | 4,90 % | 05.12.2034            | 334.334          | 0,33                         |
| <b>Australischer Dollar insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>741.704</b>   | <b>0,73</b>                  |
| <b>Dänische Krone</b>  |  |        |                       |                  |                              |
| 7.006.237  | Nykredit Realkredit AS*                      | 4,00 % | 01.10.2056            | 976.075          | 0,96                         |
| <b>Dänische Krone insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>976.075</b>   | <b>0,96</b>                  |
| <b>Euro</b>  |  |        |                       |                  |                              |
| 100.000  | ArcelorMittal SA*                            | 3,50 % | 13.12.2031            | 102.228          | 0,10                         |
| 100.000  | Arkema SA*                                   | 3,50 % | 12.09.2034            | 102.980          | 0,10                         |
| 206.000  | Athene Global Funding*                       | 0,37 % | 10.09.2026            | 205.539          | 0,20                         |
| 300.000  | AusNet Services Holdings Pty Ltd*            | 1,63 % | 11.03.2081            | 301.141          | 0,30                         |
| 200.000  | Balder Finland OYJ*                          | 2,00 % | 18.01.2031            | 186.197          | 0,18                         |
| 200.000  | Banco BPM SpA*                               | 3,88 % | 09.09.2030            | 211.101          | 0,21                         |
| 100.000  | Barclays Plc*                                | 3,94 % | 31.01.2036            | 104.360          | 0,10                         |
| 149.000  | Becton Dickinson & Co*                       | 3,83 % | 07.06.2032            | 158.895          | 0,16                         |
| 200.000  | BNP Paribas Home Loan SFH SA*                | 3,00 % | 25.05.2028            | 210.147          | 0,21                         |
| 100.000  | Booking Holdings Inc*                        | 3,88 % | 21.03.2045            | 102.979          | 0,10                         |
| 200.000  | BPCE SFH SA*                                 | 3,25 % | 12.04.2028            | 210.964          | 0,21                         |
| 160.000  | Canadian Imperial Bank of Commerce*          | 3,25 % | 31.03.2027            | 168.187          | 0,17                         |
| 100.000  | Comcast Corp*                                | 3,55 % | 26.09.2036            | 104.163          | 0,10                         |
| 100.000  | Crelan SA*                                   | 5,38 % | 30.04.2035            | 109.077          | 0,11                         |
| 300.000  | EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG*          | 1,88 % | 29.06.2080            | 304.521          | 0,30                         |
| 100.000  | Federation des Caisses Desjardins du Quebec* | 3,25 % | 18.04.2028            | 105.530          | 0,10                         |
| 200.000  | Heimstaden Bostad AB*                        | 1,13 % | 21.01.2026            | 202.295          | 0,20                         |
| 150.000  | Heimstaden Bostad Treasury BV*               | 1,38 % | 24.07.2028            | 143.391          | 0,14                         |
| 100.000  | ING Groep NV*                                | 2,00 % | 22.03.2030            | 103.483          | 0,10                         |
| 200.000  | Islandsbanki HF*                             | 4,63 % | 27.03.2028            | 215.256          | 0,21                         |
| 100.000  | JPMorgan Chase & Co*                         | 3,76 % | 21.03.2034            | 106.375          | 0,10                         |
| 200.000  | Landsbankinn HF*                             | 3,75 % | 08.10.2029            | 207.884          | 0,20                         |
| 100.000  | Landsbankinn HF*                             | 5,00 % | 13.05.2028            | 109.080          | 0,11                         |
| 100.000  | Linde Plc*                                   | 3,63 % | 12.06.2034            | 106.780          | 0,11                         |
| 119.000  | Medtronic Inc*                               | 4,15 % | 15.10.2053            | 128.503          | 0,13                         |
| 100.000  | Morgan Stanley*                              | 3,96 % | 21.03.2035            | 106.487          | 0,11                         |
| 200.000  | Motability Operations Group Plc*             | 4,00 % | 17.01.2030            | 215.459          | 0,21                         |
| 100.000  | MSD Netherlands Capital BV*                  | 3,75 % | 30.05.2054            | 102.356          | 0,10                         |
| 100.000  | Nordeutsche Landesbank-Girozentrale*         | 5,63 % | 23.08.2034            | 107.612          | 0,11                         |
| 143.000  | PVH Corp*                                    | 4,13 % | 16.07.2029            | 152.863          | 0,15                         |
| 204.000  | Southern Gas Networks Plc*                   | 3,50 % | 16.10.2030            | 211.563          | 0,21                         |
| 300.000  | Stedin Holding NV*                           | 1,50 % | 31.12.2149            | 298.224          | 0,29                         |

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung               | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|-------------------------------------|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 30,91 % (31. Dezember 2023: 26,54 %) (Fortsetzung)</b> |                                     |        |                       |                  |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |                                     |        |                       |                  |                              |
| 300.000  | Stellantis NV*                      | 4,00 % | 19.03.2034            | 309.877          | 0,30                         |
| 400.000  | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd*     | 4,09 % | 19.04.2028            | 429.520          | 0,42                         |
| 100.000  | Swisscom Finance BV*                | 3,63 % | 29.11.2036            | 105.663          | 0,10                         |
| 100.000  | TAG Immobilien AG*                  | 4,25 % | 04.03.2030            | 105.757          | 0,10                         |
| 100.000  | TenneT Holding BV*                  | 0,88 % | 16.06.2035            | 83.321           | 0,08                         |
| 196.000  | Timken Co*                          | 4,13 % | 23.05.2034            | 203.322          | 0,20                         |
| 280.000  | UBS Group AG*                       | 2,13 % | 13.10.2026            | 290.926          | 0,29                         |
| 100.000  | Verizon Communications Inc*         | 3,75 % | 28.02.2036            | 105.314          | 0,10                         |
| 100.000  | Virgin Money UK Plc*                | 4,00 % | 18.03.2028            | 106.112          | 0,10                         |
| 100.000  | Volkswagen Financial Services AG*   | 3,88 % | 19.11.2031            | 103.904          | 0,10                         |
| 300.000  | Warnermedia Holdings Inc*           | 4,69 % | 17.05.2033            | 311.066          | 0,31                         |
| 200.000  | Westpac Securities NZ Ltd*          | 3,75 % | 20.04.2028            | 213.735          | 0,21                         |
| <b>Euro insgesamt</b>  |                                     |        |                       | <b>7.574.137</b> | <b>7,44</b>                  |
| <b>Japanischer Yen</b>   |                                     |        |                       |                  |                              |
| 100.000.000  | Metropolitan Expressway Co Ltd†     | 0,52 % | 20.12.2028            | 627.904          | 0,62                         |
| <b>Japanischer Yen insgesamt</b>   |                                     |        |                       | <b>627.904</b>   | <b>0,62</b>                  |
| <b>Britisches Pfund</b>  |                                     |        |                       |                  |                              |
| 290.000  | AA Bond Co Ltd†                     | 6,85 % | 31.07.2031            | 371.671          | 0,37                         |
| 189.000  | Barclays Plc*                       | 5,85 % | 21.03.2035            | 238.902          | 0,23                         |
| 250.000  | BP Capital Markets Plc*             | 4,25 % | 31.12.2149            | 303.316          | 0,30                         |
| 100.000  | British Telecommunications Plc*     | 5,75 % | 13.02.2041            | 121.048          | 0,12                         |
| 100.000  | Hammerson Plc*                      | 5,88 % | 08.10.2036            | 120.776          | 0,12                         |
| 200.000  | Pension Insurance Corp Plc*         | 8,00 % | 13.11.2033            | 269.512          | 0,26                         |
| 200.000  | Rothsay Life Plc*                   | 7,02 % | 10.12.2034            | 257.054          | 0,25                         |
| 100.000  | Severn Trent Utilities Finance Plc* | 5,88 % | 31.07.2038            | 127.080          | 0,12                         |
| 100.000  | Volkswagen Financial Services NV*   | 6,50 % | 18.09.2027            | 128.051          | 0,13                         |
| 200.000  | Wessex Water Services Finance Plc*  | 1,50 % | 17.09.2029            | 210.186          | 0,21                         |
| <b>Britisches Pfund insgesamt</b>  |                                     |        |                       | <b>2.147.596</b> | <b>2,11</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>   |                                     |        |                       |                  |                              |
| 555.000  | AbbVie Inc*                         | 2,95 % | 21.11.2026            | 539.404          | 0,53                         |
| 53.000   | AbbVie Inc*                         | 4,05 % | 21.11.2039            | 45.316           | 0,04                         |
| 125.000  | AbbVie Inc*                         | 4,95 % | 15.03.2031            | 125.008          | 0,12                         |
| 330.000  | African Development Bank*           | 3,50 % | 18.09.2029            | 316.861          | 0,31                         |
| 295.000  | Ally Financial Inc**                | 6,18 % | 26.07.2035            | 291.780          | 0,29                         |
| 175.000  | Amgen Inc**                         | 5,65 % | 02.03.2053            | 168.613          | 0,17                         |
| 175.000  | AppLovin Corp**                     | 5,13 % | 01.12.2029            | 174.642          | 0,17                         |
| 145.000  | AppLovin Corp**                     | 5,38 % | 01.12.2031            | 145.106          | 0,14                         |

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung             | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|-----------------------------------|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 30,91 % (31. Dezember 2023: 26,54 %) (Fortsetzung)</b> |                                   |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |                                   |        |                       |                  |                              |
| 550.000  | AppLovin Corp**                   | 5,50 % | 01.12.2034            | 546.250          | 0,54                         |
| 25.000   | Arthur J Gallagher & Co*          | 4,85 % | 15.12.2029            | 24.897           | 0,02                         |
| 175.000  | Arthur J Gallagher & Co*          | 5,15 % | 15.02.2035            | 170.707          | 0,17                         |
| 65.000   | Arthur J Gallagher & Co*          | 5,55 % | 15.02.2055            | 62.465           | 0,06                         |
| 210.000  | AT&T Inc**                        | 3,50 % | 15.09.2053            | 141.536          | 0,14                         |
| 115.000  | AT&T Inc*                         | 3,65 % | 01.06.2051            | 81.291           | 0,08                         |
| 100.000  | AT&T Inc*                         | 3,80 % | 01.12.2057            | 69.079           | 0,07                         |
| 70.000   | AT&T Inc*                         | 3,85 % | 01.06.2060            | 48.557           | 0,05                         |
| 200.000  | Banco Santander SA*               | 6,92 % | 08.08.2033            | 210.026          | 0,21                         |
| 290.000  | Bank of America Corp**            | 5,75 % | 15.09.2027            | 293.806          | 0,29                         |
| 445.000  | Boeing Co*                        | 5,04 % | 01.05.2027            | 446.328          | 0,44                         |
| 275.000  | BPCE SA**                         | 5,94 % | 30.05.2035            | 272.698          | 0,27                         |
| 27.000   | Broadcom Inc**                    | 3,15 % | 15.11.2025            | 26.658           | 0,03                         |
| 360.000  | Broadcom Inc**                    | 3,19 % | 15.11.2036            | 290.147          | 0,29                         |
| 220.000  | Broadcom Inc**                    | 3,42 % | 15.04.2033            | 192.683          | 0,19                         |
| 135.000  | Broadcom Inc**                    | 5,05 % | 12.07.2029            | 135.557          | 0,13                         |
| 115.000  | Broadcom Inc**                    | 5,15 % | 15.11.2031            | 115.777          | 0,11                         |
| 180.000  | Bunge Ltd Finance Corp*           | 4,20 % | 17.09.2029            | 174.741          | 0,17                         |
| 165.000  | Bunge Ltd Finance Corp*           | 4,65 % | 17.09.2034            | 155.833          | 0,15                         |
| 95.000   | Cadence Design Systems Inc**      | 4,30 % | 10.09.2029            | 93.152           | 0,09                         |
| 225.000  | Cadence Design Systems Inc**      | 4,70 % | 10.09.2034            | 215.825          | 0,21                         |
| 205.000  | CDW LLC/CDW Finance Corp**        | 2,67 % | 01.12.2026            | 196.766          | 0,19                         |
| 180.000  | Cigna Group*                      | 5,60 % | 15.02.2054            | 168.726          | 0,17                         |
| 95.000   | Citigroup Inc**                   | 3,89 % | 10.01.2028            | 93.146           | 0,09                         |
| 385.000  | Corp Andina de Fomento*           | 2,25 % | 08.02.2027            | 366.394          | 0,36                         |
| 200.000  | Corp Nacional del Cobre de Chile* | 5,95 % | 08.01.2034            | 198.789          | 0,20                         |
| 60.000   | Crown Castle Inc*                 | 1,05 % | 15.07.2026            | 56.728           | 0,06                         |
| 120.000  | CVS Health Corp*                  | 3,00 % | 15.08.2026            | 116.341          | 0,11                         |
| 60.000   | CVS Health Corp**                 | 7,00 % | 10.03.2055            | 60.351           | 0,06                         |
| 305.000  | Dell International LLC/EMC Corp*  | 4,85 % | 01.02.2035            | 289.750          | 0,28                         |
| 215.000  | Deutsche Bank AG**                | 5,40 % | 11.09.2035            | 203.845          | 0,20                         |
| 115.000  | Diamondback Energy Inc**          | 4,25 % | 15.03.2052            | 86.815           | 0,09                         |
| 110.000  | Diamondback Energy Inc**          | 5,15 % | 30.01.2030            | 110.273          | 0,11                         |
| 70.000   | Diamondback Energy Inc**          | 5,20 % | 18.04.2027            | 70.683           | 0,07                         |
| 135.000  | Diamondback Energy Inc**          | 5,75 % | 18.04.2054            | 126.801          | 0,12                         |
| 115.000  | Diamondback Energy Inc**          | 5,90 % | 18.04.2064            | 108.062          | 0,11                         |
| 110.000  | DTE Energy Co*                    | 1,05 % | 01.06.2025            | 108.321          | 0,11                         |
| 140.000  | DTE Energy Co*                    | 4,95 % | 01.07.2027            | 140.559          | 0,14                         |
| 65.000   | Eastern Energy Gas Holdings LLC*  | 5,65 % | 15.10.2054            | 61.373           | 0,06                         |
| 105.000  | Elevance Health Inc*              | 5,85 % | 01.11.2064            | 101.382          | 0,10                         |

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                            | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 30,91 % (31. Dezember 2023: 26,54 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |        |                       |                  |                              |
| 20.000   | Enbridge Inc <sup>*</sup>                        | 5,30 % | 05.04.2029            | 20.212           | 0,02                         |
| 135.000  | Enbridge Inc <sup>*</sup>                        | 5,63 % | 05.04.2034            | 135.871          | 0,13                         |
| 225.000  | Energy Transfer LP <sup>*</sup>                  | 5,95 % | 15.05.2054            | 217.659          | 0,21                         |
| 465.000  | Enterprise Products Operating LLC <sup>*</sup>   | 4,95 % | 15.02.2035            | 450.222          | 0,44                         |
| 85.000   | EOG Resources Inc <sup>*</sup>                   | 5,65 % | 01.12.2054            | 83.315           | 0,08                         |
| 500.000  | Foundry JV Holdco LLC <sup>**</sup>              | 6,25 % | 25.01.2035            | 503.832          | 0,50                         |
| 35.000   | GE HealthCare Technologies Inc <sup>**</sup>     | 4,80 % | 14.08.2029            | 34.685           | 0,03                         |
| 140.000  | General Motors Co <sup>*</sup>                   | 6,80 % | 01.10.2027            | 146.277          | 0,14                         |
| 235.000  | Gilead Sciences Inc <sup>**</sup>                | 5,50 % | 15.11.2054            | 228.753          | 0,23                         |
| 280.000  | HCA Inc <sup>*</sup>                             | 3,50 % | 15.07.2051            | 181.262          | 0,18                         |
| 75.000   | HCA Inc <sup>*</sup>                             | 5,45 % | 01.04.2031            | 74.877           | 0,07                         |
| 135.000  | Indianapolis Power & Light Co <sup>**</sup>      | 5,70 % | 01.04.2054            | 133.013          | 0,13                         |
| 45.000   | Intel Corp <sup>**</sup>                         | 3,25 % | 15.11.2049            | 26.885           | 0,03                         |
| 335.000  | Intel Corp <sup>**</sup>                         | 4,75 % | 25.03.2050            | 259.265          | 0,26                         |
| 77.000   | Intel Corp <sup>**</sup>                         | 4,90 % | 05.08.2052            | 60.843           | 0,06                         |
| 35.000   | Intel Corp <sup>**</sup>                         | 5,90 % | 10.02.2063            | 31.605           | 0,03                         |
| 610.000  | Inter-American Development Bank <sup>*</sup>     | 1,13 % | 13.01.2031            | 500.287          | 0,49                         |
| 60.000   | Jersey Central Power & Light Co <sup>**</sup>    | 5,10 % | 15.01.2035            | 58.555           | 0,06                         |
| 275.000  | Lloyds Banking Group Plc <sup>*</sup>            | 5,59 % | 26.11.2035            | 272.793          | 0,27                         |
| 415.000  | Marathon Petroleum Corp <sup>**</sup>            | 4,70 % | 01.05.2025            | 414.601          | 0,41                         |
| 120.000  | Meta Platforms Inc <sup>**</sup>                 | 5,40 % | 15.08.2054            | 116.312          | 0,11                         |
| 205.000  | Meta Platforms Inc <sup>**</sup>                 | 5,55 % | 15.08.2064            | 200.017          | 0,20                         |
| 160.000  | Morgan Stanley <sup>*</sup>                      | 3,63 % | 20.01.2027            | 157.117          | 0,15                         |
| 90.000   | Morgan Stanley <sup>**</sup>                     | 5,42 % | 21.07.2034            | 89.414           | 0,09                         |
| 105.000  | Morgan Stanley <sup>**</sup>                     | 5,52 % | 19.11.2055            | 101.281          | 0,10                         |
| 125.000  | Morgan Stanley <sup>**</sup>                     | 5,83 % | 19.04.2035            | 127.437          | 0,13                         |
| 95.000   | NextEra Energy Capital Holdings Inc <sup>*</sup> | 4,90 % | 28.02.2028            | 95.158           | 0,09                         |
| 340.000  | Nordic Investment Bank <sup>*</sup>              | 4,25 % | 28.02.2029            | 337.215          | 0,33                         |
| 110.000  | Occidental Petroleum Corp <sup>*</sup>           | 5,20 % | 01.08.2029            | 109.212          | 0,11                         |
| 104.000  | Occidental Petroleum Corp <sup>*</sup>           | 6,13 % | 01.01.2031            | 106.485          | 0,10                         |
| 65.000   | Occidental Petroleum Corp <sup>**</sup>          | 6,45 % | 15.09.2036            | 66.588           | 0,07                         |
| 185.000  | ONEOK Inc <sup>*</sup>                           | 5,70 % | 01.11.2054            | 174.120          | 0,17                         |
| 140.000  | Oracle Corp <sup>*</sup>                         | 3,60 % | 01.04.2050            | 98.166           | 0,10                         |
| 65.000   | Otis Worldwide Corp <sup>*</sup>                 | 5,13 % | 19.11.2031            | 65.062           | 0,06                         |
| 220.000  | Pacific Gas & Electric Co <sup>**</sup>          | 4,95 % | 01.07.2050            | 191.302          | 0,19                         |
| 110.000  | Pacific Gas & Electric Co <sup>**</sup>          | 6,40 % | 15.06.2033            | 116.014          | 0,11                         |
| 145.000  | Pacific Gas & Electric Co <sup>*</sup>           | 6,95 % | 15.03.2034            | 158.899          | 0,16                         |
| 105.000  | Phillips 66 <sup>*</sup>                         | 1,30 % | 15.02.2026            | 101.219          | 0,10                         |
| 145.000  | Public Service Co of Oklahoma <sup>**</sup>      | 5,20 % | 15.01.2035            | 140.475          | 0,14                         |
| 55.000   | Santander Holdings USA Inc <sup>**</sup>         | 6,12 % | 31.05.2027            | 55.819           | 0,06                         |

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                              | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 30,91 % (31. Dezember 2023: 26,54 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |        |                       |                   |                              |
| 190.000  | Santander Holdings USA Inc**                       | 6,34 % | 31.05.2035            | 192.647           | 0,19                         |
| 255.000  | Societe Generale SA**                              | 1,49 % | 14.12.2026            | 246.161           | 0,24                         |
| 175.000  | Solventum Corp**                                   | 5,60 % | 23.03.2034            | 174.213           | 0,17                         |
| 240.000  | Solventum Corp**                                   | 6,00 % | 15.05.2064            | 234.281           | 0,23                         |
| 127.000  | Tampa Electric Co**                                | 4,90 % | 01.03.2029            | 126.970           | 0,12                         |
| 100.000  | The Campbell's Co**                                | 4,75 % | 23.03.2035            | 94.345            | 0,09                         |
| 165.000  | T-Mobile USA Inc*                                  | 2,55 % | 15.02.2031            | 141.994           | 0,14                         |
| 190.000  | T-Mobile USA Inc**                                 | 3,38 % | 15.04.2029            | 177.477           | 0,17                         |
| 85.000   | TotalEnergies Capital SA*                          | 5,15 % | 05.04.2034            | 84.675            | 0,08                         |
| 120.000  | TotalEnergies Capital SA*                          | 5,49 % | 05.04.2054            | 115.121           | 0,11                         |
| 80.000   | TotalEnergies Capital SA*                          | 5,64 % | 05.04.2064            | 76.538            | 0,08                         |
| 180.000  | Truist Financial Corp**                            | 5,71 % | 24.01.2035            | 181.462           | 0,18                         |
| 175.000  | Uber Technologies Inc*                             | 4,80 % | 15.09.2034            | 167.630           | 0,16                         |
| 45.000   | Uber Technologies Inc*                             | 5,35 % | 15.09.2054            | 41.884            | 0,04                         |
| 200.000  | UBS AG**   | 5,65 % | 11.09.2028            | 204.679           | 0,20                         |
| 200.000  | UnitedHealth Group Inc*                            | 4,50 % | 15.04.2033            | 189.819           | 0,19                         |
| 225.000  | UnitedHealth Group Inc*                            | 5,63 % | 15.07.2054            | 218.563           | 0,21                         |
| 105.000  | Verizon Communications Inc*                        | 4,86 % | 21.08.2046            | 93.805            | 0,09                         |
| 120.000  | Verizon Communications Inc*                        | 5,05 % | 09.05.2033            | 118.681           | 0,12                         |
| 50.000   | Verizon Communications Inc*                        | 5,50 % | 23.02.2054            | 47.894            | 0,05                         |
| 175.000  | Vodafone Group Plc**                               | 5,75 % | 28.06.2054            | 168.945           | 0,17                         |
| 110.000  | Vodafone Group Plc**                               | 5,88 % | 28.06.2064            | 106.536           | 0,10                         |
| 55.000   | Vulcan Materials Co*                               | 4,95 % | 01.12.2029            | 54.849            | 0,05                         |
| 50.000   | Vulcan Materials Co*                               | 5,70 % | 01.12.2054            | 48.594            | 0,05                         |
| 1.205.000  | Warnermedia Holdings Inc**                         | 5,05 % | 15.03.2042            | 968.063           | 0,95                         |
| 215.000  | Wells Fargo & Co**                                 | 5,21 % | 03.12.2035            | 209.282           | 0,21                         |
| 215.000  | Wells Fargo & Co**                                 | 5,50 % | 23.01.2035            | 214.192           | 0,21                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |  |        |                       | <b>19.381.272</b> | <b>19,05</b>                 |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>31.448.688</b> | <b>30,91</b>                 |
| <b>Staatsanleihen 31,59 % (31. Dezember 2023: 39,07 %)</b>                     |  |        |                       |                   |                              |
| <b>Australischer Dollar</b>  |  |        |                       |                   |                              |
| 404.000  | New Zealand Local Government Funding Agency Bond** | 5,00 % | 08.03.2034            | 248.886           | 0,24                         |
| 650.000  | New Zealand Local Government Funding Agency Bond** | 5,10 % | 28.11.2030            | 409.985           | 0,40                         |
| 481.000  | Queensland Treasury Corp*                          | 4,50 % | 09.03.2033            | 290.646           | 0,29                         |
| 373.000  | Queensland Treasury Corp*                          | 5,25 % | 21.07.2036            | 229.929           | 0,23                         |
| 185.000  | South Australian Government Financing Authority*   | 1,75 % | 24.05.2034            | 86.211            | 0,08                         |
| 333.000  | Treasury Corp of Victoria*                         | 5,25 % | 15.09.2038            | 200.754           | 0,20                         |
| 253.000  | Western Australian Treasury Corp**                 | 4,50 % | 21.07.2032            | 154.787           | 0,15                         |
| <b>Australischer Dollar insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>1.621.198</b>  | <b>1,59</b>                  |

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                     | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|---|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 31,59 % (31. Dezember 2023: 39,07 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                   |                              |
| <b>Kanadischer Dollar</b>  |   |        |                       |                   |                              |
| 418.000  | City of Toronto Canada**                  | 4,25 % | 11.07.2033            | 301.075           | 0,29                         |
| 900.000  | City of Toronto Canada**                  | 4,25 % | 29.07.2034            | 642.716           | 0,63                         |
| 700.000  | Province of Ontario Canada**              | 4,15 % | 02.12.2054            | 485.106           | 0,48                         |
| 1.200.000  | PSP Capital Inc**                         | 3,75 % | 15.06.2029            | 853.064           | 0,84                         |
| <b>Kanadischer Dollar insgesamt</b>                                      |   |        |                       | <b>2.281.961</b>  | <b>2,24</b>                  |
| <b>Euro</b>  |   |        |                       |                   |                              |
| 526.991  | Bundesobligation*                         | 2,10 % | 12.04.2029            | 547.721           | 0,54                         |
| 2.459.595  | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe* | 2,20 % | 15.02.2034            | 2.529.067         | 2,48                         |
| 500.000  | Estonia Government International Bond*    | 3,25 % | 17.01.2034            | 525.094           | 0,52                         |
| 430.000  | European Union*                           | 3,38 % | 04.10.2038            | 457.223           | 0,45                         |
| 757.000  | French Republic Government Bond OAT*      | 0,75 % | 25.05.2028            | 740.416           | 0,73                         |
| 344.311  | French Republic Government Bond OAT*      | 0,75 % | 25.05.2052            | 180.519           | 0,18                         |
| 251.071  | French Republic Government Bond OAT**     | 4,50 % | 25.04.2041            | 292.239           | 0,29                         |
| 218.000  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**       | 3,45 % | 01.03.2048            | 208.356           | 0,20                         |
| 200.000  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**       | 3,85 % | 01.07.2034            | 214.764           | 0,21                         |
| 1.232.562  | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT*        | 2,13 % | 17.10.2028            | 1.278.900         | 1,26                         |
| 1.200.000  | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT**       | 2,88 % | 20.10.2034            | 1.250.011         | 1,23                         |
| 296.000  | Spain Government Bond*                    | 2,70 % | 31.10.2048            | 263.456           | 0,26                         |
| 308.000  | Spain Government Bond*                    | 3,15 % | 30.04.2033            | 325.956           | 0,32                         |
| 1.331.000  | Spain Government Bond*                    | 3,25 % | 30.04.2034            | 1.408.558         | 1,38                         |
| 1.266.000  | Spain Government Bond*                    | 3,45 % | 31.10.2034            | 1.357.976         | 1,33                         |
| 517.000  | Spain Government Bond*                    | 5,15 % | 31.10.2028            | 588.124           | 0,58                         |
| <b>Euro insgesamt</b>  |   |        |                       | <b>12.168.380</b> | <b>11,96</b>                 |
| <b>Japanischer Yen</b>   |   |        |                       |                   |                              |
| 52.350.000   | Japan Government Five Year Bond*          | 0,01 % | 20.09.2026            | 329.927           | 0,32                         |
| 172.200.000  | Japan Government Five Year Bond*          | 0,50 % | 20.06.2029            | 1.084.969         | 1,07                         |
| 78.500.000   | Japan Government Forty Year Bond*         | 0,40 % | 20.03.2056            | 291.665           | 0,29                         |
| 23.800.000   | Japan Government Forty Year Bond*         | 1,00 % | 20.03.2062            | 98.059            | 0,10                         |
| 304.700.000  | Japan Government Ten Year Bond*           | 0,50 % | 20.03.2033            | 1.871.742         | 1,84                         |
| 163.050.000  | Japan Government Thirty Year Bond*        | 0,70 % | 20.12.2048            | 773.301           | 0,76                         |
| 36.000.000   | Japan Government Thirty Year Bond*        | 2,50 % | 20.03.2036            | 259.423           | 0,25                         |
| 76.850.000   | Japan Government Twenty Year Bond*        | 0,40 % | 20.03.2039            | 420.308           | 0,41                         |
| 139.500.000  | Japan Government Twenty Year Bond*        | 0,50 % | 20.09.2041            | 733.832           | 0,72                         |
| 37.700.000   | Japan Government Twenty Year Bond*        | 1,10 % | 20.03.2043            | 214.240           | 0,21                         |
| <b>Japanischer Yen insgesamt</b>   |   |        |                       | <b>6.077.466</b>  | <b>5,97</b>                  |

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                             | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 31,59 % (31. Dezember 2023: 39,07 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>Mexikanischer Peso</b>  |   |        |                       |                  |                              |
| 5.200.000  | Mexican Bonos*                                    | 7,50 % | 26.05.2033            | 211.544          | 0,21                         |
| <b>Mexikanischer Peso insgesamt</b>                                      |   |        |                       | <b>211.544</b>   | <b>0,21</b>                  |
| <b>Neuseeländischer Dollar</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 747.000  | New Zealand Government Bond*                      | 4,25 % | 15.05.2034            | 412.273          | 0,40                         |
| 400.000  | New Zealand Local Government Funding Agency Bond* | 4,50 % | 14.05.2032            | 221.826          | 0,22                         |
| <b>Neuseeländischer Dollar insgesamt</b>                                 |   |        |                       | <b>634.099</b>   | <b>0,62</b>                  |
| <b>Polnischer Zloty</b>  |   |        |                       |                  |                              |
| 1.122.000  | Republic of Poland Government Bond*               | 6,00 % | 25.10.2033            | 276.025          | 0,27                         |
| <b>Polnischer Zloty insgesamt</b>  |   |        |                       | <b>276.025</b>   | <b>0,27</b>                  |
| <b>Britisches Pfund</b>  |   |        |                       |                  |                              |
| 500.000  | United Kingdom Gilt*                              | 0,50 % | 31.01.2029            | 539.873          | 0,53                         |
| 275.500  | United Kingdom Gilt*                              | 0,50 % | 22.10.2061            | 96.464           | 0,09                         |
| 615.000  | United Kingdom Gilt*                              | 0,63 % | 22.10.2050            | 286.286          | 0,28                         |
| 93.000   | United Kingdom Gilt*                              | 1,25 % | 22.10.2041            | 67.949           | 0,07                         |
| 200.000  | United Kingdom Gilt*                              | 3,50 % | 22.01.2045            | 201.231          | 0,20                         |
| 125.732  | United Kingdom Gilt*                              | 3,75 % | 22.10.2053            | 124.620          | 0,12                         |
| 1.000.000  | United Kingdom Gilt*                              | 4,63 % | 31.01.2034            | 1.256.848        | 1,24                         |
| <b>Britisches Pfund insgesamt</b>  |   |        |                       | <b>2.573.271</b> | <b>2,53</b>                  |
| <b>Singapur-Dollar</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 300.000  | Singapore Government Bond*                        | 2,25 % | 01.08.2036            | 206.342          | 0,20                         |
| <b>Singapur-Dollar insgesamt</b>   |   |        |                       | <b>206.342</b>   | <b>0,20</b>                  |
| <b>Südkoreanischer Won</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 524.340.000  | Korea Treasury Bond*                              | 2,13 % | 10.06.2027            | 351.663          | 0,35                         |
| 950.550.000  | Korea Treasury Bond*                              | 2,38 % | 10.12.2031            | 620.947          | 0,61                         |
| 880.110.000  | Korea Treasury Bond*                              | 2,50 % | 10.03.2052            | 563.834          | 0,55                         |
| 937.540.000  | Korea Treasury Bond*                              | 3,25 % | 10.03.2028            | 648.492          | 0,64                         |
| <b>Südkoreanischer Won insgesamt</b>                                     |   |        |                       | <b>2.184.936</b> | <b>2,15</b>                  |
| <b>Schweizer Franken</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 300.000  | Swiss Confederation Government Bond*              | 1,50 % | 26.10.2038            | 381.832          | 0,38                         |
| <b>Schweizer Franken insgesamt</b>                                       |   |        |                       | <b>381.832</b>   | <b>0,38</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 300.000  | Indonesia Government International Bond*          | 3,55 % | 31.03.2032            | 269.083          | 0,27                         |
| 90.000   | Japan Bank for International Corp*                | 4,63 % | 19.07.2028            | 90.278           | 0,09                         |

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|---|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 31,59 % (31. Dezember 2023: 39,07 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |        |                       |                   |                              |
| 201.000  | Mexico Government International Bond**  | 6,00 % | 07.05.2036            | 189.650           | 0,19                         |
| 750.000  | Province of Manitoba Canada**           | 4,90 % | 31.05.2034            | 747.167           | 0,73                         |
| 230.000  | Province of Quebec Canada*              | 4,25 % | 05.09.2034            | 217.806           | 0,21                         |
| 200.000  | Romanian Government International Bond* | 3,00 % | 14.02.2031            | 162.080           | 0,16                         |
| 400.000  | Saudi Government International Bond*    | 5,00 % | 18.01.2053            | 338.715           | 0,33                         |
| 800.000  | Sweden Government International Bond*   | 4,38 % | 30.01.2026            | 799.480           | 0,79                         |
| 30.000   | United States Treasury Note/Bond*       | 3,88 % | 15.08.2034            | 28.375            | 0,03                         |
| 260.000  | United States Treasury Note/Bond*       | 4,25 % | 15.11.2034            | 253.244           | 0,25                         |
| 435.000  | United States Treasury Note/Bond*       | 4,38 % | 15.05.2034            | 428.449           | 0,42                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |   |        |                       | <b>3.524.327</b>  | <b>3,47</b>                  |
| <b>Staatsanleihen insgesamt</b>  |   |        |                       | <b>32.141.381</b> | <b>31,59</b>                 |
| <b>Mortgage-Backed Securities 17,84 % (31. Dezember 2023: 20,82 %)</b>   |   |        |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |   |        |                       |                   |                              |
| 36.712   | Fannie Mae Pool                         | 2,00 % | 01.12.2050            | 28.646            | 0,03                         |
| 292.056  | Fannie Mae Pool                         | 2,00 % | 01.02.2051            | 230.491           | 0,23                         |
| 132.676  | Fannie Mae Pool                         | 2,00 % | 01.04.2051            | 104.124           | 0,10                         |
| 69.951   | Fannie Mae Pool                         | 2,00 % | 01.05.2051            | 55.221            | 0,05                         |
| 70.411   | Fannie Mae Pool                         | 2,50 % | 01.07.2050            | 58.159            | 0,06                         |
| 205.868  | Fannie Mae Pool                         | 2,50 % | 01.08.2050            | 170.651           | 0,17                         |
| 116.453  | Fannie Mae Pool                         | 2,50 % | 01.09.2050            | 96.081            | 0,09                         |
| 460.913  | Fannie Mae Pool                         | 2,50 % | 01.01.2051            | 378.403           | 0,37                         |
| 617.464  | Fannie Mae Pool                         | 2,50 % | 01.05.2051            | 513.422           | 0,50                         |
| 674.170  | Fannie Mae Pool                         | 2,50 % | 01.06.2051            | 554.297           | 0,54                         |
| 399.657  | Fannie Mae Pool                         | 2,50 % | 01.08.2051            | 331.792           | 0,33                         |
| 339.355  | Fannie Mae Pool                         | 2,50 % | 01.09.2051            | 279.561           | 0,27                         |
| 42.720   | Fannie Mae Pool                         | 2,50 % | 01.04.2052            | 34.968            | 0,03                         |
| 393.227  | Fannie Mae Pool                         | 2,50 % | 01.09.2052            | 323.363           | 0,32                         |
| 132.067  | Fannie Mae Pool                         | 3,00 % | 01.12.2047            | 114.809           | 0,11                         |
| 134.820  | Fannie Mae Pool                         | 3,00 % | 01.11.2048            | 116.941           | 0,11                         |
| 138.910  | Fannie Mae Pool                         | 3,00 % | 01.02.2049            | 121.587           | 0,12                         |
| 124.477  | Fannie Mae Pool                         | 3,00 % | 01.03.2050            | 107.237           | 0,11                         |
| 123.650  | Fannie Mae Pool                         | 3,00 % | 01.04.2050            | 106.813           | 0,10                         |
| 77.848   | Fannie Mae Pool                         | 3,00 % | 01.04.2051            | 66.849            | 0,07                         |
| 138.115  | Fannie Mae Pool                         | 3,00 % | 01.05.2052            | 117.678           | 0,12                         |
| 42.129   | Fannie Mae Pool                         | 3,50 % | 01.12.2041            | 38.408            | 0,04                         |
| 20.134   | Fannie Mae Pool                         | 3,50 % | 01.04.2042            | 18.354            | 0,02                         |
| 26.546   | Fannie Mae Pool                         | 3,50 % | 01.05.2042            | 24.198            | 0,02                         |
| 35.849   | Fannie Mae Pool                         | 3,50 % | 01.01.2043            | 32.642            | 0,03                         |
| 20.909   | Fannie Mae Pool                         | 3,50 % | 01.06.2047            | 18.774            | 0,02                         |

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|-----------------------|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Mortgage-Backed Securities 17,84 % (31. Dezember 2023: 20,82 %) (Fortsetzung)</b> |                       |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |                       |        |                       |                  |                              |
| 124.035  | Fannie Mae Pool       | 3,50 % | 01.02.2048            | 111.369          | 0,11                         |
| 79.554   | Fannie Mae Pool       | 3,50 % | 01.08.2051            | 70.965           | 0,07                         |
| 19.247   | Fannie Mae Pool       | 4,00 % | 01.12.2040            | 18.167           | 0,02                         |
| 67.771   | Fannie Mae Pool       | 4,00 % | 01.12.2041            | 64.408           | 0,06                         |
| 111.894  | Fannie Mae Pool       | 4,00 % | 01.03.2049            | 103.779          | 0,10                         |
| 11.733   | Fannie Mae Pool       | 4,50 % | 01.03.2036            | 11.205           | 0,01                         |
| 56.284   | Fannie Mae Pool       | 4,50 % | 01.04.2041            | 54.589           | 0,05                         |
| 11.272   | Fannie Mae Pool       | 4,50 % | 01.09.2043            | 10.835           | 0,01                         |
| 8.533  | Fannie Mae Pool       | 4,50 % | 01.12.2043            | 8.202            | 0,01                         |
| 21.431   | Fannie Mae Pool       | 4,50 % | 01.05.2044            | 20.497           | 0,02                         |
| 6.183  | Fannie Mae Pool       | 4,50 % | 01.03.2047            | 5.923            | 0,01                         |
| 63.175   | Fannie Mae Pool       | 4,50 % | 01.07.2047            | 60.509           | 0,06                         |
| 67.016   | Fannie Mae Pool       | 4,50 % | 01.06.2052            | 63.163           | 0,06                         |
| 147.400  | Fannie Mae Pool       | 4,50 % | 01.07.2052            | 138.970          | 0,14                         |
| 197.158  | Fannie Mae Pool       | 4,50 % | 01.08.2052            | 185.638          | 0,18                         |
| 8.310  | Fannie Mae Pool       | 5,00 % | 01.07.2035            | 8.243            | 0,01                         |
| 16.138   | Fannie Mae Pool       | 5,00 % | 01.06.2038            | 16.087           | 0,02                         |
| 24.025   | Fannie Mae Pool       | 5,00 % | 01.07.2039            | 23.949           | 0,02                         |
| 19.978   | Fannie Mae Pool       | 5,00 % | 01.09.2040            | 19.914           | 0,02                         |
| 26.653   | Fannie Mae Pool       | 5,00 % | 01.02.2041            | 26.568           | 0,03                         |
| 26.410   | Fannie Mae Pool       | 5,00 % | 01.01.2044            | 26.250           | 0,03                         |
| 7.938  | Fannie Mae Pool       | 5,00 % | 01.03.2044            | 7.831            | 0,01                         |
| 3.915  | Fannie Mae Pool       | 5,00 % | 01.06.2048            | 3.851            | 0,00                         |
| 35.165   | Fannie Mae Pool       | 5,00 % | 01.09.2048            | 34.633           | 0,03                         |
| 241.938  | Fannie Mae Pool       | 5,00 % | 01.08.2052            | 234.384          | 0,23                         |
| 61.580   | Fannie Mae Pool       | 5,00 % | 01.09.2052            | 59.653           | 0,06                         |
| 764.934  | Fannie Mae Pool       | 5,00 % | 01.01.2053            | 740.874          | 0,73                         |
| 338.401  | Fannie Mae Pool       | 5,00 % | 01.02.2053            | 327.705          | 0,32                         |
| 170.918  | Fannie Mae Pool       | 5,00 % | 01.03.2053            | 165.347          | 0,16                         |
| 145.484  | Fannie Mae Pool       | 5,00 % | 01.07.2053            | 140.665          | 0,14                         |
| 104.151  | Fannie Mae Pool       | 5,00 % | 01.11.2054            | 100.583          | 0,10                         |
| 402.722  | Fannie Mae Pool       | 5,50 % | 01.12.2052            | 398.641          | 0,39                         |
| 157.569  | Fannie Mae Pool       | 5,50 % | 01.02.2053            | 155.711          | 0,15                         |
| 34.416   | Fannie Mae Pool       | 5,50 % | 01.05.2053            | 34.025           | 0,03                         |
| 342.321  | Fannie Mae Pool       | 5,50 % | 01.07.2053            | 338.492          | 0,33                         |
| 102.689  | Fannie Mae Pool       | 5,50 % | 01.10.2053            | 101.442          | 0,10                         |
| 37.151   | Fannie Mae Pool       | 5,50 % | 01.01.2054            | 36.695           | 0,04                         |
| 160.038  | Fannie Mae Pool       | 5,50 % | 01.02.2054            | 158.283          | 0,16                         |
| 27.359   | Fannie Mae Pool       | 5,50 % | 01.03.2054            | 27.018           | 0,03                         |
| 49.263   | Fannie Mae Pool       | 5,50 % | 01.11.2054            | 48.641           | 0,05                         |

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung    | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|--------------------------|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Mortgage-Backed Securities 17,84 % (31. Dezember 2023: 20,82 %) (Fortsetzung)</b> |                          |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |                          |        |                       |                  |                              |
| 136.871  | Fannie Mae Pool          | 6,00 % | 01.12.2052            | 137.792          | 0,14                         |
| 343.156  | Fannie Mae Pool          | 6,00 % | 01.10.2053            | 346.819          | 0,34                         |
| 171.198  | Fannie Mae Pool          | 6,50 % | 01.11.2053            | 174.835          | 0,17                         |
| 20.656   | Fannie Mae Pool (AJ7686) | 4,00 % | 01.12.2041            | 19.496           | 0,02                         |
| 221.199  | Fannie Mae Pool (BV7959) | 5,00 % | 01.08.2052            | 214.345          | 0,21                         |
| 200.612  | Fannie Mae Pool (CB1552) | 2,50 % | 01.09.2051            | 164.892          | 0,16                         |
| 300.933  | Fannie Mae Pool (FS5235) | 5,50 % | 01.07.2053            | 297.901          | 0,29                         |
| 386.592  | Fannie Mae Pool (MA4325) | 2,00 % | 01.05.2051            | 303.335          | 0,30                         |
| 20.758   | Freddie Mac Gold Pool    | 3,50 % | 01.10.2042            | 18.938           | 0,02                         |
| 8.876  | Freddie Mac Gold Pool    | 3,50 % | 01.05.2043            | 8.083            | 0,01                         |
| 14.146   | Freddie Mac Gold Pool    | 3,50 % | 01.06.2043            | 12.882           | 0,01                         |
| 43.562   | Freddie Mac Gold Pool    | 3,50 % | 01.07.2047            | 39.168           | 0,04                         |
| 15.695   | Freddie Mac Gold Pool    | 3,50 % | 01.09.2047            | 14.112           | 0,01                         |
| 35.136   | Freddie Mac Gold Pool    | 4,00 % | 01.02.2041            | 33.208           | 0,03                         |
| 23.990   | Freddie Mac Gold Pool    | 4,00 % | 01.11.2041            | 22.633           | 0,02                         |
| 65.618   | Freddie Mac Gold Pool    | 4,00 % | 01.01.2047            | 61.000           | 0,06                         |
| 32.886   | Freddie Mac Gold Pool    | 4,50 % | 01.08.2039            | 31.938           | 0,03                         |
| 10.336   | Freddie Mac Gold Pool    | 4,50 % | 01.12.2039            | 10.038           | 0,01                         |
| 3.644  | Freddie Mac Gold Pool    | 4,50 % | 01.03.2041            | 3.539            | 0,00                         |
| 30.279   | Freddie Mac Gold Pool    | 4,50 % | 01.11.2043            | 29.156           | 0,03                         |
| 5.576  | Freddie Mac Gold Pool    | 4,50 % | 01.10.2046            | 5.360            | 0,01                         |
| 36.799   | Freddie Mac Gold Pool    | 4,50 % | 01.09.2048            | 35.182           | 0,03                         |
| 7.049  | Freddie Mac Gold Pool    | 5,00 % | 01.10.2035            | 7.010            | 0,01                         |
| 15.825   | Freddie Mac Gold Pool    | 5,00 % | 01.09.2038            | 15.796           | 0,02                         |
| 9.876  | Freddie Mac Gold Pool    | 5,00 % | 01.03.2047            | 9.748            | 0,01                         |
| 91.508   | Freddie Mac Pool         | 2,00 % | 01.07.2051            | 71.749           | 0,07                         |
| 235.775  | Freddie Mac Pool         | 2,50 % | 01.12.2050            | 192.749          | 0,19                         |
| 104.790  | Freddie Mac Pool         | 2,50 % | 01.08.2051            | 86.125           | 0,08                         |
| 386.470  | Freddie Mac Pool         | 2,50 % | 01.01.2052            | 316.696          | 0,31                         |
| 63.739   | Freddie Mac Pool         | 3,00 % | 01.02.2050            | 55.007           | 0,05                         |
| 52.624   | Freddie Mac Pool         | 3,00 % | 01.01.2053            | 44.914           | 0,04                         |
| 37.498   | Freddie Mac Pool         | 3,50 % | 01.03.2048            | 33.669           | 0,03                         |
| 163.773  | Freddie Mac Pool         | 5,00 % | 01.08.2052            | 158.401          | 0,16                         |
| 333.611  | Freddie Mac Pool         | 5,00 % | 01.10.2052            | 323.144          | 0,32                         |
| 90.358   | Freddie Mac Pool         | 5,00 % | 01.11.2052            | 87.516           | 0,09                         |
| 89.330   | Freddie Mac Pool         | 5,00 % | 01.08.2053            | 86.305           | 0,08                         |
| 192.817  | Freddie Mac Pool         | 5,00 % | 01.10.2054            | 186.209          | 0,18                         |
| 220.722  | Freddie Mac Pool         | 5,50 % | 01.09.2052            | 219.190          | 0,22                         |
| 214.794  | Freddie Mac Pool         | 5,50 % | 01.11.2052            | 212.146          | 0,21                         |
| 304.934  | Freddie Mac Pool         | 5,50 % | 01.01.2053            | 301.363          | 0,30                         |

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                           | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|---|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Mortgage-Backed Securities 17,84 % (31. Dezember 2023: 20,82 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |        |                       |                   |                              |
| 170.613  | Freddie Mac Pool                                | 5,50 % | 01.03.2053            | 168.512           | 0,17                         |
| 108.656  | Freddie Mac Pool                                | 5,50 % | 01.06.2053            | 107.394           | 0,11                         |
| 50.238   | Freddie Mac Pool                                | 5,50 % | 01.07.2053            | 49.862            | 0,05                         |
| 132.309  | Freddie Mac Pool                                | 5,50 % | 01.04.2054            | 130.662           | 0,13                         |
| 476.531  | Freddie Mac Pool                                | 5,50 % | 01.07.2054            | 470.524           | 0,46                         |
| 39.697   | Freddie Mac Pool                                | 6,00 % | 01.01.2053            | 39.912            | 0,04                         |
| 348.244  | Freddie Mac Pool                                | 6,00 % | 01.02.2053            | 352.169           | 0,35                         |
| 314.720  | Freddie Mac Pool                                | 6,00 % | 01.03.2053            | 316.395           | 0,31                         |
| 308.546  | Freddie Mac Pool                                | 6,00 % | 01.04.2053            | 310.662           | 0,31                         |
| 561.550  | Freddie Mac Pool                                | 6,00 % | 01.05.2053            | 564.711           | 0,56                         |
| 329.424  | Freddie Mac Pool                                | 6,00 % | 01.06.2053            | 331.447           | 0,33                         |
| 342.952  | Freddie Mac Pool                                | 6,00 % | 01.09.2053            | 347.002           | 0,34                         |
| 413.997  | Freddie Mac Pool                                | 6,00 % | 01.12.2053            | 416.328           | 0,41                         |
| 184.350  | Freddie Mac Pool                                | 6,00 % | 01.02.2054            | 185.332           | 0,18                         |
| 261.645  | Freddie Mac Pool                                | 6,00 % | 01.10.2054            | 262.998           | 0,26                         |
| 152.075  | Freddie Mac Pool                                | 6,50 % | 01.09.2053            | 156.048           | 0,15                         |
| 421.957  | Freddie Mac Pool (SD3010)                       | 5,50 % | 01.06.2053            | 418.645           | 0,41                         |
| 196.770  | Ginnie Mae II Pool                              | 4,50 % | 20.04.2054            | 186.145           | 0,18                         |
| 122.550  | Ginnie Mae II Pool                              | 5,00 % | 20.03.2053            | 119.229           | 0,12                         |
| 96.503   | Ginnie Mae II Pool                              | 5,00 % | 20.07.2053            | 93.813            | 0,09                         |
| 37.997   | Ginnie Mae II Pool                              | 5,00 % | 20.11.2053            | 36.920            | 0,04                         |
| 84.243   | Ginnie Mae II Pool                              | 5,00 % | 20.07.2054            | 81.813            | 0,08                         |
| 142.682  | Ginnie Mae II Pool                              | 5,50 % | 20.03.2053            | 142.025           | 0,14                         |
| 34.299   | Ginnie Mae II Pool                              | 5,50 % | 20.09.2053            | 34.099            | 0,03                         |
| 65.312   | Ginnie Mae II Pool                              | 5,50 % | 20.10.2053            | 64.918            | 0,06                         |
| 163.482  | Ginnie Mae II Pool                              | 5,50 % | 20.08.2054            | 162.309           | 0,16                         |
| <b>Mortgage-Backed Securities insgesamt **</b>                                       |   |        |                       | <b>18.149.436</b> | <b>17,84</b>                 |
| <b>Kommunalanleihen 1,10 % (31. Dezember 2023: 1,18 %)</b>                           |   |        |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |   |        |                       |                   |                              |
| 520.000  | New York City Municipal Water Finance Authority | 6,01 % | 15.06.2042            | 527.410           | 0,52                         |
| 325.000  | State of California                             | 4,60 % | 01.04.2038            | 302.846           | 0,29                         |
| 400.000  | State of Hawaii                                 | 2,85 % | 01.10.2040            | 293.722           | 0,29                         |
| <b>Kommunalanleihen insgesamt †</b>  |   |        |                       | <b>1.123.978</b>  | <b>1,10</b>                  |
| <b>Anlagen insgesamt</b>   |   |        |                       | <b>97.043.787</b> | <b>95,38</b>                 |

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Devisenterminkontrakte 4,25 % (31. Dezember 2023: 3,07 %)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                        | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|------------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 15.119 €           | 27.000 NZD          | 16.01.2025       | Royal Bank Of Canada               | 1         | 536                            | 0,00                 |
| 214.706 £          | 268.328 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 1         | 539                            | 0,00                 |
| 2.677.259 ILS      | 721.797 US\$        | 16.01.2025       | BNP Paribas                        | 2         | 13.185                         | 0,01                 |
| 568.748 ILS        | 151.626 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 1         | 4.511                          | 0,00                 |
| 3.197.252 ILS      | 855.371 US\$        | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co     | 3         | 22.363                         | 0,02                 |
| 768.010 ILS        | 205.368 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                             | 2         | 5.472                          | 0,01                 |
| 5.724.898 MXN      | 274.260 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 1         | 424                            | 0,00                 |
| 5.453.817 MXN      | 261.555 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                             | 1         | 122                            | 0,00                 |
| 9.444.939 TRY      | 258.553 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 1         | 5.130                          | 0,00                 |
| 31.222.860 TRY     | 828.754 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                             | 2         | 42.922                         | 0,04                 |
| 1.405.165 US\$     | 2.118.836 AUD       | 16.01.2025       | BNP Paribas                        | 4         | 93.262                         | 0,09                 |
| 966.655 US\$       | 10.597.546 NOK      | 16.01.2025       | BNP Paribas                        | 5         | 33.576                         | 0,03                 |
| 558.437 US\$       | 481.637 CHF         | 16.01.2025       | BNP Paribas                        | 1         | 26.180                         | 0,03                 |
| 56.171 US\$        | 394.860 CNY         | 16.01.2025       | BNP Paribas                        | 1         | 1.500                          | 0,00                 |
| 836.860 US\$       | 1.164.465 CAD       | 16.01.2025       | BNP Paribas                        | 2         | 26.795                         | 0,03                 |
| 4.022.257 US\$     | 3.720.589 €         | 16.01.2025       | BNP Paribas                        | 8         | 167.540                        | 0,16                 |
| 1.665.027 US\$     | 18.140.933 SEK      | 16.01.2025       | BNP Paribas                        | 7         | 22.065                         | 0,02                 |
| 144 US\$           | 1.005 CNY           | 16.01.2025       | BNP Paribas                        | 1         | 7                              | 0,00                 |
| 559.403 US\$       | 2.250.457 PLN       | 16.01.2025       | BNP Paribas                        | 2         | 14.809                         | 0,01                 |
| 476.984 US\$       | 826.225 NZD         | 16.01.2025       | BNP Paribas                        | 2         | 14.057                         | 0,01                 |
| 3.615.623 US\$     | 550.403.976 ¥       | 16.01.2025       | BNP Paribas                        | 10        | 107.918                        | 0,11                 |
| 2.777.550 US\$     | 2.181.387 £         | 16.01.2025       | BNP Paribas                        | 7         | 45.892                         | 0,05                 |
| 129.542 US\$       | 97.650 £            | 16.01.2025       | Canadian Imperial Bank of Commerce | 2         | 7.259                          | 0,01                 |
| 216.773 US\$       | 282.000 SGD         | 16.01.2025       | Canadian Imperial Bank of Commerce | 1         | 9.942                          | 0,01                 |
| 54.965 US\$        | 213.698 PLN         | 16.01.2025       | Canadian Imperial Bank of Commerce | 1         | 3.252                          | 0,00                 |
| 866.596 US\$       | 1.174.553 CAD       | 16.01.2025       | Canadian Imperial Bank of Commerce | 2         | 49.514                         | 0,05                 |
| 647.354 US\$       | 610.529 €           | 16.01.2025       | Canadian Imperial Bank of Commerce | 1         | 14.816                         | 0,01                 |
| 2.635.712 US\$     | 2.492.854 €         | 16.01.2025       | Citibank NA                        | 1         | 52.989                         | 0,05                 |
| 402.892 US\$       | 60.132.813 ¥        | 16.01.2025       | Citibank NA                        | 1         | 19.667                         | 0,02                 |
| 3.946.223 US\$     | 2.967.350 £         | 16.01.2025       | Citibank NA                        | 1         | 230.337                        | 0,23                 |
| 91.003 US\$        | 142.456 AUD         | 16.01.2025       | Citibank NA                        | 1         | 2.800                          | 0,00                 |
| 92.845 US\$        | 985.545 NOK         | 16.01.2025       | Citibank NA                        | 1         | 6.071                          | 0,01                 |
| 826.222 US\$       | 119.000.000 ¥       | 16.01.2025       | Deutsche Bank AG                   | 1         | 67.839                         | 0,07                 |
| 572.029 US\$       | 10.118.796 ZAR      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 1         | 36.454                         | 0,04                 |
| 1.185.732 US\$     | 4.759.176 PLN       | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 4         | 34.046                         | 0,03                 |
| 417.063 US\$       | 2.434.602 BRL       | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 2         | 23.976                         | 0,02                 |
| 840.327 US\$       | 1.278.423 AUD       | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 3         | 48.776                         | 0,05                 |
| 2.707.835 US\$     | 29.278.113 SEK      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 7         | 56.218                         | 0,06                 |
| 422.344 US\$       | 35.703.678 INR      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 2         | 5.731                          | 0,01                 |
| 1.611.251 US\$     | 1.264.078 £         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 6         | 28.300                         | 0,03                 |

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 4,25 % (31. Dezember 2023: 3,07 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 549.728 US\$       | 488.155 CHF         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | 10.268                         | 0,01                 |
| 1.108.428 US\$     | 170.504.076 ¥       | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 3         | 21.812                         | 0,02                 |
| 137.999 US\$       | 3.251.361 CZK       | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | 4.234                          | 0,00                 |
| 69.454 US\$        | 116.774 NZD         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | 4.027                          | 0,00                 |
| 2.001.317 US\$     | 2.795.521 CAD       | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 4         | 56.601                         | 0,06                 |
| 1.118.467 US\$     | 12.283.646 NOK      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 6         | 36.935                         | 0,04                 |
| 2.974.052 US\$     | 2.757.864 €         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 6         | 116.766                        | 0,11                 |
| 1.132.348 US\$     | 417.101.445 HUF     | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | 83.093                         | 0,08                 |
| 1.678.784 US\$     | 34.594.510 MXN      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 4         | 18.918                         | 0,02                 |
| 553.618 US\$       | 768.855 CAD         | 16.01.2025       | Royal Bank Of Canada           | 2         | 18.761                         | 0,02                 |
| 711.163 US\$       | 104.872.280 ¥       | 16.01.2025       | Royal Bank Of Canada           | 2         | 42.816                         | 0,04                 |
| 1.126.512 US\$     | 867.174 £           | 16.01.2025       | Royal Bank Of Canada           | 1         | 40.587                         | 0,04                 |
| 844.643 US\$       | 9.130.086 NOK       | 16.01.2025       | Royal Bank Of Canada           | 1         | 40.770                         | 0,04                 |
| 333.756 US\$       | 2.400.000 CNY       | 16.01.2025       | Royal Bank Of Canada           | 1         | 1.460                          | 0,00                 |
| 1.110.666 US\$     | 969.996 CHF         | 16.01.2025       | Royal Bank Of Canada           | 2         | 38.723                         | 0,04                 |
| 276.271 US\$       | 4.823.056 ZAR       | 16.01.2025       | Royal Bank Of Canada           | 1         | 20.993                         | 0,02                 |
| 1.497.198 US\$     | 2.383.337 NZD       | 16.01.2025       | Royal Bank Of Canada           | 3         | 161.835                        | 0,16                 |
| 551.830 US\$       | 524.537 €           | 16.01.2025       | Royal Bank Of Canada           | 2         | 8.383                          | 0,01                 |
| 2.769.917 US\$     | 4.114.931 AUD       | 16.01.2025       | Royal Bank Of Canada           | 5         | 222.110                        | 0,22                 |
| 277.539 US\$       | 240.790 CHF         | 16.01.2025       | Standard Chartered Bank        | 1         | 11.441                         | 0,01                 |
| 52.771 US\$        | 380.247 CNY         | 16.01.2025       | Standard Chartered Bank        | 1         | 123                            | 0,00                 |
| 529.330 US\$       | 712.979 CAD         | 16.01.2025       | Standard Chartered Bank        | 1         | 33.343                         | 0,03                 |
| 73.425 US\$        | 104.357.755 KRW     | 16.01.2025       | Standard Chartered Bank        | 1         | 2.778                          | 0,00                 |
| 788.047 US\$       | 3.133.011 PLN       | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 4         | 29.882                         | 0,03                 |
| 3.235.050 US\$     | 2.965.938 €         | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 8         | 162.189                        | 0,16                 |
| 1.481.956 US\$     | 16.357.038 NOK      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 7         | 41.776                         | 0,04                 |
| 3.412.011 US\$     | 514.263.760 ¥       | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 14        | 134.626                        | 0,13                 |
| 280.313 US\$       | 4.433.355.431 IDR   | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 2         | 6.329                          | 0,01                 |
| 3.528.844 US\$     | 37.214.779 SEK      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 7         | 158.430                        | 0,16                 |
| 2.224.409 US\$     | 1.742.145 £         | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 9         | 42.795                         | 0,04                 |
| 57.457 US\$        | 382.065 DKK         | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 4.368                          | 0,00                 |
| 280.351 US\$       | 5.670.113 MXN       | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 2         | 8.295                          | 0,01                 |
| 2.082.911 US\$     | 3.187.695 AUD       | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 11        | 109.212                        | 0,11                 |
| 1.430.763 US\$     | 1.925.471.045 KRW   | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 4         | 127.265                        | 0,13                 |
| 990.709 US\$       | 17.618.234 ZAR      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 3         | 58.198                         | 0,06                 |
| 280.147 US\$       | 23.685.603 INR      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 2         | 3.768                          | 0,00                 |
| 1.546.850 US\$     | 2.155.853 CAD       | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 6         | 47.122                         | 0,05                 |
| 294.446 US\$       | 1.725.540 BRL       | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 15.843                         | 0,02                 |
| 2.821.512 US\$     | 2.431.959 CHF       | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 8         | 133.954                        | 0,13                 |
| 2.239.055 US\$     | 3.742.470 NZD       | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 8         | 142.180                        | 0,14                 |
| 559.816 US\$       | 3.961.587 CNY       | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 20.221                         | 0,02                 |

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Devisenterminkontrakte 4,25 % (31. Dezember 2023: 3,07 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag              | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 839.961 US\$                    | 1.166.412 CAD       | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | 28.542                         | 0,03                 |
| 852.324 US\$                    | 126.440.790 ¥       | 16.01.2025       | UBS AG                      | 2         | 46.521                         | 0,05                 |
| 914.232 US\$                    | 868.567 €           | 16.01.2025       | UBS AG                      | 3         | 14.352                         | 0,01                 |
| 549.042 US\$                    | 6.074.244 NOK       | 16.01.2025       | UBS AG                      | 2         | 14.225                         | 0,01                 |
| 424.186 US\$                    | 4.612.813 SEK       | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | 6.420                          | 0,01                 |
| 286.770 US\$                    | 24.210.656 INR      | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | 4.265                          | 0,00                 |
| 493.021 US\$                    | 187.602.417 HUF     | 16.01.2025       | UBS AG                      | 3         | 21.091                         | 0,02                 |
| 137.792 US\$                    | 193.463.423 KRW     | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | 6.821                          | 0,01                 |
| 301.160 US\$                    | 6.149.380 MXN       | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | 6.109                          | 0,01                 |
| 138.768 US\$                    | 238.330 NZD         | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | 5.233                          | 0,01                 |
| 331.770 US\$                    | 2.323.854 CNY       | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | 15.246                         | 0,01                 |
| 431.373 US\$                    | 6.767.468.023 IDR   | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | 13.138                         | 0,01                 |
| 1.512.381 US\$                  | 8.913.559 BRL       | 16.01.2025       | UBS AG                      | 3         | 73.215                         | 0,07                 |
| 42.029 US\$                     | 739.812 ZAR         | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | 2.872                          | 0,00                 |
| 780.675 US\$                    | 5.230.923 DKK       | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | 53.834                         | 0,05                 |
| 3.027.546 US\$                  | 4.531.386 AUD       | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 6         | 221.886                        | 0,22                 |
| 560.810 US\$                    | 777.729 CAD         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | 19.780                         | 0,02                 |
| 1.238.222 US\$                  | 1.174.861 €         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 3         | 21.008                         | 0,02                 |
| 135.930 US\$                    | 119.492 CHF         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | 3.880                          | 0,00                 |
| 2.389.571 US\$                  | 4.018.337 NZD       | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 7         | 138.131                        | 0,14                 |
| 29 US\$                         | 204 CNY             | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | 1                              | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 651 €                           | 13.886 MXN          | 16.01.2025       | BNP Paribas                 | 1         | 8                              | 0,00                 |
| 12.648 €                        | 94.230 DKK          | 16.01.2025       | BNP Paribas                 | 1         | 11                             | 0,00                 |
| 23.410 €                        | 265.791 SEK         | 16.01.2025       | BNP Paribas                 | 1         | 182                            | 0,00                 |
| 17.607 €                        | 26.493.780 KRW      | 16.01.2025       | Citibank NA                 | 1         | 306                            | 0,00                 |
| 3.107 €                         | 5.632 NZD           | 16.01.2025       | Citibank NA                 | 1         | 63                             | 0,00                 |
| 42.538 €                        | 39.684 CHF          | 16.01.2025       | Citibank NA                 | 2         | 217                            | 0,00                 |
| 780.794 €                       | 125.408.027 ¥       | 16.01.2025       | Citibank NA                 | 2         | 9.721                          | 0,01                 |
| 886 €                           | 825 CHF             | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | 6                              | 0,00                 |
| 4.312 €                         | 32.145 DKK          | 16.01.2025       | Royal Bank Of Canada        | 2         | 1                              | 0,00                 |
| 18.235 €                        | 30.205 AUD          | 16.01.2025       | Royal Bank Of Canada        | 1         | 190                            | 0,00                 |
| 6.177 €                         | 132.877 MXN         | 16.01.2025       | Royal Bank Of Canada        | 1         | 25                             | 0,00                 |
| 10.007 €                        | 18.013 NZD          | 16.01.2025       | Royal Bank Of Canada        | 1         | 275                            | 0,00                 |
| 20.854 €                        | 3.326.400 ¥         | 16.01.2025       | Standard Chartered Bank     | 1         | 407                            | 0,00                 |
| 376 €                           | 683 NZD             | 16.01.2025       | Standard Chartered Bank     | 1         | 7                              | 0,00                 |
| 77.013 €                        | 113.445.459 KRW     | 16.01.2025       | Standard Chartered Bank     | 2         | 2.990                          | 0,01                 |
| 91.324 €                        | 149.404 AUD         | 16.01.2025       | Standard Chartered Bank     | 2         | 2.111                          | 0,00                 |
| 12.498 £                        | 15.056 €            | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | 52                             | 0,00                 |
| 99.001 US\$                     | 93.668 €            | 16.01.2025       | Royal Bank Of Canada        | 1         | 1.956                          | 0,00                 |

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 4,25 % (31. Dezember 2023: 3,07 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>   |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 1.038 US\$  | 808 £               | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 5         | 26                             | 0,00                 |
| 1.474 US\$  | 1.138 £             | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 6         | 49                             | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen USD</i>   |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 1.600 US\$  | 2.154 CAD           | 16.01.2025       | BNP Paribas                    | 1         | 101                            | 0,00                 |
| 2.471 US\$  | 1.857 £             | 16.01.2025       | Citibank NA                    | 1         | 146                            | 0,00                 |
| 701 US\$  | 937.897 KRW         | 16.01.2025       | Citibank NA                    | 1         | 66                             | 0,00                 |
| 147 US\$  | 1.057 CNY           | 16.01.2025       | Citibank NA                    | 1         | 0                              | 0,00                 |
| 341 US\$  | 285 CHF             | 16.01.2025       | Citibank NA                    | 1         | 26                             | 0,00                 |
| 17 US\$   | 561 THB             | 16.01.2025       | Citibank NA                    | 1         | 0                              | 0,00                 |
| 158 US\$  | 3.174 MXN           | 16.01.2025       | Citibank NA                    | 1         | 6                              | 0,00                 |
| 6.111 US\$  | 863.604 ¥           | 16.01.2025       | Royal Bank Of Canada           | 1         | 607                            | 0,00                 |
| 254 US\$  | 3.981.117 IDR       | 16.01.2025       | Royal Bank Of Canada           | 1         | 8                              | 0,00                 |
| 838 US\$  | 1.214 AUD           | 16.01.2025       | Royal Bank Of Canada           | 1         | 86                             | 0,00                 |
| 224 US\$  | 2.277 SEK           | 16.01.2025       | Royal Bank Of Canada           | 1         | 17                             | 0,00                 |
| 129 US\$  | 165 SGD             | 16.01.2025       | Royal Bank Of Canada           | 1         | 8                              | 0,00                 |
| 47 US\$   | 66 CAD              | 16.01.2025       | Royal Bank Of Canada           | 1         | 1                              | 0,00                 |
| 13.674 US\$   | 12.302 €            | 16.01.2025       | Royal Bank Of Canada           | 2         | 929                            | 0,00                 |
| 98 US\$   | 155 NZD             | 16.01.2025       | Royal Bank Of Canada           | 1         | 11                             | 0,00                 |
| 197 US\$  | 6.368 THB           | 16.01.2025       | UBS AG                         | 1         | 10                             | 0,00                 |
| 120 US\$  | 802 DKK             | 16.01.2025       | UBS AG                         | 1         | 8                              | 0,00                 |
| 5.716 US\$  | 40.049 CNY          | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 1         | 171                            | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>o</sup></b> |                     |                  |                                |           | <b>4.327.396</b>               | <b>4,25</b>          |

### Futures-Kontrakte 0,21 % (31. Dezember 2023: 0,41 %)

| Anzahl Kontrakte   | Beschreibung   | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|--|--------------------------------|----------------------|
| 15   | 30 Day Federal Funds Future January 2025             | 469                            | 0,00                 |
| (19)   | Australian Government Bond 10-Year Future March 2025 | 11.646                         | 0,01                 |
| 2  | Canadian 10-Year Bond Future March 2025              | 3.059                          | 0,00                 |
| 12   | Canadian 5-Year Bond Future March 2025               | 12.683                         | 0,01                 |
| (26)   | Euro-Bund Future March 2025                          | 90.275                         | 0,09                 |
| (9)  | United Kingdom Long Gilt Future March 2025           | 23.345                         | 0,02                 |
| (2)  | US Treasury Long Bond (CBT) Future March 2025        | 5.453                          | 0,01                 |
| (51)   | US Treasury Ultra 10-Year Future March 2025          | 67.234                         | 0,07                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten <sup>±</sup></b> |  | <b>214.164</b>                 | <b>0,21</b>          |

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Zinsswap-Kontrakte 0,07 % (31. Dezember 2023: 0,11 %)

|   | Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei                   | Erhalt/(Zahlung) <sup>#</sup> | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|-------------|------------|-------------------------------|-------------------------------|-----------------|--------------------|--------------------------------|----------------------|
| EUR   | 1.780.000   | 02.11.2035 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 3,63 %          | 1D €STR            | 31.883                         | 0,03                 |
| GBP   | 200.000     | 11.12.2054 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | Erhalt                        | 3,99 %          | 1D SONIA           | 10.030                         | 0,01                 |
| CNY   | 9.273.000   | 30.11.2027 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 2,82 %          | 7D CNRR            | 7.055                          | 0,01                 |
| CHF   | 1.000.000   | 09.11.2034 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 0,70 %          | 1D SARON           | 6.799                          | 0,01                 |
| CNY   | 9.773.000   | 31.05.2028 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 2,50 %          | 7D CNRR            | 6.740                          | 0,01                 |
| CHF   | 490.000     | 27.11.2034 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 0,63 %          | 1D SARON           | 1.197                          | 0,00                 |
| CNY   | 6.358.000   | 17.12.2029 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 1,44 %          | 7D CNRR            | 279                            | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Zinsswapkontrakten <sup>oo</sup></b> |             |            |                               |                               |                 |                    | <b>63.983</b>                  | <b>0,07</b>          |

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

|  | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens |
|--|--------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> | <b>101.649.330</b> | <b>99,91</b>         |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (4,48 %) (31. Dezember 2023: (2,94 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                        | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|------------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 4.244.007 AUD      | 2.796.738 US\$      | 16.01.2025       | BNP Paribas                        | 6         | (169.011)                       | (0,17)               |
| 3.079.081 AUD      | 2.073.157 US\$      | 16.01.2025       | Canadian Imperial Bank of Commerce | 1         | (166.708)                       | (0,16)               |
| 60.000 AUD         | 37.071 €            | 16.01.2025       | Canadian Imperial Bank of Commerce | 1         | (1.258)                         | (0,00)               |
| 102.176 AUD        | 66.346 US\$         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 1         | (3.082)                         | (0,00)               |
| 845.396 AUD        | 569.209 US\$        | 16.01.2025       | Royal Bank Of Canada               | 1         | (45.772)                        | (0,04)               |
| 2.449.395 AUD      | 1.593.838 US\$      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co     | 5         | (77.267)                        | (0,08)               |
| 1.919.434 AUD      | 1.244.123 US\$      | 16.01.2025       | UBS AG                             | 2         | (55.683)                        | (0,05)               |
| 960.341 AUD        | 631.764 US\$        | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp               | 2         | (37.157)                        | (0,04)               |
| 4.989.025 BRL      | 847.096 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 2         | (41.577)                        | (0,04)               |
| 4.903.042 BRL      | 860.312 US\$        | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co     | 2         | (68.677)                        | (0,07)               |
| 3.301.263 BRL      | 590.423 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                             | 1         | (57.408)                        | (0,06)               |
| 1.161.229 CAD      | 840.808 US\$        | 16.01.2025       | BNP Paribas                        | 2         | (32.994)                        | (0,03)               |
| 550.190 CAD        | 404.325 US\$        | 16.01.2025       | Canadian Imperial Bank of Commerce | 1         | (21.583)                        | (0,02)               |
| 3.681.627 CAD      | 2.659.123 US\$      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 5         | (97.984)                        | (0,10)               |
| 1.552.396 CAD      | 1.125.798 US\$      | 16.01.2025       | Royal Bank Of Canada               | 3         | (45.868)                        | (0,05)               |
| 1.451.052 CAD      | 1.030.838 US\$      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co     | 3         | (21.408)                        | (0,02)               |
| 775.052 CAD        | 562.228 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                             | 1         | (23.060)                        | (0,02)               |
| 1.261.349 CAD      | 907.121 US\$        | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp               | 2         | (29.659)                        | (0,03)               |
| 1.340.440 CHF      | 1.542.492 US\$      | 16.01.2025       | BNP Paribas                        | 4         | (61.171)                        | (0,06)               |

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (4,48 %) (31. Dezember 2023: (2,94 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                        | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|------------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 720.896 CHF        | 836.403 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 1         | (39.741)                        | (0,04)               |
| 126.267 CHF        | 151.128 US\$        | 16.01.2025       | Royal Bank Of Canada               | 1         | (11.591)                        | (0,01)               |
| 2.847.399 CHF      | 3.278.789 US\$      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co     | 13        | (132.127)                       | (0,13)               |
| 239.228 CHF        | 270.985 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                             | 1         | (6.614)                         | (0,01)               |
| 117.034 CHF        | 132.707 US\$        | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp               | 1         | (3.372)                         | (0,00)               |
| 72.247.453 CLP     | 77.269 US\$         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 2         | (4.631)                         | (0,00)               |
| 5.014.222 CNY      | 700.828 US\$        | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co     | 2         | (17.856)                        | (0,02)               |
| 1.027.264 CNY      | 144.739 US\$        | 16.01.2025       | BNP Paribas                        | 2         | (2.507)                         | (0,00)               |
| 1.019.288 CNY      | 141.876 US\$        | 16.01.2025       | Citibank NA                        | 2         | (748)                           | (0,00)               |
| 404.329 CNY        | 56.265 US\$         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 1         | (283)                           | (0,00)               |
| 842.919 CNY        | 117.225 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                             | 1         | (517)                           | (0,00)               |
| 74.062.762 CNY     | 10.571.183 US\$     | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp               | 1         | (316.696)                       | (0,31)               |
| 562.762.908 COP    | 130.864 US\$        | 16.01.2025       | Royal Bank Of Canada               | 2         | (3.361)                         | (0,00)               |
| 4.137.399 CZK      | 181.580 US\$        | 16.01.2025       | Citibank NA                        | 1         | (11.363)                        | (0,01)               |
| 986.538 CZK        | 42.958 US\$         | 16.01.2025       | Royal Bank Of Canada               | 1         | (2.371)                         | (0,00)               |
| 3.264.114 CZK      | 137.364 US\$        | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co     | 2         | (3.074)                         | (0,00)               |
| 4.143.820 €        | 4.433.377 US\$      | 16.01.2025       | BNP Paribas                        | 13        | (140.171)                       | (0,14)               |
| 251.332 €          | 40.900.000 ¥        | 16.01.2025       | Canadian Imperial Bank of Commerce | 1         | (262)                           | (0,00)               |
| 165.710 €          | 175.227 US\$        | 16.01.2025       | Canadian Imperial Bank of Commerce | 1         | (3.543)                         | (0,00)               |
| 1.548.425 €        | 1.666.817 US\$      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 4         | (62.572)                        | (0,06)               |
| 1.305.646 €        | 1.387.359 US\$      | 16.01.2025       | Royal Bank Of Canada               | 3         | (34.644)                        | (0,03)               |
| 4.000.000 €        | 4.214.819 US\$      | 16.01.2025       | Standard Chartered Bank            | 1         | (70.617)                        | (0,07)               |
| 2.210.432 €        | 2.367.399 US\$      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co     | 8         | (77.280)                        | (0,08)               |
| 310.480 €          | 333.151 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                             | 2         | (11.478)                        | (0,01)               |
| 260.012 €          | 278.800 US\$        | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp               | 2         | (9.414)                         | (0,01)               |
| 1.409.267 £        | 1.801.191 US\$      | 16.01.2025       | BNP Paribas                        | 4         | (36.426)                        | (0,04)               |
| 559.934 £          | 727.459 US\$        | 16.01.2025       | Canadian Imperial Bank of Commerce | 2         | (26.278)                        | (0,03)               |
| 752.917 £          | 970.246 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 2         | (27.400)                        | (0,03)               |
| 658.587 £          | 825.403 US\$        | 16.01.2025       | Royal Bank Of Canada               | 1         | (683)                           | (0,00)               |
| 940.003 £          | 1.194.047 US\$      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co     | 5         | (16.922)                        | (0,02)               |
| 893.790 £          | 1.135.587 US\$      | 16.01.2025       | UBS AG                             | 1         | (16.332)                        | (0,02)               |
| 223.568 HKD        | 28.791 US\$         | 16.01.2025       | UBS AG                             | 1         | (8)                             | (0,00)               |
| 207.779.682 HUF    | 564.137 US\$        | 16.01.2025       | BNP Paribas                        | 1         | (41.448)                        | (0,04)               |
| 7.006 HUF          | 19 US\$             | 16.01.2025       | Canadian Imperial Bank of Commerce | 1         | (2)                             | (0,00)               |
| 39.478.345 HUF     | 109.355 US\$        | 16.01.2025       | Citibank NA                        | 1         | (10.043)                        | (0,01)               |
| 27.414.378 HUF     | 69.867 US\$         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 1         | (904)                           | (0,00)               |
| 209.331.707 HUF    | 558.473 US\$        | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co     | 1         | (31.881)                        | (0,03)               |
| 160.173.730 HUF    | 415.595 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                             | 2         | (12.664)                        | (0,01)               |
| 6.773.555.635 IDR  | 434.954 US\$        | 16.01.2025       | BNP Paribas                        | 1         | (16.344)                        | (0,02)               |
| 4.426.925.278 IDR  | 279.121 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 2         | (5.534)                         | (0,01)               |
| 7.310.989.266 IDR  | 466.018 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                             | 1         | (14.193)                        | (0,01)               |

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Devisenterminkontrakte (4,48 %) (31. Dezember 2023: (2,94 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                        | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|------------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 60.019.928 INR     | 711.457 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 1         | (11.106)                        | (0,01)               |
| 23.577.102 INR     | 279.526 US\$        | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co     | 2         | (4.413)                         | (0,00)               |
| 382.015.743 ¥      | 2.502.182 US\$      | 16.01.2025       | BNP Paribas                        | 5         | (67.608)                        | (0,07)               |
| 663.042.933 ¥      | 4.679.812 US\$      | 16.01.2025       | Canadian Imperial Bank of Commerce | 2         | (454.263)                       | (0,45)               |
| 9.786.277 ¥        | 64.997 US\$         | 16.01.2025       | Citibank NA                        | 1         | (2.629)                         | (0,00)               |
| 394.513.024 ¥      | 2.588.721 US\$      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 5         | (74.503)                        | (0,07)               |
| 83.489.165 ¥       | 567.977 US\$        | 16.01.2025       | Royal Bank Of Canada               | 1         | (35.903)                        | (0,04)               |
| 270.672.187 ¥      | 1.813.514 US\$      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co     | 5         | (88.529)                        | (0,09)               |
| 255.886.377 ¥      | 1.698.104 US\$      | 16.01.2025       | UBS AG                             | 5         | (67.348)                        | (0,07)               |
| 191.918.032 KRW    | 142.800 US\$        | 16.01.2025       | Royal Bank Of Canada               | 1         | (12.876)                        | (0,01)               |
| 293.148.896 KRW    | 210.060 US\$        | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co     | 2         | (11.605)                        | (0,01)               |
| 195.711.818 KRW    | 141.844 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                             | 1         | (9.352)                         | (0,01)               |
| 8.895.784 MXN      | 430.715 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 2         | (3.891)                         | (0,00)               |
| 17.316.000 MXN     | 846.464 US\$        | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co     | 3         | (15.631)                        | (0,02)               |
| 15.844.137 MXN     | 776.741 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                             | 2         | (16.529)                        | (0,02)               |
| 2.000.630 MYR      | 468.641 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 1         | (21.312)                        | (0,02)               |
| 27.548.527 NOK     | 2.503.019 US\$      | 16.01.2025       | BNP Paribas                        | 10        | (77.465)                        | (0,08)               |
| 10.750.148 NOK     | 971.818 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 4         | (25.305)                        | (0,02)               |
| 18.198.496 NOK     | 1.670.645 US\$      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co     | 5         | (68.329)                        | (0,07)               |
| 4.628.849 NOK      | 418.727 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                             | 1         | (11.173)                        | (0,01)               |
| 1.176.241 NZD      | 697.970 US\$        | 16.01.2025       | BNP Paribas                        | 2         | (38.932)                        | (0,04)               |
| 1.175.229 NZD      | 703.404 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 1         | (44.933)                        | (0,04)               |
| 3.049.491 NZD      | 1.814.647 US\$      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co     | 6         | (106.042)                       | (0,10)               |
| 479.547 NZD        | 283.170 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                             | 1         | (14.484)                        | (0,01)               |
| 4.943.206 NZD      | 2.977.976 US\$      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp               | 6         | (208.339)                       | (0,20)               |
| 250.572 PEN        | 66.752 US\$         | 16.01.2025       | Royal Bank Of Canada               | 1         | (94)                            | (0,00)               |
| 564.746 PLN        | 137.541 US\$        | 16.01.2025       | Canadian Imperial Bank of Commerce | 1         | (877)                           | (0,00)               |
| 1.126.925 PLN      | 273.875 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 1         | (1.168)                         | (0,00)               |
| 7.315.145 PLN      | 1.813.933 US\$      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co     | 7         | (43.722)                        | (0,04)               |
| 1.135.892 PLN      | 281.260 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                             | 1         | (6.383)                         | (0,01)               |
| 439.804 RON        | 97.667 US\$         | 16.01.2025       | UBS AG                             | 1         | (6.201)                         | (0,01)               |
| 25.596.746 SEK     | 2.364.653 US\$      | 16.01.2025       | BNP Paribas                        | 8         | (46.446)                        | (0,05)               |
| 3.838.372 SEK      | 376.514 US\$        | 16.01.2025       | Citibank NA                        | 1         | (28.886)                        | (0,03)               |
| 10.420.450 SEK     | 963.627 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 6         | (19.882)                        | (0,02)               |
| 3.124.903 SEK      | 284.696 US\$        | 16.01.2025       | Royal Bank Of Canada               | 1         | (1.684)                         | (0,00)               |
| 48.292.430 SEK     | 4.552.464 US\$      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co     | 15        | (178.787)                       | (0,18)               |
| 3.053.524 SEK      | 279.624 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                             | 1         | (3.077)                         | (0,00)               |
| 351.517 SGD        | 274.358 US\$        | 16.01.2025       | Canadian Imperial Bank of Commerce | 1         | (16.540)                        | (0,02)               |
| 66 SGD             | 51 US\$             | 16.01.2025       | Royal Bank Of Canada               | 1         | (2)                             | (0,00)               |
| 11.573.620 THB     | 357.645 US\$        | 16.01.2025       | Citibank NA                        | 1         | (17.947)                        | (0,02)               |
| 271.359 US\$       | 5.690.572 MXN       | 16.01.2025       | Canadian Imperial Bank of Commerce | 1         | (1.678)                         | (0,00)               |

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (4,48 %) (31. Dezember 2023: (2,94 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                        | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|------------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 142.792 US\$   | 5.276.319 TRY       | 16.01.2025       | Citibank NA                        | 1         | (4.512)                         | (0,00)               |
| 276.824 US\$   | 10.109.629 TRY      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 1         | (5.415)                         | (0,01)               |
| 852.625 US\$   | 3.154.971 ILS       | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co     | 2         | (13.502)                        | (0,01)               |
| 697.615 US\$   | 25.333.193 TRY      | 16.01.2025       | UBS AG                             | 1         | (9.634)                         | (0,01)               |
| 927.773 US\$   | 3.487.500 ILS       | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp               | 1         | (29.642)                        | (0,03)               |
| 5.060.865 ZAR  | 288.539 US\$        | 16.01.2025       | BNP Paribas                        | 1         | (20.674)                        | (0,02)               |
| 5.050.766 ZAR  | 288.781 US\$        | 16.01.2025       | Canadian Imperial Bank of Commerce | 1         | (21.451)                        | (0,02)               |
| 22.639.701 ZAR   | 1.273.480 US\$      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co     | 2         | (75.190)                        | (0,07)               |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                     |                  |                                    |           |                                 |                      |
| 13.403 €   | 19.174 SGD          | 16.01.2025       | BNP Paribas                        | 1         | (177)                           | (0,00)               |
| 949 €  | 33.859 THB          | 16.01.2025       | BNP Paribas                        | 1         | (11)                            | (0,00)               |
| 731.290 €  | 773.230 US\$        | 16.01.2025       | Citibank NA                        | 1         | (15.577)                        | (0,02)               |
| 6.508 €  | 233.899 THB         | 16.01.2025       | Citibank NA                        | 1         | (123)                           | (0,00)               |
| 5.473 €  | 91.973.468 IDR      | 16.01.2025       | Citibank NA                        | 1         | (14)                            | (0,00)               |
| 2.560 €  | 3.627 SGD           | 16.01.2025       | Citibank NA                        | 1         | (8)                             | (0,00)               |
| 253.622 €  | 213.380 £           | 16.01.2025       | Citibank NA                        | 1         | (4.442)                         | (0,00)               |
| 169.462 €  | 254.406 CAD         | 16.01.2025       | Citibank NA                        | 1         | (1.407)                         | (0,00)               |
| 4.665 €  | 53.874 SEK          | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 2         | (46)                            | (0,00)               |
| 62.317 €   | 51.750 £            | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 1         | (241)                           | (0,00)               |
| 854 €  | 14.372.460 IDR      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 1         | (3)                             | (0,00)               |
| 17.291 €   | 374.274 MXN         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 1         | (43)                            | (0,00)               |
| 81.375 €   | 85.679 US\$         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 1         | (1.370)                         | (0,00)               |
| 43.342 €   | 64.690 CAD          | 16.01.2025       | Royal Bank Of Canada               | 1         | (97)                            | (0,00)               |
| 156.313 €  | 1.188.600 CNY       | 16.01.2025       | Royal Bank Of Canada               | 1         | (2.622)                         | (0,00)               |
| 405 €  | 573 SGD             | 16.01.2025       | Royal Bank Of Canada               | 1         | (0)                             | (0,00)               |
| 7.294 €  | 6.040 £             | 16.01.2025       | Royal Bank Of Canada               | 1         | (7)                             | (0,00)               |
| 27.033 €   | 466.647.350 IDR     | 16.01.2025       | Standard Chartered Bank            | 1         | (832)                           | (0,00)               |
| 20.236 €   | 744.250 THB         | 16.01.2025       | Standard Chartered Bank            | 1         | (879)                           | (0,00)               |
| 2.829.722 €  | 3.119.403 US\$      | 16.01.2025       | Standard Chartered Bank            | 1         | (187.668)                       | (0,19)               |
| 610.021 €  | 4.703.506 CNY       | 16.01.2025       | Standard Chartered Bank            | 1         | (19.220)                        | (0,02)               |
| 4.932.086 ¥  | 31.280 €            | 16.01.2025       | Royal Bank Of Canada               | 1         | (976)                           | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>  |                     |                  |                                    |           |                                 |                      |
| 671 £  | 874 US\$            | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co     | 2         | (34)                            | (0,00)               |
| 24.120 £   | 31.597 US\$         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp               | 2         | (1.391)                         | (0,00)               |
| 280 US\$   | 224 £               | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp               | 1         | (0)                             | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen USD</i>  |                     |                  |                                    |           |                                 |                      |
| 67 £   | 85 US\$             | 16.01.2025       | Citibank NA                        | 1         | (2)                             | (0,00)               |
| 10.143 ¥   | 68 US\$             | 16.01.2025       | Royal Bank Of Canada               | 1         | (3)                             | (0,00)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                                    |           | <b>(4.564.309)</b>              | <b>(4,48)</b>        |

## Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Futures-Kontrakte (0,17 %) (31. Dezember 2023: (0,57 %))

| Anzahl Kontrakte   | Beschreibung  | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---|---------------------------------|----------------------|
| 18   | 10-Year Mini Japanese Government Bond Future March 2025 | (3.029)                         | (0,00)               |
| 17   | Euro-BOBL Future March 2025                             | (27.596)                        | (0,03)               |
| 4  | Euro-BTP Future March 2025                              | (10.894)                        | (0,01)               |
| 6  | Euro-Buxl 30-Year Bond Future March 2025                | (54.177)                        | (0,05)               |
| 8  | Euro-OAT Future March 2025                              | (21.621)                        | (0,02)               |
| 25   | Euro-Schatz Future March 2025                           | (12.168)                        | (0,01)               |
| 15   | US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2025        | (19.734)                        | (0,02)               |
| 14   | US Treasury 2-Year Note (CBT) Future March 2025         | (422)                           | (0,00)               |
| 41   | US Treasury 5-Year Note (CBT) Future March 2025         | (20.273)                        | (0,02)               |
| 3  | US Treasury Ultra 10-Year Future March 2025             | (3.703)                         | (0,01)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten *</b> |   | <b>(173.617)</b>                | <b>(0,17)</b>        |

### Zinsswap-Kontrakte (0,02 %) (31. Dezember 2023: (0,00 %))

|   | Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei                   | Erhalt/(Zahlung) <sup>#</sup> | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|-------------|------------|-------------------------------|-------------------------------|-----------------|--------------------|---------------------------------|----------------------|
| CHF   | 495.239     | 03.12.2034 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 0,49 %          | 1D SARON           | (2.498)                         | (0,00)               |
| NOK   | 33.500.000  | 03.12.2027 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 3,46 %          | 6M NIBOR           | (13.726)                        | (0,02)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Zinsswapkontrakten <sup>∞</sup></b> |             |            |                               |                               |                 |                    | <b>(16.224)</b>                 | <b>(0,02)</b>        |

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

|   | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens |
|---|--------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(4.754.150)</b> | <b>(4,67)</b>        |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>96.895.180</b>  | <b>95,24</b>         |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>4.847.078</b>   | <b>4,76</b>          |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>101.742.258</b> | <b>100,00</b>        |

| Portfolioanalyse  | US\$              | % des Gesamtvermögens |
|---|-------------------|-----------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 47.000.963        | 43,64                 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden            | 48.290.942        | 44,85                 |
| † Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente  | 1.751.882         | 1,63                  |
| ± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden                          | 40.547            | 0,04                  |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap                            | (189.154)         | (0,18)                |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>96.895.180</b> | <b>89,98</b>          |

## Global Equity Megatrends - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der Anteile                                 | Wertpapierbezeichnung             | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens |
|--|-----------------------------------|--------------------|----------------------|
| <b>Aktien 95,15 % (31. Dezember 2023: 97,93 %)</b> |                                   |                    |                      |
| <b>Kanadischer Dollar</b>                          |                                   |                    |                      |
| 843.973  | Element Fleet Management Corp     | 17.053.161         | 3,29                 |
| <b>Kanadischer Dollar insgesamt</b>                |                                   | <b>17.053.161</b>  | <b>3,29</b>          |
| <b>Britisches Pfund</b>                            |                                   |                    |                      |
| 10.853.647   | Pets at Home Group Plc            | 27.947.428         | 5,39                 |
| <b>Britisches Pfund insgesamt</b>                  |                                   | <b>27.947.428</b>  | <b>5,39</b>          |
| <b>US-Dollar</b>                                   |                                   |                    |                      |
| 359.829  | Alibaba Group Holding Ltd ADR     | 30.509.901         | 5,88                 |
| 95.814   | Alphabet Inc Class A              | 18.137.590         | 3,50                 |
| 331.936  | Amdocs Ltd                        | 28.261.031         | 5,45                 |
| 241.860  | ATI Inc                           | 13.311.974         | 2,57                 |
| 130.338  | Chart Industries Inc              | 24.873.704         | 4,80                 |
| 419.480  | Cisco Systems Inc                 | 24.833.216         | 4,79                 |
| 457.526  | Corning Inc                       | 21.741.636         | 4,19                 |
| 855.660  | Criteo SA ADR                     | 33.849.910         | 6,53                 |
| 378.751  | Delta Air Lines Inc               | 22.914.436         | 4,42                 |
| 1.335.884  | Despegar.com Corp                 | 25.715.767         | 4,96                 |
| 518.712  | Element Solutions Inc             | 13.190.846         | 2,54                 |
| 137.103  | Expedia Group Inc                 | 25.546.402         | 4,92                 |
| 589.643  | Gen Digital Inc                   | 16.144.425         | 3,11                 |
| 798.147  | ModivCare Inc                     | 9.450.060          | 1,82                 |
| 160.875  | Nice Ltd ADR                      | 27.323.010         | 5,27                 |
| 1.107.017  | Perrigo Co Plc                    | 28.461.407         | 5,49                 |
| 549.916  | Scholastic Corp                   | 11.729.708         | 2,26                 |
| 336.163  | Tetra Tech Inc                    | 13.392.734         | 2,58                 |
| 378.913  | Uber Technologies Inc             | 22.856.032         | 4,41                 |
| 143.155  | Vistra Corp                       | 19.736.780         | 3,80                 |
| 915.848  | Zeta Global Holdings Corp Class A | 16.476.106         | 3,18                 |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>                         |                                   | <b>448.456.675</b> | <b>86,47</b>         |
| <b>Aktien insgesamt *</b>                          |                                   | <b>493.457.264</b> | <b>95,15</b>         |
| <b>Anlagen insgesamt</b>                           |                                   | <b>493.457.264</b> | <b>95,15</b>         |

### Devisenterminkontrakte 0,01 % (31. Dezember 2023: 0,00 %)

| Geforderter Betrag              | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i> |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 72 SGD                          | 53 US\$             | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 1         | 0                              | 0,00                 |
| 59.670 US\$                     | 79.981 SGD          | 16.01.2025       | Standard Chartered Bank        | 1         | 1.009                          | 0,00                 |
| 734.224 US\$                    | 991.304 SGD         | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 7         | 7.158                          | 0,00                 |

## Global Equity Megatrends - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Devisenterminkontrakte 0,01 % (31. Dezember 2023: 0,00 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei          | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens        |
|--|---------------------|------------------|----------------------|-----------|--------------------------------|-----------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen SGD (Fortsetzung)</i>  |                     |                  |                      |           |                                |                             |
| 1.582.290 US\$   | 2.122.231 SGD       | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp | 36        | 25.752                         | 0,01                        |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>                        |                     |                  |                      |           | <b>33.919</b>                  | <b>0,01</b>                 |
|  |                     |                  |                      |           | <b>Zeitwert US\$</b>           | <b>% des Nettovermögens</b> |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |                     |                  |                      |           | <b>493.491.183</b>             | <b>95,16</b>                |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

## Devisenterminkontrakte (0,05 %) (31. Dezember 2023: (0,00 %))

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens         |
|---|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|------------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen HKD</i>   |                     |                  |                                |           |                                 |                              |
| 233.110 HKD   | 30.012 US\$         | 16.01.2025       | Standard Chartered Bank        | 1         | (1)                             | (0,00)                       |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>   |                     |                  |                                |           |                                 |                              |
| 1.209.168 SGD   | 931.266 US\$        | 16.01.2025       | Standard Chartered Bank        | 2         | (44.409)                        | (0,01)                       |
| 598.391 SGD   | 448.787 US\$        | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 11        | (9.899)                         | (0,00)                       |
| 14.485.524 SGD  | 10.818.762 US\$     | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 74        | (194.442)                       | (0,04)                       |
| 140.617 US\$  | 192.131 SGD         | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (300)                           | (0,00)                       |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>                          |                     |                  |                                |           | <b>(249.051)</b>                | <b>(0,05)</b>                |
|   |                     |                  |                                |           | <b>Zeitwert US\$</b>            | <b>% des Nettovermögens</b>  |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> |                     |                  |                                |           | <b>(249.051)</b>                | <b>(0,05)</b>                |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              |                     |                  |                                |           | <b>493.242.132</b>              | <b>95,11</b>                 |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  |                     |                  |                                |           | <b>25.382.495</b>               | <b>4,89</b>                  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   |                     |                  |                                |           | <b>518.624.627</b>              | <b>100,00</b>                |
| <b>Portfolioanalyse</b>   |                     |                  |                                |           | <b>US\$</b>                     | <b>% des Gesamtvermögens</b> |
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind   |                     |                  |                                |           | 493.457.264                     | 94,38                        |
| <sup>∞</sup> OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente  |                     |                  |                                |           | (215.132)                       | (0,04)                       |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  |                     |                  |                                |           | <b>493.242.132</b>              | <b>94,34</b>                 |

## Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der Anteile   | Wertpapierbezeichnung  |         |                  | Zeitwert US\$    | % des Nettovermögens |
|--|--|---------|------------------|------------------|----------------------|
| <b>Aktien 1,48 % (31. Dezember 2023: 1,54 %)</b>   |  |         |                  |                  |                      |
| <b>US-Dollar</b>   |  |         |                  |                  |                      |
| 5.000  | McAfee LLC   |         |                  | 6.584.306        | 1,48                 |
| <b>Aktien insgesamt *</b>  |  |         |                  | <b>6.584.306</b> | <b>1,48</b>          |
| Kapitalbetrag  | Wertpapierbezeichnung  | Kupon   | Fälligkeitsdatum | Zeitwert US\$    | % des Nettovermögens |
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 14,66 % (31. Dezember 2023: 5,92 %)</b> |  |         |                  |                  |                      |
| <b>Euro</b>  |  |         |                  |                  |                      |
| 730.000  | Kinbane DAC Series 2024-RPL1X Class C                                | 5,35 %  | 26.01.2065       | 738.922          | 0,17                 |
| 1.000.000  | Miltonia Mortgage Finance Srl Series 1 Class B                       | 4,37 %  | 28.04.2062       | 1.033.670        | 0,23                 |
| 120.000  | Shamrock Residential DAC Series 2024-1X Class C                      | 5,09 %  | 24.12.2078       | 123.295          | 0,03                 |
| 370.000  | Shamrock Residential DAC Series 2024-1X Class D                      | 5,89 %  | 24.12.2078       | 381.606          | 0,08                 |
| 207.000  | Thunder Logistics DAC Series 2024-1X Class C                         | 5,26 %  | 17.11.2036       | 216.215          | 0,05                 |
| 340.000  | Thunder Logistics DAC Series 2024-1X Class D                         | 6,01 %  | 17.11.2036       | 354.715          | 0,08                 |
| <b>Euro insgesamt</b>  |  |         |                  | <b>2.848.423</b> | <b>0,64</b>          |
| <b>Britisches Pfund</b>  |  |         |                  |                  |                      |
| 967.000  | Vantage Data Centers Jersey Borrower Spv Ltd Series 2024-1A Class A2 | 6,17 %  | 28.05.2039       | 1.233.434        | 0,28                 |
| <b>Britisches Pfund insgesamt</b>  |  |         |                  | <b>1.233.434</b> | <b>0,28</b>          |
| <b>US-Dollar</b>   |  |         |                  |                  |                      |
| 563.000  | 1211 Avenue of the Americas Trust 2015-1211 Class B                  | 4,09 %  | 10.08.2035       | 554.935          | 0,13                 |
| 2.000.000  | AGL CLO 19 Ltd Series 2022-19X Class E                               | 12,30 % | 21.07.2035       | 2.027.993        | 0,46                 |
| 2.000.000  | AGL CLO 9 Ltd Series 2020-9X Class DR                                | 7,84 %  | 20.04.2037       | 2.048.068        | 0,46                 |
| 2.500.000  | AIMCO CLO 16 Ltd Series 2021-16X Class D1R                           | 7,20 %  | 17.07.2037       | 2.551.550        | 0,57                 |
| 1.000.000  | Bain Capital Credit CLO 2024-2 Ltd Series 2024-2X Class D1           | 8,00 %  | 15.07.2037       | 1.026.181        | 0,23                 |
| 2.000.000  | Ballyrock CLO 26 Ltd Series 2024-26X Class C1                        | 8,63 %  | 25.07.2037       | 2.027.849        | 0,46                 |
| 1.625.000  | Benefit Street Partners CLO XXXV Ltd Series 2024-35X Class D         | 7,93 %  | 25.04.2037       | 1.658.924        | 0,37                 |
| 494.000  | BXP Trust 2017-GM Class C  | 3,42 %  | 13.06.2039       | 464.043          | 0,10                 |
| 565.000  | BXP Trust 2017-GM Class D  | 3,42 %  | 13.06.2039       | 525.445          | 0,12                 |
| 2.000.000  | Canyon CLO 2023-2 Ltd Series 2023-2X Class D                         | 7,90 %  | 15.05.2037       | 2.048.433        | 0,46                 |
| 1.400.000  | Captree Park CLO Ltd Series 2024-1X Class D                          | 7,54 %  | 20.07.2037       | 1.429.263        | 0,32                 |
| 202.000  | CD 2017-CD5 Mortgage Trust Class C                                   | 4,12 %  | 15.08.2050       | 187.834          | 0,04                 |
| 291.000  | Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-375P Class C                | 3,52 %  | 10.05.2035       | 281.797          | 0,06                 |
| 330.385  | COLT 2024-2 Mortgage Loan Trust Class A2                             | 6,33 %  | 25.04.2069       | 332.073          | 0,07                 |
| 264.475  | COLT 2024-2 Mortgage Loan Trust Class A3                             | 6,43 %  | 25.04.2069       | 265.928          | 0,06                 |
| 584.000  | COMM 2013-CCRE8 Mortgage Trust Class D                               | 3,52 %  | 10.06.2046       | 575.429          | 0,13                 |
| 167.000  | COMM 2013-CCRE8 Mortgage Trust Class E                               | 4,00 %  | 10.06.2046       | 163.806          | 0,04                 |
| 745.000  | Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01 Class 1B1               | 7,67 %  | 25.10.2041       | 766.409          | 0,17                 |
| 925.000  | Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R02 Class 2B1               | 9,07 %  | 25.01.2042       | 977.821          | 0,22                 |
| 390.000  | Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R02 Class 2M2               | 7,57 %  | 25.01.2042       | 400.533          | 0,09                 |

## Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 14,66 % (31. Dezember 2023: 5,92 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 157.000  | Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R02 Class 1B1                        | 10,12 % | 25.01.2043            | 172.563          | 0,04                         |
| 415.000  | Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R04 Class 1B1                        | 9,91 %  | 25.05.2043            | 457.029          | 0,10                         |
| 329.000  | Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R05 Class 1B1                        | 9,31 %  | 25.06.2043            | 358.989          | 0,08                         |
| 628.000  | Connecticut Avenue Securities Trust 2024-R01 Class 1B1                        | 7,27 %  | 25.01.2044            | 645.122          | 0,15                         |
| 191.000  | Eleven Madison Trust 2015-11MD Mortgage Trust Class A                         | 3,55 %  | 10.09.2035            | 187.018          | 0,04                         |
| 500.000  | Eleven Madison Trust 2015-11MD Mortgage Trust Class D                         | 3,55 %  | 10.09.2035            | 475.965          | 0,11                         |
| 1.500.000  | Flatiron CLO 25 Ltd Series 2024-2X Class D                                    | 7,12 %  | 17.10.2037            | 1.530.945        | 0,34                         |
| 286.000  | Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA6 Class B1                              | 7,97 %  | 25.10.2041            | 295.533          | 0,07                         |
| 847.000  | Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA7 Class B1                              | 8,22 %  | 25.11.2041            | 881.358          | 0,20                         |
| 265.000  | Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-HQA3 Class M2                              | 6,67 %  | 25.09.2041            | 267.088          | 0,06                         |
| 953.000  | Freddie Mac STACR REMIC Trust 2024-HQA1 Class M2                              | 6,57 %  | 25.03.2044            | 968.644          | 0,22                         |
| 1.625.000  | GoldenTree Loan Management US CLO 20 Ltd Series 2024-20X Class D              | 7,44 %  | 20.07.2037            | 1.657.841        | 0,37                         |
| 2.000.000  | GoldenTree Loan Management US CLO 9 Ltd Series 2021-9X Class DR               | 7,64 %  | 20.04.2037            | 2.038.688        | 0,46                         |
| 180.000  | GS Mortgage Securities Trust 2015-GS1 Class AS                                | 4,04 %  | 10.11.2048            | 169.877          | 0,04                         |
| 519.000  | GS Mortgage Securities Trust 2016-GS2 Class C                                 | 4,70 %  | 10.05.2049            | 500.171          | 0,11                         |
| 359.000  | GS Mortgage Securities Trust 2016-GS4 Class B                                 | 3,85 %  | 10.11.2049            | 324.544          | 0,07                         |
| 577.000  | GS Mortgage Securities Trust 2017-GS6 Class B                                 | 3,87 %  | 10.05.2050            | 494.596          | 0,11                         |
| 1.125.000  | Invesco CLO Ltd Series 2021-3X Class D  | 7,55 %  | 22.10.2034            | 1.135.093        | 0,26                         |
| 2.000.000  | Invesco US CLO 2024-2 Ltd Series 2024-2X Class D                              | 7,90 %  | 15.07.2037            | 2.048.509        | 0,46                         |
| 1.500.000  | Invesco US CLO 2024-3 Ltd Series 2024-3X Class D                              | 7,84 %  | 20.07.2037            | 1.536.342        | 0,35                         |
| 130.000  | JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust Series 2016-NINE Class B | 2,85 %  | 06.09.2038            | 124.183          | 0,03                         |
| 316.610  | JP Morgan Mortgage Trust 2024-HE1 Class A1                                    | 6,10 %  | 25.08.2054            | 318.643          | 0,07                         |
| 209.000  | JP Morgan Mortgage Trust 2024-HE1 Class M1                                    | 6,60 %  | 25.08.2054            | 210.174          | 0,05                         |
| 159.000  | JP Morgan Mortgage Trust 2024-HE1 Class M2                                    | 7,00 %  | 25.08.2054            | 160.277          | 0,04                         |
| 449.973  | JP Morgan Mortgage Trust 2024-HE2 Class A1                                    | 5,80 %  | 20.10.2054            | 451.309          | 0,10                         |
| 319.000  | JP Morgan Mortgage Trust 2024-HE2 Class M1                                    | 6,30 %  | 20.10.2054            | 320.530          | 0,07                         |
| 65.000   | JP Morgan Mortgage Trust Series 2023-HE3 Class M2                             | 7,10 %  | 25.05.2054            | 65.939           | 0,02                         |
| 629.000  | MetroNet Infrastructure Issuer LLC Class A2                                   | 6,23 %  | 20.04.2054            | 642.408          | 0,14                         |
| 441.000  | MetroNet Infrastructure Issuer LLC Class B                                    | 7,59 %  | 20.04.2054            | 454.078          | 0,10                         |
| 160.000  | MetroNet Infrastructure Issuer LLC Series 2022-1A Class A2                    | 6,35 %  | 20.10.2052            | 162.975          | 0,04                         |
| 580.000  | Morgan Stanley Capital I Trust 2017-H1 Class C                                | 4,28 %  | 15.06.2050            | 518.219          | 0,12                         |
| 547.000  | Morgan Stanley Capital I Trust 2018-H3 Class AS                               | 4,43 %  | 15.07.2051            | 527.123          | 0,12                         |
| 279.000  | Morgan Stanley Capital I Trust 2018-H4 Class C                                | 5,05 %  | 15.12.2051            | 249.706          | 0,06                         |
| 659.000  | Morgan Stanley Capital I Trust 2018-L1 Class AS                               | 4,64 %  | 15.10.2051            | 638.853          | 0,14                         |
| 667.042  | NRM Excess LLC Series 2024-FNT1 Class A                                       | 7,40 %  | 25.11.2031            | 671.601          | 0,15                         |
| 2.000.000  | Oaktree CLO 2024-26 Ltd Series 2024-26X Class D1                              | 7,74 %  | 20.04.2037            | 2.048.252        | 0,46                         |
| 729.303  | OBX Trust Series 2023-NQM7 Class A1   | 6,84 %  | 25.04.2063            | 740.231          | 0,17                         |
| 728.374  | OBX Trust Series 2024-NQM4 Class A1   | 6,07 %  | 25.01.2064            | 732.616          | 0,16                         |
| 2.000.000  | OCP CLO Ltd Series 2024-38X Class D1  | 7,15 %  | 21.01.2038            | 2.007.876        | 0,45                         |

## Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 14,66 % (31. Dezember 2023: 5,92 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                   |                              |
| 500.000  | Octagon Investment Partners 35 Ltd Series 2018-1X Class C     | 7,15 %  | 20.01.2031            | 501.416           | 0,11                         |
| 237.396  | One Market Plaza Trust 2017-1MKT Class A                      | 3,61 %  | 10.02.2032            | 222.093           | 0,05                         |
| 577.000  | One Market Plaza Trust 2017-1MKT Class D                      | 4,15 %  | 10.02.2032            | 501.891           | 0,11                         |
| 525.000  | Shops at Crystals Trust 2016-CSTL Class D                     | 3,73 %  | 05.07.2036            | 505.588           | 0,11                         |
| 7.756  | SoFi Professional Loan Program 2017-D LLC Class A2FX          | 2,65 %  | 25.09.2040            | 7.617             | 0,00                         |
| 88.311   | SoFi Professional Loan Program 2017-E LLC Class B             | 3,49 %  | 26.11.2040            | 86.706            | 0,02                         |
| 1.500.000  | Symphony CLO 30 Ltd Series 2023-30X Class D1R                 | 7,84 %  | 20.10.2037            | 1.536.132         | 0,35                         |
| 1.000.000  | Symphony CLO 43 Ltd Series 2024-43X Class E                   | 11,05 % | 15.04.2037            | 1.040.788         | 0,23                         |
| 150.000  | Taco Bell Funding LLC Series 2016-1A Class A23                | 4,97 %  | 25.05.2046            | 149.824           | 0,03                         |
| 905.828  | Taco Bell Funding LLC Series 2018-1A Class A2II               | 4,94 %  | 25.11.2048            | 891.392           | 0,20                         |
| 401.000  | Trafigura Securitisation Finance Plc Series 2024-1A Class A2  | 5,98 %  | 15.11.2027            | 406.741           | 0,09                         |
| 590.000  | Trafigura Securitisation Finance Plc Series 2024-1A Class B   | 7,29 %  | 15.11.2027            | 592.644           | 0,13                         |
| 1.000.000  | Trinitas CLO VII Ltd Series 2017-7X Class D1R                 | 8,39 %  | 25.01.2035            | 1.009.532         | 0,23                         |
| 2.000.000  | Trinitas CLO XXXI Ltd Series 2024-31X Class D1                | 7,38 %  | 22.01.2038            | 2.051.543         | 0,46                         |
| 636.631  | Volofin Finance Designated Activity Co Series 2024-1A Class A | 5,94 %  | 15.06.2037            | 638.660           | 0,14                         |
| 263.400  | Volofin Finance Designated Activity Co Series 2024-1A Class B | 6,21 %  | 15.06.2037            | 263.713           | 0,06                         |
| 2.000.000  | Voya CLO Ltd Series 2024-7X Class D1                          | 7,14 %  | 20.01.2038            | 2.007.882         | 0,45                         |
| 390.000  | Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS4 Class C       | 4,67 %  | 15.12.2048            | 376.952           | 0,09                         |
| 550.000  | Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-NXS6 Class C       | 4,39 %  | 15.11.2049            | 513.786           | 0,12                         |
| 362.000  | Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C39 Class C        | 4,12 %  | 15.09.2050            | 327.926           | 0,07                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |   |         |                       | <b>61.138.048</b> | <b>13,74</b>                 |
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) insgesamt **</b>                                      |   |         |                       | <b>65.219.905</b> | <b>14,66</b>                 |
| <b>Unternehmensanleihen 71,64 % (31. Dezember 2023: 75,85 %)</b>   |   |         |                       |                   |                              |
| <b>Euro</b>  |   |         |                       |                   |                              |
| 378.000  | A2A SpA*  | 5,00 %  | 31.12.2149            | 406.047           | 0,09                         |
| 300.000  | Abertis Infraestructuras Finance BV*                          | 4,87 %  | 31.12.2149            | 319.620           | 0,07                         |
| 600.000  | ABN AMRO Bank NV*   | 4,75 %  | 31.12.2149            | 613.207           | 0,14                         |
| 400.000  | Ahlstrom Holding 3 Oy*  | 3,63 %  | 04.02.2028            | 409.912           | 0,09                         |
| 500.000  | Air France-KLM*   | 4,63 %  | 23.05.2029            | 534.592           | 0,12                         |
| 350.000  | Allwyn International AS**                                     | 3,88 %  | 15.02.2027            | 363.396           | 0,08                         |
| 500.000  | Amber Finco Plc*  | 6,63 %  | 15.07.2029            | 549.364           | 0,12                         |
| 300.000  | American Tower Corp*  | 0,50 %  | 15.01.2028            | 289.196           | 0,07                         |
| 392.000  | ASK Chemicals Deutschland Holding GmbH**                      | 10,00 % | 15.11.2029            | 401.640           | 0,09                         |
| 600.000  | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA*                           | 8,38 %  | 31.12.2149            | 685.869           | 0,15                         |
| 400.000  | Banco de Credito Social Cooperativo SA*                       | 4,13 %  | 03.09.2030            | 427.209           | 0,10                         |
| 600.000  | Banco Santander SA*   | 4,13 %  | 31.12.2149            | 597.877           | 0,13                         |
| 600.000  | Banco Santander SA*   | 4,38 %  | 31.12.2149            | 618.806           | 0,14                         |
| 402.000  | Banjay Entertainment SAS**                                    | 7,00 %  | 01.05.2029            | 440.207           | 0,10                         |
| 600.000  | Bayer AG*   | 5,38 %  | 25.03.2082            | 610.306           | 0,14                         |

## Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                     | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 71,64 % (31. Dezember 2023: 75,85 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |   |         |                       |                  |                              |
| 300.000  | Bayer AG*                                 | 5,50 %  | 13.09.2054            | 311.860          | 0,07                         |
| 799.000  | BCP V Modular Services Finance Plc**      | 6,75 %  | 30.11.2029            | 752.470          | 0,17                         |
| 500.000  | Benteler International AG*                | 9,38 %  | 15.05.2028            | 547.655          | 0,12                         |
| 350.000  | Bertrand Franchise Finance SAS*           | 6,96 %  | 18.07.2030            | 366.067          | 0,08                         |
| 500.000  | Birkenstock Financing Sarl*               | 5,25 %  | 30.04.2029            | 526.757          | 0,12                         |
| 405.000  | Boels Topholding BV**                     | 5,75 %  | 15.05.2030            | 439.709          | 0,10                         |
| 700.000  | BPCE SA*                                  | 5,13 %  | 25.01.2035            | 758.648          | 0,17                         |
| 528.000  | Bubbles Bidco SpA**                       | 6,50 %  | 30.09.2031            | 551.896          | 0,12                         |
| 600.000  | CaixaBank SA*                             | 3,63 %  | 31.12.2149            | 576.194          | 0,13                         |
| 800.000  | Castellum AB*                             | 3,13 %  | 31.12.2149            | 799.732          | 0,18                         |
| 900.000  | CECONOMY AG*                              | 6,25 %  | 15.07.2029            | 967.744          | 0,22                         |
| 350.000  | Cheplapharm Arzneimittel GmbH**           | 7,50 %  | 15.05.2030            | 357.668          | 0,08                         |
| 500.000  | Cirsa Finance International Sarl*         | 4,50 %  | 15.03.2027            | 517.543          | 0,12                         |
| 539.100  | Cirsa Finance International Sarl*         | 10,38 % | 30.11.2027            | 591.984          | 0,13                         |
| 500.000  | Clarios Global LP/Clarios US Finance Co** | 4,38 %  | 15.05.2026            | 519.928          | 0,12                         |
| 600.000  | Commerzbank AG*                           | 4,25 %  | 31.12.2149            | 589.458          | 0,13                         |
| 600.000  | Commerzbank AG*                           | 6,50 %  | 31.12.2149            | 645.124          | 0,15                         |
| 600.000  | Cooperatieve Rabobank UA*                 | 3,25 %  | 31.12.2149            | 604.264          | 0,14                         |
| 200.000  | CPI Property Group SA*                    | 1,75 %  | 14.01.2030            | 175.113          | 0,04                         |
| 200.000  | CPI Property Group SA*                    | 3,75 %  | 31.12.2149            | 185.082          | 0,04                         |
| 500.000  | CPI Property Group SA*                    | 4,88 %  | 31.12.2149            | 502.374          | 0,11                         |
| 797.000  | CPI Property Group SA*                    | 6,00 %  | 27.01.2032            | 832.356          | 0,19                         |
| 500.000  | Credit Agricole SA*                       | 6,50 %  | 31.12.2149            | 537.547          | 0,12                         |
| 200.000  | Crelan SA*                                | 5,38 %  | 30.04.2035            | 218.155          | 0,05                         |
| 500.000  | CT Investment GmbH*                       | 6,38 %  | 15.04.2030            | 541.734          | 0,12                         |
| 750.000  | Ctec II GmbH**                            | 5,25 %  | 15.02.2030            | 720.395          | 0,16                         |
| 750.000  | Cullinan Holdco Scsp**                    | 4,63 %  | 15.10.2026            | 733.600          | 0,16                         |
| 900.000  | Digital Dutch Finco BV*                   | 1,25 %  | 01.02.2031            | 823.009          | 0,18                         |
| 600.000  | Electricite de France SA*                 | 2,63 %  | 31.12.2149            | 588.352          | 0,13                         |
| 400.000  | Electricite de France SA*                 | 5,63 %  | 31.12.2149            | 429.650          | 0,10                         |
| 800.000  | Electricite de France SA*                 | 7,50 %  | 31.12.2149            | 917.348          | 0,21                         |
| 400.000  | Elior Group SA*                           | 3,75 %  | 15.07.2026            | 412.090          | 0,09                         |
| 599.000  | Energia Group Roi Financeco DAC**         | 6,88 %  | 31.07.2028            | 652.032          | 0,15                         |
| 500.000  | Energizer Gamma Acquisition BV**          | 3,50 %  | 30.06.2029            | 500.635          | 0,11                         |
| 548.000  | Ephios Subco 3 Sarl**                     | 7,88 %  | 31.01.2031            | 620.557          | 0,14                         |
| 750.000  | Eroski S Coop*                            | 10,63 % | 30.04.2029            | 848.463          | 0,19                         |
| 600.000  | Erste Group Bank AG*                      | 4,25 %  | 31.12.2149            | 600.766          | 0,14                         |
| 400.000  | Eurofins Scientific SE*                   | 6,75 %  | 31.12.2149            | 437.246          | 0,10                         |
| 1.430.000  | Fastighets AB Balder*                     | 2,87 %  | 02.06.2081            | 1.447.448        | 0,33                         |
| 600.000  | Fedrigoni SpA**                           | 6,13 %  | 15.06.2031            | 626.544          | 0,14                         |

## Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 71,64 % (31. Dezember 2023: 75,85 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |  |         |                       |                  |                              |
| 400.000  | Fiber Midco SpA <sup>*</sup>                         | 10,00 % | 15.06.2029            | 430.913          | 0,10                         |
| 322.000  | Flutter Treasury DAC <sup>*</sup>                    | 5,00 %  | 29.04.2029            | 349.025          | 0,08                         |
| 750.000  | Fnac Darty SA <sup>*</sup>                           | 6,00 %  | 01.04.2029            | 816.557          | 0,18                         |
| 250.000  | Forvia SE <sup>*</sup>                               | 3,75 %  | 15.06.2028            | 252.689          | 0,06                         |
| 251.000  | Forvia SE <sup>*</sup>                               | 5,50 %  | 15.06.2031            | 260.071          | 0,06                         |
| 421.000  | Fressnapf Holding SE <sup>**</sup>                   | 5,25 %  | 31.10.2031            | 451.027          | 0,10                         |
| 213.368  | Globalworth Real Estate Investments Ltd <sup>*</sup> | 6,25 %  | 31.03.2029            | 222.619          | 0,05                         |
| 235.001  | Globalworth Real Estate Investments Ltd <sup>*</sup> | 6,25 %  | 31.03.2030            | 244.849          | 0,06                         |
| 980.000  | Grifols SA <sup>*</sup>                              | 3,88 %  | 15.10.2028            | 920.462          | 0,21                         |
| 200.000  | Grifols SA <sup>*</sup>                              | 7,50 %  | 01.05.2030            | 217.672          | 0,05                         |
| 349.000  | Gruenthal GmbH <sup>**</sup>                         | 4,13 %  | 15.05.2028            | 364.190          | 0,08                         |
| 500.000  | Guala Closures SpA <sup>*</sup>                      | 3,25 %  | 15.06.2028            | 501.263          | 0,11                         |
| 300.000  | Heimstaden AB <sup>*</sup>                           | 4,38 %  | 06.03.2027            | 286.504          | 0,06                         |
| 250.000  | Heimstaden Bostad AB <sup>*</sup>                    | 2,63 %  | 31.12.2149            | 241.077          | 0,05                         |
| 398.000  | Heimstaden Bostad AB <sup>*</sup>                    | 6,25 %  | 31.12.2149            | 415.818          | 0,09                         |
| 1.300.000  | Heimstaden Bostad Treasury BV <sup>*</sup>           | 0,75 %  | 06.09.2029            | 1.171.239        | 0,26                         |
| 615.000  | HSBC Holdings Plc <sup>*</sup>                       | 4,75 %  | 31.12.2149            | 631.701          | 0,14                         |
| 602.000  | IHO Verwaltungs GmbH <sup>*</sup>                    | 8,75 %  | 15.05.2028            | 660.773          | 0,15                         |
| 285.000  | Iliad Holding SASU <sup>**</sup>                     | 5,38 %  | 15.04.2030            | 304.375          | 0,07                         |
| 1.000.000  | Iliad Holding SASU <sup>**</sup>                     | 5,63 %  | 15.10.2028            | 1.064.105        | 0,24                         |
| 646.000  | INEOS Finance Plc <sup>*</sup>                       | 6,38 %  | 15.04.2029            | 704.383          | 0,16                         |
| 498.000  | INEOS Quattro Finance 2 Plc <sup>*</sup>             | 8,50 %  | 15.03.2029            | 554.340          | 0,12                         |
| 500.000  | Intesa Sanpaolo SpA <sup>*</sup>                     | 3,75 %  | 31.12.2149            | 519.044          | 0,12                         |
| 100.000  | Kronos International Inc <sup>**</sup>               | 3,75 %  | 15.09.2025            | 103.279          | 0,02                         |
| 402.000  | Kronos International Inc <sup>**</sup>               | 9,50 %  | 15.03.2029            | 459.179          | 0,10                         |
| 900.000  | Lorca Telecom Bondco SA <sup>*</sup>                 | 4,00 %  | 18.09.2027            | 936.610          | 0,21                         |
| 573.000  | Lottomatica Group SpA <sup>**</sup>                  | 5,38 %  | 01.06.2030            | 618.762          | 0,14                         |
| 900.000  | Loxam SAS <sup>*</sup>                               | 5,75 %  | 15.07.2027            | 934.152          | 0,21                         |
| 500.000  | Lune Holdings Sarl <sup>**</sup>                     | 5,63 %  | 15.11.2028            | 395.439          | 0,09                         |
| 350.000  | Manuchar Group Sarl <sup>**</sup>                    | 7,25 %  | 30.06.2027            | 357.844          | 0,08                         |
| 400.000  | Monitchem HoldCo 3 SA <sup>*</sup>                   | 8,75 %  | 01.05.2028            | 429.496          | 0,10                         |
| 850.000  | Motion Finco Sarl <sup>*</sup>                       | 7,38 %  | 15.06.2030            | 897.484          | 0,20                         |
| 200.000  | MSD Netherlands Capital BV <sup>*</sup>              | 3,75 %  | 30.05.2054            | 204.711          | 0,05                         |
| 461.000  | Nidda Healthcare Holding GmbH <sup>**</sup>          | 5,63 %  | 21.02.2030            | 494.785          | 0,11                         |
| 660.595  | Nidda Healthcare Holding GmbH <sup>**</sup>          | 7,50 %  | 21.08.2026            | 707.988          | 0,16                         |
| 400.000  | Norddeutsche Landesbank-Girozentrale <sup>*</sup>    | 5,63 %  | 23.08.2034            | 430.449          | 0,10                         |
| 750.000  | Odido Group Holding BV <sup>**</sup>                 | 5,50 %  | 15.01.2030            | 774.301          | 0,17                         |
| 502.000  | OEG Finance Plc <sup>**</sup>                        | 7,25 %  | 27.09.2029            | 545.825          | 0,12                         |
| 1.000.000  | Olympus Water US Holding Corp <sup>*</sup>           | 3,88 %  | 01.10.2028            | 1.014.627        | 0,23                         |
| 798.000  | Optics Bidco SpA <sup>*</sup>                        | 7,88 %  | 31.07.2028            | 935.608          | 0,21                         |

## Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                          | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|--|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 71,64 % (31. Dezember 2023: 75,85 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                   |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |  |         |                       |                   |                              |
| 252.000  | Pachelbel Bidco SpA**                          | 7,13 %  | 17.05.2031            | 280.207           | 0,06                         |
| 600.000  | PEU Finance Plc*                               | 7,25 %  | 01.07.2028            | 653.750           | 0,15                         |
| 602.000  | Playtech Plc*                                  | 5,88 %  | 28.06.2028            | 649.679           | 0,15                         |
| 600.000  | ProGroup AG*                                   | 5,38 %  | 15.04.2031            | 608.659           | 0,14                         |
| 400.000  | Proximus SADP*                                 | 4,75 %  | 31.12.2149            | 414.718           | 0,09                         |
| 550.000  | Rakuten Group Inc*                             | 4,25 %  | 31.12.2149            | 535.268           | 0,12                         |
| 500.000  | RAY Financing LLC**                            | 6,50 %  | 15.07.2031            | 543.565           | 0,12                         |
| 498.000  | Rossini Sarl*                                  | 6,75 %  | 31.12.2029            | 547.767           | 0,12                         |
| 500.000  | Schaeffler AG*                                 | 4,50 %  | 28.03.2030            | 522.500           | 0,12                         |
| 135.158  | Summer BC Holdco A Sarl**                      | 9,25 %  | 31.10.2027            | 141.356           | 0,03                         |
| 600.000  | Summer BC Holdco B Sarl**                      | 5,75 %  | 31.10.2026            | 623.009           | 0,14                         |
| 500.000  | Synthomer Plc*                                 | 7,38 %  | 02.05.2029            | 542.936           | 0,12                         |
| 400.000  | TAG Immobilien AG*                             | 4,25 %  | 04.03.2030            | 423.028           | 0,10                         |
| 439.599  | Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH**       | 6,00 %  | 30.07.2026            | 457.894           | 0,10                         |
| 800.000  | Telefonica Europe BV*                          | 5,75 %  | 31.12.2149            | 890.530           | 0,20                         |
| 500.000  | Telefonica Europe BV*                          | 6,14 %  | 31.12.2149            | 561.438           | 0,13                         |
| 500.000  | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV* | 3,75 %  | 09.05.2027            | 523.383           | 0,12                         |
| 425.000  | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV* | 7,38 %  | 15.09.2029            | 508.566           | 0,11                         |
| 307.000  | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV* | 7,88 %  | 15.09.2031            | 387.804           | 0,09                         |
| 331.000  | Timken Co*                                     | 4,13 %  | 23.05.2034            | 343.365           | 0,08                         |
| 1.155.000  | TK Elevator Midco GmbH**                       | 4,38 %  | 15.07.2027            | 1.198.970         | 0,27                         |
| 400.000  | Transportes Aereos Portugueses SA*             | 5,13 %  | 15.11.2029            | 425.459           | 0,10                         |
| 500.000  | UGI International LLC**                        | 2,50 %  | 01.12.2029            | 484.355           | 0,11                         |
| 600.000  | UniCredit SpA**                                | 3,88 %  | 31.12.2149            | 604.043           | 0,14                         |
| 700.000  | United Group BV**                              | 6,50 %  | 31.10.2031            | 741.264           | 0,17                         |
| 400.000  | Verisure Holding AB*                           | 3,25 %  | 15.02.2027            | 409.993           | 0,09                         |
| 400.000  | Verisure Holding AB*                           | 5,50 %  | 15.05.2030            | 433.000           | 0,10                         |
| 801.000  | Verisure Midholding AB*                        | 5,25 %  | 15.02.2029            | 834.168           | 0,19                         |
| 200.000  | Volkswagen International Finance NV*           | 3,88 %  | 31.12.2149            | 193.752           | 0,04                         |
| 400.000  | Volkswagen International Finance NV*           | 4,63 %  | 31.12.2149            | 407.573           | 0,09                         |
| 400.000  | Walgreens Boots Alliance Inc*                  | 2,13 %  | 20.11.2026            | 400.521           | 0,09                         |
| 700.000  | Warnermedia Holdings Inc*                      | 4,69 %  | 17.05.2033            | 725.819           | 0,16                         |
| 500.000  | Wintershall Dea Finance 2 BV*                  | 3,00 %  | 31.12.2149            | 481.507           | 0,11                         |
| 400.000  | ZF Europe Finance BV*                          | 3,00 %  | 23.10.2029            | 373.535           | 0,08                         |
| 1.000.000  | Ziggo Bond Co BV*                              | 3,38 %  | 28.02.2030            | 947.849           | 0,21                         |
| <b>Euro insgesamt</b>  |  |         |                       | <b>71.688.910</b> | <b>16,12</b>                 |
| <b>Britisches Pfund</b>  |  |         |                       |                   |                              |
| 272.000  | 888 Acquisitions Ltd*                          | 10,75 % | 15.05.2030            | 341.265           | 0,08                         |
| 196.964  | AA Bond Co Ltd*                                | 6,50 %  | 31.01.2026            | 247.295           | 0,06                         |

## Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                    | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|--|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 71,64 % (31. Dezember 2023: 75,85 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                   |                              |
| <b>Britisches Pfund (Fortsetzung)</b>  |  |         |                       |                   |                              |
| 652.000  | AA Bond Co Ltd*  | 6,85 %  | 31.07.2031            | 835.619           | 0,19                         |
| 220.000  | Aviva Plc*   | 6,88 %  | 31.12.2149            | 273.464           | 0,06                         |
| 350.000  | B&M European Value Retail SA*                            | 4,00 %  | 15.11.2028            | 412.382           | 0,09                         |
| 671.000  | B&M European Value Retail SA*                            | 6,50 %  | 27.11.2031            | 835.712           | 0,19                         |
| 400.000  | Barclays Plc*  | 6,37 %  | 31.01.2031            | 522.819           | 0,12                         |
| 460.000  | Barclays Plc*  | 9,25 %  | 31.12.2149            | 611.621           | 0,14                         |
| 602.000  | Bellis Acquisition Co Plc**                              | 8,13 %  | 14.05.2030            | 732.978           | 0,16                         |
| 800.000  | British Telecommunications Plc*                          | 8,38 %  | 20.12.2083            | 1.074.559         | 0,24                         |
| 998.000  | CPUK Finance Ltd**                                       | 6,50 %  | 28.08.2026            | 1.251.551         | 0,28                         |
| 500.000  | Deuce Finco Plc**  | 5,50 %  | 15.06.2027            | 614.960           | 0,14                         |
| 548.000  | Edge Finco Plc**   | 8,13 %  | 15.08.2031            | 704.671           | 0,16                         |
| 210.000  | Lloyds Banking Group Plc*                                | 8,50 %  | 31.12.2149            | 273.195           | 0,06                         |
| 750.000  | Maison Finco Plc**                                       | 6,00 %  | 31.10.2027            | 928.738           | 0,21                         |
| 800.000  | Miller Homes Group Finco Plc**                           | 7,00 %  | 15.05.2029            | 979.059           | 0,22                         |
| 400.000  | Mobico Group Plc*  | 4,25 %  | 31.12.2149            | 480.987           | 0,11                         |
| 930.000  | Nationwide Building Society*                             | 5,75 %  | 31.12.2149            | 1.139.387         | 0,26                         |
| 1.040.000  | NatWest Group Plc*                                       | 5,13 %  | 31.12.2149            | 1.248.768         | 0,28                         |
| 200.000  | Ocado Group Plc*   | 6,25 %  | 06.08.2029            | 234.585           | 0,05                         |
| 261.000  | Ocado Group Plc*   | 10,50 % | 08.08.2029            | 332.943           | 0,07                         |
| 500.000  | Pinnacle Bidco Plc*                                      | 10,00 % | 11.10.2028            | 668.645           | 0,15                         |
| 292.000  | Sherwood Financing Plc*                                  | 9,63 %  | 15.12.2029            | 366.615           | 0,08                         |
| 652.000  | TVL Finance Plc*   | 10,25 % | 28.04.2028            | 849.329           | 0,19                         |
| 471.000  | Virgin Media O2 Vendor Financing Notes V DAC*            | 7,88 %  | 15.03.2032            | 589.578           | 0,13                         |
| 500.000  | Wessex Water Services Finance Plc*                       | 1,50 %  | 17.09.2029            | 525.465           | 0,12                         |
| <b>Britisches Pfund insgesamt</b>  |  |         |                       | <b>17.076.190</b> | <b>3,84</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>   |  |         |                       |                   |                              |
| 450.000  | Abu Dhabi Commercial Bank PJSC*                          | 5,38 %  | 18.07.2028            | 455.562           | 0,10                         |
| 257.000  | Abu Dhabi Commercial Bank PJSC**                         | 8,00 %  | 31.12.2149            | 274.973           | 0,06                         |
| 251.000  | Abu Dhabi National Energy Co PJSC*                       | 4,70 %  | 24.04.2033            | 242.490           | 0,05                         |
| 1.185.000  | Acrisure LLC/Acrisure Finance Inc**                      | 8,25 %  | 01.02.2029            | 1.228.271         | 0,28                         |
| 400.000  | Aegea Finance Sarl**                                     | 9,00 %  | 20.01.2031            | 408.486           | 0,09                         |
| 1.000.000  | AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust* | 3,30 %  | 30.01.2032            | 871.678           | 0,20                         |
| 297.000  | Agrosuper SA**   | 4,60 %  | 20.01.2032            | 265.915           | 0,06                         |
| 955.000  | Ahead DB Holdings LLC**                                  | 6,63 %  | 01.05.2028            | 937.097           | 0,21                         |
| 1.044.636  | Air Canada 2020-2 Class A Pass Through Trust**           | 5,25 %  | 01.04.2029            | 1.042.858         | 0,23                         |
| 755.000  | Akbank TAS**   | 9,37 %  | 31.12.2149            | 769.271           | 0,17                         |
| 1.132.637  | Alaska Airlines 2020-1 Class A Pass Through Trust**      | 4,80 %  | 15.08.2027            | 1.124.706         | 0,25                         |
| 800.000  | Alfa SAB de CV**   | 6,88 %  | 25.03.2044            | 835.692           | 0,19                         |
| 333.000  | Alibaba Group Holding Ltd*                               | 4,20 %  | 06.12.2047            | 267.633           | 0,06                         |

## Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 71,64 % (31. Dezember 2023: 75,85 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 467.000  | Alibaba Group Holding Ltd <sup>†</sup>  | 4,40 %  | 06.12.2057            | 370.137          | 0,08                         |
| 950.000  | Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer <sup>**</sup>              | 6,75 %  | 15.10.2027            | 943.103          | 0,21                         |
| 1.870.000  | Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer <sup>**</sup>              | 6,75 %  | 15.04.2028            | 1.880.717        | 0,42                         |
| 750.000  | Allied Universal Holdco LLC <sup>**</sup>   | 7,88 %  | 15.02.2031            | 767.498          | 0,17                         |
| 600.000  | Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp <sup>**</sup>                 | 6,00 %  | 01.06.2029            | 547.339          | 0,12                         |
| 149.000  | Ally Financial Inc <sup>**</sup>  | 4,70 %  | 31.12.2149            | 130.589          | 0,03                         |
| 2.300.000  | Alpha Generation LLC <sup>**</sup>  | 6,75 %  | 15.10.2032            | 2.277.689        | 0,51                         |
| 300.000  | Ambipar Lux Sarl <sup>**</sup>  | 9,88 %  | 06.02.2031            | 299.713          | 0,07                         |
| 970.000  | Amentum Holdings Inc <sup>**</sup>  | 7,25 %  | 01.08.2032            | 978.456          | 0,22                         |
| 1.160.000  | American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd <sup>**</sup>                           | 5,75 %  | 20.04.2029            | 1.151.274        | 0,26                         |
| 1.215.000  | AmWINS Group Inc <sup>**</sup>  | 4,88 %  | 30.06.2029            | 1.146.502        | 0,26                         |
| 640.000  | AmWINS Group Inc <sup>**</sup>  | 6,38 %  | 15.02.2029            | 644.325          | 0,14                         |
| 452.000  | Antofagasta Plc <sup>†</sup>  | 6,25 %  | 02.05.2034            | 459.252          | 0,10                         |
| 1.385.000  | Archrock Partners LP/Archrock Partners Finance Corp <sup>**</sup>                       | 6,63 %  | 01.09.2032            | 1.384.586        | 0,31                         |
| 665.000  | Arcosa Inc <sup>**</sup>  | 6,88 %  | 15.08.2032            | 676.481          | 0,15                         |
| 685.000  | Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc <sup>**</sup> | 3,25 %  | 01.09.2028            | 616.024          | 0,14                         |
| 615.000  | Arsenal AIC Parent LLC <sup>**</sup>  | 8,00 %  | 01.10.2030            | 637.169          | 0,14                         |
| 615.000  | Arsenal AIC Parent LLC <sup>**</sup>  | 11,50 % | 01.10.2031            | 688.819          | 0,15                         |
| 765.000  | Artera Services LLC <sup>**</sup>   | 8,50 %  | 15.02.2031            | 738.158          | 0,17                         |
| 2.150.000  | Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp <sup>**</sup>                      | 5,88 %  | 30.06.2029            | 2.095.939        | 0,47                         |
| 1.507.000  | AT&T Inc <sup>**</sup>  | 3,65 %  | 15.09.2059            | 999.179          | 0,22                         |
| 1.850.000  | AthenaHealth Group Inc <sup>**</sup>  | 6,50 %  | 15.02.2030            | 1.759.972        | 0,40                         |
| 810.000  | Avient Corp <sup>**</sup>   | 6,25 %  | 01.11.2031            | 799.858          | 0,18                         |
| 975.000  | Azorra Finance Ltd <sup>**</sup>  | 7,75 %  | 15.04.2030            | 970.308          | 0,22                         |
| 300.000  | Banco Davivienda SA <sup>**</sup>   | 6,65 %  | 31.12.2149            | 258.131          | 0,06                         |
| 505.000  | Banco de Credito e Inversiones SA <sup>**</sup>   | 8,75 %  | 31.12.2149            | 528.608          | 0,12                         |
| 300.000  | Banco Mercantil del Norte SA <sup>**</sup>  | 6,63 %  | 31.12.2149            | 269.980          | 0,06                         |
| 600.000  | Bangkok Bank PCL <sup>**</sup>  | 5,00 %  | 31.12.2149            | 595.410          | 0,13                         |
| 300.000  | Bank Hapoalim BM <sup>†</sup>   | 3,26 %  | 21.01.2032            | 282.688          | 0,06                         |
| 500.000  | Bank of America Corp <sup>**</sup>  | 5,08 %  | 20.01.2027            | 501.532          | 0,11                         |
| 730.000  | Bank of New York Mellon Corp <sup>**</sup>  | 3,75 %  | 31.12.2149            | 691.730          | 0,16                         |
| 750.000  | Barclays Plc <sup>†</sup>   | 4,38 %  | 31.12.2149            | 676.377          | 0,15                         |
| 1.005.000  | Bath & Body Works Inc <sup>**</sup>   | 6,63 %  | 01.10.2030            | 1.016.481        | 0,23                         |
| 1.490.000  | BCPE Empire Holdings Inc <sup>**</sup>  | 7,63 %  | 01.05.2027            | 1.486.429        | 0,33                         |
| 1.595.000  | Beazer Homes USA Inc <sup>**</sup>  | 7,50 %  | 15.03.2031            | 1.621.837        | 0,36                         |
| 389.000  | Bimbo Bakeries USA Inc <sup>**</sup>  | 5,38 %  | 09.01.2036            | 375.499          | 0,08                         |
| 410.000  | BOC Aviation USA Corp <sup>**</sup>   | 4,88 %  | 03.05.2033            | 401.825          | 0,09                         |
| 1.570.000  | Bombardier Inc <sup>**</sup>  | 7,25 %  | 01.07.2031            | 1.621.066        | 0,36                         |
| 250.000  | Bonanza RE Ltd <sup>**</sup>  | 9,78 %  | 19.12.2027            | 250.000          | 0,06                         |
| 1.145.000  | Boost Newco Borrower LLC <sup>**</sup>  | 7,50 %  | 15.01.2031            | 1.201.282        | 0,27                         |

## Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 71,64 % (31. Dezember 2023: 75,85 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 1.000.000  | BPCE SA**   | 3,12 %  | 19.10.2032            | 828.810          | 0,19                         |
| 500.000  | Braskem Netherlands Finance BV**  | 8,50 %  | 12.01.2031            | 501.696          | 0,11                         |
| 250.000  | Bridge Street Re Ltd**  | 8,28 %  | 07.01.2028            | 250.000          | 0,06                         |
| 870.000  | BroadStreet Partners Inc**  | 5,88 %  | 15.04.2029            | 846.155          | 0,19                         |
| 640.000  | Cablevision Lightpath LLC**   | 3,88 %  | 15.09.2027            | 608.941          | 0,14                         |
| 340.000  | Calderys Financing II LLC**   | 11,75 % | 01.06.2028            | 346.147          | 0,08                         |
| 355.000  | Calderys Financing LLC**  | 11,25 % | 01.06.2028            | 380.433          | 0,09                         |
| 400.000  | Calpine Corp**  | 4,63 %  | 01.02.2029            | 377.936          | 0,09                         |
| 300.000  | Calpine Corp**  | 5,13 %  | 15.03.2028            | 291.185          | 0,07                         |
| 325.000  | Carvana Co**  | 13,00 % | 01.06.2030            | 357.166          | 0,08                         |
| 850.000  | Carvana Co**  | 14,00 % | 01.06.2031            | 1.019.985        | 0,23                         |
| 826.000  | CAS Capital No 1 Ltd*   | 4,00 %  | 31.12.2149            | 791.694          | 0,18                         |
| 1.385.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                    | 4,50 %  | 15.08.2030            | 1.244.819        | 0,28                         |
| 640.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                    | 4,50 %  | 01.05.2032            | 551.243          | 0,12                         |
| 360.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                    | 4,75 %  | 01.03.2030            | 329.156          | 0,07                         |
| 530.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                    | 6,38 %  | 01.09.2029            | 526.058          | 0,12                         |
| 330.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                    | 7,38 %  | 01.03.2031            | 336.636          | 0,08                         |
| 200.000  | Cemex SAB de CV**   | 5,13 %  | 31.12.2149            | 196.071          | 0,04                         |
| 500.000  | Centene Corp*   | 2,50 %  | 01.03.2031            | 413.888          | 0,09                         |
| 930.000  | CenterPoint Energy Inc**  | 6,70 %  | 15.05.2055            | 927.178          | 0,21                         |
| 445.000  | CFAMC III Co Ltd*   | 4,25 %  | 07.11.2027            | 427.970          | 0,10                         |
| 1.525.000  | Champions Financing Inc**   | 8,75 %  | 15.02.2029            | 1.488.643        | 0,33                         |
| 625.000  | Charles Schwab Corp**   | 4,00 %  | 31.12.2149            | 605.278          | 0,14                         |
| 290.000  | Charles Schwab Corp**   | 5,00 %  | 31.12.2149            | 282.246          | 0,06                         |
| 1.085.000  | Chart Industries Inc**  | 7,50 %  | 01.01.2030            | 1.129.406        | 0,25                         |
| 870.000  | Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital** | 4,80 %  | 01.03.2050            | 654.427          | 0,15                         |
| 1.550.000  | Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital** | 5,75 %  | 01.04.2048            | 1.326.761        | 0,30                         |
| 1.190.000  | Churchill Downs Inc**   | 4,75 %  | 15.01.2028            | 1.148.759        | 0,26                         |
| 570.000  | Churchill Downs Inc**   | 6,75 %  | 01.05.2031            | 576.878          | 0,13                         |
| 596.000  | Citigroup Inc**   | 3,88 %  | 31.12.2149            | 580.158          | 0,13                         |
| 345.000  | Citigroup Inc**   | 7,13 %  | 31.12.2149            | 352.272          | 0,08                         |
| 925.000  | Civitas Resources Inc**   | 8,63 %  | 01.11.2030            | 969.544          | 0,22                         |
| 970.000  | Clear Channel Outdoor Holdings Inc**  | 9,00 %  | 15.09.2028            | 1.019.990        | 0,23                         |
| 1.865.000  | Cleveland-Cliffs Inc**  | 6,88 %  | 01.11.2029            | 1.847.134        | 0,42                         |
| 1.555.000  | Cloud Software Group Inc**  | 6,50 %  | 31.03.2029            | 1.528.235        | 0,34                         |
| 575.000  | Cloud Software Group Inc**  | 8,25 %  | 30.06.2032            | 593.397          | 0,13                         |
| 265.000  | Cloud Software Group Inc**  | 9,00 %  | 30.09.2029            | 269.384          | 0,06                         |
| 476.000  | CommScope LLC**   | 9,50 %  | 15.12.2031            | 494.012          | 0,11                         |
| 345.000  | Community Health Systems Inc**  | 5,25 %  | 15.05.2030            | 283.682          | 0,06                         |
| 310.000  | Community Health Systems Inc**  | 5,63 %  | 15.03.2027            | 297.858          | 0,07                         |

## Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                    | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 71,64 % (31. Dezember 2023: 75,85 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 200.000  | Compania de Minas Buenaventura SAA**                     | 5,50 %  | 23.07.2026            | 199.985          | 0,05                         |
| 1.171.000  | Comstock Resources Inc**                                 | 6,75 %  | 01.03.2029            | 1.142.700        | 0,26                         |
| 1.160.000  | Consolidated Communications Inc**                        | 5,00 %  | 01.10.2028            | 1.080.814        | 0,24                         |
| 125.000  | Consolidated Communications Inc**                        | 6,50 %  | 01.10.2028            | 120.577          | 0,03                         |
| 268.000  | Consolidated Energy Finance SA**                         | 12,00 % | 15.02.2031            | 257.558          | 0,06                         |
| 395.000  | Cornerstone Building Brands Inc**                        | 6,13 %  | 15.01.2029            | 315.581          | 0,07                         |
| 1.565.000  | Cougar JV Subsidiary LLC**                               | 8,00 %  | 15.05.2032            | 1.626.036        | 0,37                         |
| 1.085.000  | CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC**                 | 5,50 %  | 15.06.2031            | 1.037.160        | 0,23                         |
| 195.000  | Crown Castle Towers LLC**                                | 4,24 %  | 15.07.2028            | 187.895          | 0,04                         |
| 530.000  | CSC Holdings LLC**                                       | 4,13 %  | 01.12.2030            | 382.696          | 0,09                         |
| 1.210.000  | CSC Holdings LLC**                                       | 11,75 % | 31.01.2029            | 1.195.723        | 0,27                         |
| 370.000  | CVS Health Corp**  | 6,75 %  | 10.12.2054            | 363.724          | 0,08                         |
| 810.000  | Dealer Tire LLC/DT Issuer LLC**                          | 8,00 %  | 01.02.2028            | 796.548          | 0,18                         |
| 910.000  | Dominion Energy Inc**                                    | 6,63 %  | 15.05.2055            | 927.439          | 0,21                         |
| 810.000  | DT Midstream Inc**                                       | 4,38 %  | 15.06.2031            | 739.644          | 0,17                         |
| 350.000  | Eastern & Southern African Trade & Development Bank*     | 4,13 %  | 30.06.2028            | 314.562          | 0,07                         |
| 400.000  | EIG Pearl Holdings Sarl*                                 | 4,39 %  | 30.11.2046            | 310.866          | 0,07                         |
| 1.415.000  | Electricite de France SA**                               | 9,13 %  | 31.12.2149            | 1.599.592        | 0,36                         |
| 495.000  | Ellucian Holdings Inc**                                  | 6,50 %  | 01.12.2029            | 496.447          | 0,11                         |
| 400.000  | Emirates NBD Bank PJSC**                                 | 4,25 %  | 31.12.2149            | 383.962          | 0,09                         |
| 320.000  | Emirates NBD Bank PJSC*                                  | 5,88 %  | 11.10.2028            | 330.099          | 0,07                         |
| 241.773  | Energean Israel Finance Ltd**                            | 4,88 %  | 30.03.2026            | 237.158          | 0,05                         |
| 625.000  | Evergy Inc**   | 6,65 %  | 01.06.2055            | 626.384          | 0,14                         |
| 299.000  | First Abu Dhabi Bank PJSC*                               | 6,32 %  | 04.04.2034            | 306.804          | 0,07                         |
| 725.000  | First Quantum Minerals Ltd**                             | 8,63 %  | 01.06.2031            | 747.217          | 0,17                         |
| 1.145.000  | FMG Resources August 2006 Pty Ltd**                      | 4,38 %  | 01.04.2031            | 1.031.689        | 0,23                         |
| 170.000  | FMG Resources August 2006 Pty Ltd**                      | 6,13 %  | 15.04.2032            | 168.075          | 0,04                         |
| 1.500.000  | Ford Motor Credit Co LLC*                                | 7,20 %  | 10.06.2030            | 1.579.895        | 0,36                         |
| 1.135.000  | Fortress Intermediate 3 Inc**                            | 7,50 %  | 01.06.2031            | 1.158.745        | 0,26                         |
| 925.000  | Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC** | 7,00 %  | 15.06.2032            | 944.360          | 0,21                         |
| 200.000  | Fortune Star BVI Ltd**                                   | 5,05 %  | 27.01.2027            | 188.183          | 0,04                         |
| 250.000  | Four Lakes Re Ltd**                                      | 9,78 %  | 07.01.2028            | 250.000          | 0,06                         |
| 282.000  | FS Luxembourg Sarl*                                      | 8,88 %  | 12.02.2031            | 286.343          | 0,06                         |
| 377.000  | FWD Group Holdings Ltd**                                 | 7,64 %  | 02.07.2031            | 402.948          | 0,09                         |
| 200.000  | FWD Group Holdings Ltd**                                 | 8,05 %  | 31.12.2149            | 199.625          | 0,04                         |
| 403.000  | Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd*                        | 2,63 %  | 31.03.2036            | 328.794          | 0,07                         |
| 385.000  | Garda World Security Corp**                              | 7,75 %  | 15.02.2028            | 397.619          | 0,09                         |
| 1.480.000  | Garda World Security Corp**                              | 8,25 %  | 01.08.2032            | 1.505.854        | 0,34                         |
| 1.000.000  | General Motors Co*                                       | 5,00 %  | 01.04.2035            | 940.168          | 0,21                         |
| 635.000  | Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp*           | 7,75 %  | 01.02.2028            | 636.365          | 0,14                         |

## Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                          | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 71,64 % (31. Dezember 2023: 75,85 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 1.000  | Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp* | 7,88 %  | 15.05.2032            | 980              | 0,00                         |
| 353.000  | Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp* | 8,00 %  | 15.01.2027            | 359.486          | 0,08                         |
| 1.000.000  | Global Aircraft Leasing Co Ltd**               | 8,75 %  | 01.09.2027            | 1.021.141        | 0,23                         |
| 415.000  | Global Atlantic Finance Co**                   | 7,95 %  | 15.10.2054            | 435.129          | 0,10                         |
| 1.105.000  | Goat Holdco LLC**                              | 6,75 %  | 01.02.2032            | 1.095.425        | 0,25                         |
| 500.000  | Goldman Sachs Group Inc**                      | 1,43 %  | 09.03.2027            | 480.139          | 0,11                         |
| 455.000  | Goldman Sachs Group Inc**                      | 7,50 %  | 31.12.2149            | 475.800          | 0,11                         |
| 918.500  | Greenko Power II Ltd*                          | 4,30 %  | 13.12.2028            | 865.797          | 0,19                         |
| 200.000  | Greensaif Pipelines Bidco Sarl*                | 6,51 %  | 23.02.2042            | 203.236          | 0,05                         |
| 1.295.000  | Harvest Midstream I LP**                       | 7,50 %  | 01.09.2028            | 1.307.647        | 0,29                         |
| 1.600.000  | HCA Inc*                                       | 5,25 %  | 15.06.2049            | 1.386.321        | 0,31                         |
| 614.000  | HDFC Bank Ltd**                                | 3,70 %  | 31.12.2149            | 575.947          | 0,13                         |
| 250.000  | Herbie Re Ltd**                                | 11,53 % | 08.01.2029            | 250.295          | 0,06                         |
| 250.000  | Herbie Re Ltd**                                | 15,03 % | 08.01.2029            | 250.603          | 0,06                         |
| 1.200.000  | Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co**       | 6,25 %  | 15.04.2032            | 1.109.685        | 0,25                         |
| 340.000  | Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co**       | 6,88 %  | 15.05.2034            | 318.178          | 0,07                         |
| 1.095.000  | Howard Midstream Energy Partners LLC**         | 7,38 %  | 15.07.2032            | 1.113.519        | 0,25                         |
| 805.000  | HUB International Ltd**                        | 5,63 %  | 01.12.2029            | 781.479          | 0,18                         |
| 1.475.000  | HUB International Ltd**                        | 7,25 %  | 15.06.2030            | 1.513.085        | 0,34                         |
| 300.000  | Hunt Oil Co of Peru LLC Sucursal Del Peru**    | 8,55 %  | 18.09.2033            | 327.542          | 0,07                         |
| 444.000  | Huntington Bancshares Inc**                    | 4,45 %  | 31.12.2149            | 425.311          | 0,10                         |
| 68.000   | Huntington Bancshares Inc**                    | 5,63 %  | 31.12.2149            | 66.704           | 0,02                         |
| 200.000  | Hyundai Capital America**                      | 5,68 %  | 26.06.2028            | 203.009          | 0,05                         |
| 700.000  | IHS Holding Ltd**                              | 6,25 %  | 29.11.2028            | 663.209          | 0,15                         |
| 600.000  | Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT**            | 3,54 %  | 27.04.2032            | 531.874          | 0,12                         |
| 130.000  | INEOS Finance Plc*                             | 6,75 %  | 15.05.2028            | 131.406          | 0,03                         |
| 1.205.000  | INEOS Finance Plc**                            | 7,50 %  | 15.04.2029            | 1.234.971        | 0,28                         |
| 250.000  | ING Groep NV**                                 | 3,88 %  | 31.12.2149            | 227.706          | 0,05                         |
| 350.000  | Investment Energy Resources Ltd*               | 6,25 %  | 26.04.2029            | 337.459          | 0,08                         |
| 620.000  | JELD-WEN Inc**                                 | 4,88 %  | 15.12.2027            | 589.769          | 0,13                         |
| 1.115.000  | JELD-WEN Inc**                                 | 7,00 %  | 01.09.2032            | 1.036.225        | 0,23                         |
| 500.000  | JSW Steel Ltd**                                | 5,05 %  | 05.04.2032            | 447.733          | 0,10                         |
| 840.000  | Kaiser Aluminum Corp**                         | 4,63 %  | 01.03.2028            | 790.738          | 0,18                         |
| 400.000  | KazMunayGas National Co JSC*                   | 3,50 %  | 14.04.2033            | 332.048          | 0,07                         |
| 800.000  | KazMunayGas National Co JSC*                   | 6,38 %  | 24.10.2048            | 744.930          | 0,17                         |
| 1.610.000  | Kinetik Holdings LP**                          | 5,88 %  | 15.06.2030            | 1.585.929        | 0,36                         |
| 500.000  | Klabn Austria GmbH**                           | 3,20 %  | 12.01.2031            | 420.604          | 0,09                         |
| 300.000  | Latam Airlines Group SA**                      | 7,88 %  | 15.04.2030            | 304.083          | 0,07                         |
| 450.000  | Lenovo Group Ltd*                              | 3,42 %  | 02.11.2030            | 404.614          | 0,09                         |
| 265.000  | Level 3 Financing Inc**                        | 4,88 %  | 15.06.2029            | 231.875          | 0,05                         |

## Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                     | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 71,64 % (31. Dezember 2023: 75,85 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 1.140.000  | Level 3 Financing Inc**                                   | 10,50 % | 15.05.2030            | 1.247.160        | 0,28                         |
| 750.000  | LifePoint Health Inc**                                    | 9,88 %  | 15.08.2030            | 810.155          | 0,18                         |
| 1.420.000  | LifePoint Health Inc**                                    | 10,00 % | 01.06.2032            | 1.445.556        | 0,32                         |
| 680.000  | Light & Wonder International Inc**                        | 7,25 %  | 15.11.2029            | 694.761          | 0,16                         |
| 2.075.000  | Lightning Power LLC**                                     | 7,25 %  | 15.08.2032            | 2.139.570        | 0,48                         |
| 650.000  | Lindblad Expeditions Holdings Inc**                       | 9,00 %  | 15.05.2028            | 680.766          | 0,15                         |
| 250.000  | Logistics Re Ltd**  | 10,28 % | 21.12.2027            | 253.850          | 0,06                         |
| 350.000  | Longfor Group Holdings Ltd**                              | 3,95 %  | 16.09.2029            | 263.238          | 0,06                         |
| 1.905.000  | Madison IAQ LLC**   | 5,88 %  | 30.06.2029            | 1.800.862        | 0,40                         |
| 980.000  | Manitowoc Co Inc**  | 9,25 %  | 01.10.2031            | 1.005.748        | 0,23                         |
| 775.000  | Masterbrand Inc**   | 7,00 %  | 15.07.2032            | 781.310          | 0,18                         |
| 1.360.000  | Mauser Packaging Solutions Holding Co**                   | 9,25 %  | 15.04.2027            | 1.381.986        | 0,31                         |
| 828.581  | MC Brazil Downstream Trading Sarl**                       | 7,25 %  | 30.06.2031            | 689.250          | 0,15                         |
| 560.000  | McGraw-Hill Education Inc**                               | 5,75 %  | 01.08.2028            | 547.391          | 0,12                         |
| 665.000  | McGraw-Hill Education Inc**                               | 7,38 %  | 01.09.2031            | 681.415          | 0,15                         |
| 780.000  | McGraw-Hill Education Inc**                               | 8,00 %  | 01.08.2029            | 780.976          | 0,18                         |
| 201.000  | MDGH GMTN RSC Ltd*  | 5,88 %  | 01.05.2034            | 209.629          | 0,05                         |
| 350.000  | Medco Maple Tree Pte Ltd**                                | 8,96 %  | 27.04.2029            | 369.457          | 0,08                         |
| 2.215.000  | Medline Borrower LP**                                     | 5,25 %  | 01.10.2029            | 2.139.721        | 0,48                         |
| 500.000  | Melco Resorts Finance Ltd**                               | 5,63 %  | 17.07.2027            | 484.372          | 0,11                         |
| 655.000  | Mersin Uluslararası Liman İşletmeciliği AS*               | 8,25 %  | 15.11.2028            | 679.265          | 0,15                         |
| 845.000  | Midcontinent Communications**                             | 8,00 %  | 15.08.2032            | 868.980          | 0,20                         |
| 1.450.000  | Midwest Gaming Borrower LLC/Midwest Gaming Finance Corp** | 4,88 %  | 01.05.2029            | 1.368.004        | 0,31                         |
| 500.000  | Minerva Luxembourg SA**                                   | 8,88 %  | 13.09.2033            | 519.238          | 0,12                         |
| 400.000  | Minsur SA**   | 4,50 %  | 28.10.2031            | 355.188          | 0,08                         |
| 1.050.000  | MIWD Holdco II LLC/MIWD Finance Corp**                    | 5,50 %  | 01.02.2030            | 994.428          | 0,22                         |
| 975.000  | Molina Healthcare Inc**                                   | 6,25 %  | 15.01.2033            | 964.521          | 0,22                         |
| 325.000  | Mona Lisa Re Ltd**  | 12,28 % | 08.01.2029            | 325.000          | 0,07                         |
| 905.000  | Morgan Stanley**  | 4,21 %  | 20.04.2028            | 892.194          | 0,20                         |
| 1.000.000  | MPLX LP*  | 5,50 %  | 15.02.2049            | 920.221          | 0,21                         |
| 250.000  | Mystic Re IV Ltd**  | 8,28 %  | 10.01.2028            | 250.000          | 0,06                         |
| 250.000  | Mystic Re IV Ltd**  | 14,53 % | 10.01.2028            | 250.000          | 0,06                         |
| 1.695.000  | Nationstar Mortgage Holdings Inc**                        | 6,50 %  | 01.08.2029            | 1.693.883        | 0,38                         |
| 580.000  | New Fortress Energy Inc**                                 | 6,50 %  | 30.09.2026            | 558.688          | 0,13                         |
| 452.000  | NewCo Holding USD 20 Sarl**                               | 9,38 %  | 07.11.2029            | 450.644          | 0,10                         |
| 496.000  | Nexa Resources SA**                                       | 6,75 %  | 09.04.2034            | 505.607          | 0,11                         |
| 208.000  | Niagara Energy SAC**                                      | 5,75 %  | 03.10.2034            | 201.812          | 0,05                         |
| 580.000  | Noble Finance II LLC**                                    | 8,00 %  | 15.04.2030            | 586.369          | 0,13                         |
| 1.025.000  | Northriver Midstream Finance LP**                         | 6,75 %  | 15.07.2032            | 1.032.053        | 0,23                         |
| 380.000  | NRG Energy Inc**  | 6,00 %  | 01.02.2033            | 369.368          | 0,08                         |

## Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung  | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 71,64 % (31. Dezember 2023: 75,85 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 1.050.000  | NRG Energy Inc**   | 10,25 % | 31.12.2149            | 1.160.811        | 0,26                         |
| 1.275.000  | Olympus Water US Holding Corp**  | 6,25 %  | 01.10.2029            | 1.219.325        | 0,27                         |
| 375.000  | Olympus Water US Holding Corp**  | 7,13 %  | 01.10.2027            | 382.021          | 0,09                         |
| 700.000  | OneMain Finance Corp*  | 6,63 %  | 15.01.2028            | 709.212          | 0,16                         |
| 385.000  | OneMain Finance Corp*  | 6,63 %  | 15.05.2029            | 390.274          | 0,09                         |
| 272.000  | Oryx Funding Ltd**   | 5,80 %  | 03.02.2031            | 270.819          | 0,06                         |
| 1.260.000  | Panther Escrow Issuer LLC**  | 7,13 %  | 01.06.2031            | 1.273.966        | 0,29                         |
| 745.000  | Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/PK Finance Co-Issuer** | 5,88 %  | 01.10.2028            | 728.622          | 0,16                         |
| 1.115.000  | Penn Entertainment Inc**   | 4,13 %  | 01.07.2029            | 1.000.958        | 0,23                         |
| 1.170.000  | PennyMac Financial Services Inc**  | 5,75 %  | 15.09.2031            | 1.115.595        | 0,25                         |
| 480.000  | PennyMac Financial Services Inc**  | 7,13 %  | 15.11.2030            | 486.561          | 0,11                         |
| 500.000  | Periama Holdings LLC**   | 5,95 %  | 19.04.2026            | 499.711          | 0,11                         |
| 1.410.000  | Perrigo Finance Unlimited Co*  | 6,13 %  | 30.09.2032            | 1.380.518        | 0,31                         |
| 1.250.000  | Petroleos Mexicanos**  | 6,70 %  | 16.02.2032            | 1.088.393        | 0,24                         |
| 220.000  | PNC Financial Services Group Inc**   | 3,40 %  | 31.12.2149            | 207.040          | 0,05                         |
| 1.430.000  | Post Holdings Inc**  | 6,38 %  | 01.03.2033            | 1.403.348        | 0,32                         |
| 300.000  | Power Finance Corp Ltd*  | 4,50 %  | 18.06.2029            | 289.068          | 0,07                         |
| 1.295.000  | Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**                       | 6,25 %  | 15.01.2028            | 1.289.391        | 0,29                         |
| 500.000  | Prosus NV*   | 3,83 %  | 08.02.2051            | 323.575          | 0,07                         |
| 785.000  | Provident Funding Associates LP/PFG Finance Corp**                             | 9,75 %  | 15.09.2029            | 807.346          | 0,18                         |
| 160.000  | Rackspace Finance LLC**  | 3,50 %  | 15.05.2028            | 96.600           | 0,02                         |
| 655.000  | Raven Acquisition Holdings LLC**   | 6,88 %  | 15.11.2031            | 650.067          | 0,15                         |
| 250.000  | Recoletos RE DAC**   | 9,28 %  | 07.01.2028            | 250.000          | 0,06                         |
| 649.000  | Reliance Industries Ltd*   | 3,63 %  | 12.01.2052            | 448.647          | 0,10                         |
| 450.000  | ReNew Wind Energy AP2/ReNew Power Pvt Ltd other 9 Subsidiaries**               | 4,50 %  | 14.07.2028            | 418.348          | 0,09                         |
| 350.000  | Residential Reinsurance 2004 Ltd**   | 11,28 % | 06.12.2028            | 359.905          | 0,08                         |
| 1.305.000  | Resideo Funding Inc**  | 6,50 %  | 15.07.2032            | 1.308.259        | 0,29                         |
| 979.806  | Samarco Mineracao SA**   | 9,00 %  | 30.06.2031            | 958.906          | 0,22                         |
| 250.000  | Sanders RE II Ltd**  | 9,53 %  | 07.04.2029            | 251.276          | 0,06                         |
| 1.000.000  | Sasol Financing USA LLC*   | 6,50 %  | 27.09.2028            | 964.088          | 0,22                         |
| 537.000  | Saudi Arabian Oil Co*  | 5,75 %  | 17.07.2054            | 503.198          | 0,11                         |
| 2.120.000  | SeaWorld Parks & Entertainment Inc**   | 5,25 %  | 15.08.2029            | 2.024.887        | 0,46                         |
| 700.000  | SEPLAT Energy Plc*   | 7,75 %  | 01.04.2026            | 698.496          | 0,15                         |
| 1.165.000  | Service Properties Trust**   | 5,25 %  | 15.02.2026            | 1.133.879        | 0,25                         |
| 1.100.000  | SierraCol Energy Andina LLC**  | 6,00 %  | 15.06.2028            | 994.468          | 0,22                         |
| 840.000  | Six Flags Entertainment Corp**   | 7,25 %  | 15.05.2031            | 858.819          | 0,19                         |
| 266.000  | SK Hynix Inc*  | 6,38 %  | 17.01.2028            | 274.461          | 0,06                         |
| 225.000  | SK Hynix Inc**   | 6,50 %  | 17.01.2033            | 237.935          | 0,05                         |
| 1.070.000  | SPX FLOW Inc**   | 8,75 %  | 01.04.2030            | 1.097.670        | 0,25                         |
| 483.000  | Standard Chartered Plc*  | 6,30 %  | 06.07.2034            | 501.715          | 0,11                         |

## Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 71,64 % (31. Dezember 2023: 75,85 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 1.030.000  | Standard Industries Inc**                                     | 3,38 %  | 15.01.2031            | 883.977          | 0,20                         |
| 1.175.000  | Star Holding LLC**  | 8,75 %  | 01.08.2031            | 1.165.683        | 0,26                         |
| 720.000  | Star Parent Inc**   | 9,00 %  | 01.10.2030            | 748.692          | 0,17                         |
| 755.000  | Starwood Property Trust Inc**                                 | 6,50 %  | 01.07.2030            | 756.449          | 0,17                         |
| 800.000  | Starwood Property Trust Inc**                                 | 7,25 %  | 01.04.2029            | 821.643          | 0,18                         |
| 1.220.000  | Sunrise FinCo I BV**  | 4,88 %  | 15.07.2031            | 1.108.089        | 0,25                         |
| 860.000  | Surgery Center Holdings Inc**                                 | 7,25 %  | 15.04.2032            | 878.356          | 0,20                         |
| 1.900.000  | Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**  | 6,00 %  | 31.12.2030            | 1.800.818        | 0,40                         |
| 1.209.566  | Team Health Holdings Inc**                                    | 13,50 % | 30.06.2028            | 1.338.082        | 0,30                         |
| 792.000  | Telecom Argentina SA**  | 9,50 %  | 18.07.2031            | 814.968          | 0,18                         |
| 351.000  | Telecommunications co Telekom Srbija AD Belgrade**            | 7,00 %  | 28.10.2029            | 350.645          | 0,08                         |
| 500.000  | Tencent Holdings Ltd*   | 3,24 %  | 03.06.2050            | 332.234          | 0,07                         |
| 930.000  | Terex Corp**  | 5,00 %  | 15.05.2029            | 886.406          | 0,20                         |
| 350.000  | Titania RE Ltd**  | 10,53 % | 26.11.2027            | 349.370          | 0,08                         |
| 1.605.000  | TK Elevator Holdco GmbH**                                     | 7,63 %  | 15.07.2028            | 1.607.054        | 0,36                         |
| 1.000.000  | T-Mobile USA Inc**  | 5,15 %  | 15.04.2034            | 984.287          | 0,22                         |
| 1.745.000  | TransDigm Inc**   | 6,00 %  | 15.01.2033            | 1.711.584        | 0,38                         |
| 200.000  | Transnet SOC Ltd*   | 8,25 %  | 06.02.2028            | 204.067          | 0,05                         |
| 400.000  | Trident Energy Finance Plc**                                  | 12,50 % | 30.11.2029            | 420.363          | 0,09                         |
| 625.000  | Trident TPI Holdings Inc**                                    | 12,75 % | 31.12.2028            | 690.213          | 0,16                         |
| 1.950.000  | Trivium Packaging Finance BV*                                 | 8,50 %  | 15.08.2027            | 1.949.208        | 0,44                         |
| 45.000   | Truist Financial Corp**                                       | 5,10 %  | 31.12.2149            | 43.720           | 0,01                         |
| 495.000  | Truist Financial Corp**                                       | 6,67 %  | 31.12.2149            | 493.555          | 0,11                         |
| 400.000  | Trust Fibra Uno**   | 6,95 %  | 30.01.2044            | 346.303          | 0,08                         |
| 300.000  | Turkcell Iletisim Hizmetleri AS*                              | 5,80 %  | 11.04.2028            | 291.130          | 0,07                         |
| 1.465.000  | UKG Inc**   | 6,88 %  | 01.02.2031            | 1.487.865        | 0,33                         |
| 909.867  | United Airlines 2020-1 Class A Pass Through Trust**           | 5,88 %  | 15.10.2027            | 930.057          | 0,21                         |
| 1.315.000  | Uniti Group LP/Uniti Group Finance 2019 Inc/CSL Capital LLC** | 10,50 % | 15.02.2028            | 1.403.520        | 0,32                         |
| 665.000  | US Bancorp**  | 3,70 %  | 31.12.2149            | 630.585          | 0,14                         |
| 550.000  | Vedanta Resources Finance II Plc**                            | 10,88 % | 17.09.2029            | 569.601          | 0,13                         |
| 900.000  | Veritiv Operating Co**  | 10,50 % | 30.11.2030            | 970.407          | 0,22                         |
| 1.455.000  | Viking Cruises Ltd**  | 9,13 %  | 15.07.2031            | 1.566.096        | 0,35                         |
| 863.000  | Vista Energy Argentina SAU**                                  | 7,63 %  | 10.12.2035            | 858.469          | 0,19                         |
| 2.285.000  | Vistra Corp**   | 7,00 %  | 31.12.2149            | 2.300.578        | 0,52                         |
| 765.000  | Vistra Operations Co LLC**                                    | 7,75 %  | 15.10.2031            | 803.247          | 0,18                         |
| 600.000  | VTR Finance NV**  | 6,38 %  | 15.07.2028            | 570.482          | 0,13                         |
| 1.900.000  | Wand NewCo 3 Inc**  | 7,63 %  | 30.01.2032            | 1.953.474        | 0,44                         |
| 2.040.000  | Warnermedia Holdings Inc**                                    | 5,05 %  | 15.03.2042            | 1.638.879        | 0,37                         |
| 340.000  | WE Soda Investments Holding Plc**                             | 9,50 %  | 06.10.2028            | 350.030          | 0,08                         |
| 1.610.000  | Windsor Holdings III LLC**                                    | 8,50 %  | 15.06.2030            | 1.696.072        | 0,38                         |

## Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                    | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|--------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 71,64 % (31. Dezember 2023: 75,85 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |        |                       |                    |                              |
| 625.000  | Windstream Services LLC/Windstream Escrow Finance Corp** | 8,25 % | 01.10.2031            | 646.246            | 0,15                         |
| 540.000  | WR Grace Holdings LLC**                                  | 5,63 % | 15.08.2029            | 497.250            | 0,11                         |
| 835.000  | WR Grace Holdings LLC**                                  | 7,38 % | 01.03.2031            | 856.596            | 0,19                         |
| 1.930.000  | XPO Inc**  | 7,13 % | 01.02.2032            | 1.978.868          | 0,44                         |
| 360.000  | Yapi ve Kredi Bankasi AS**                               | 9,25 % | 16.10.2028            | 388.705            | 0,09                         |
| 726.000  | Yapi ve Kredi Bankasi AS**                               | 9,25 % | 17.01.2034            | 757.034            | 0,17                         |
| 595.000  | Yapi ve Kredi Bankasi AS**                               | 9,74 % | 31.12.2149            | 614.084            | 0,14                         |
| 300.000  | Yinson Boronia Production BV*                            | 8,95 % | 31.07.2042            | 313.339            | 0,07                         |
| 830.000  | YPF SA**   | 9,50 % | 17.01.2031            | 888.522            | 0,20                         |
| 1.330.000  | Zayo Group Holdings Inc**                                | 4,00 % | 01.03.2027            | 1.227.981          | 0,28                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |  |        |                       | <b>229.920.987</b> | <b>51,68</b>                 |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>318.686.087</b> | <b>71,64</b>                 |
| <b>Staatsanleihen 2,16 % (31. Dezember 2023: 3,94 %)</b>                       |  |        |                       |                    |                              |
| <b>Euro</b>  |  |        |                       |                    |                              |
| 1.100.000  | Ivory Coast Government International Bond                | 6,88 % | 17.10.2040            | 989.767            | 0,22                         |
| 904.000  | Republic of Cameroon International Bond                  | 5,95 % | 07.07.2032            | 760.302            | 0,17                         |
| <b>Euro insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>1.750.069</b>   | <b>0,39</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>   |  |        |                       |                    |                              |
| 1.000.000  | Angolan Government International Bond                    | 8,25 % | 09.05.2028            | 942.319            | 0,21                         |
| 1.002.000  | Angolan Government International Bond                    | 8,75 % | 14.04.2032            | 887.841            | 0,20                         |
| 401.000  | Chile Government International Bond                      | 4,95 % | 05.01.2036            | 380.370            | 0,09                         |
| 436.000  | Dominican Republic International Bond                    | 5,30 % | 21.01.2041            | 371.472            | 0,08                         |
| 494.000  | Dominican Republic International Bond                    | 6,85 % | 27.01.2045            | 486.590            | 0,11                         |
| 928.000  | Egypt Government International Bond                      | 7,50 % | 16.02.2061            | 638.380            | 0,14                         |
| 600.000  | Egypt Government International Bond                      | 7,63 % | 29.05.2032            | 528.608            | 0,12                         |
| 32.000   | Ghana Government International Bond                      | 0,00 % | 03.07.2026            | 29.817             | 0,01                         |
| 242.000  | Ghana Government International Bond                      | 5,00 % | 03.07.2029            | 209.603            | 0,05                         |
| 348.000  | Ghana Government International Bond                      | 5,00 % | 03.07.2035            | 245.564            | 0,06                         |
| 367.000  | Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS                   | 8,51 % | 14.01.2029            | 392.240            | 0,09                         |
| 500.000  | Romanian Government International Bond                   | 7,13 % | 17.01.2033            | 507.530            | 0,11                         |
| 41.436   | Sri Lanka Government International Bond                  | 3,10 % | 15.01.2030            | 34.392             | 0,01                         |
| 81.276   | Sri Lanka Government International Bond                  | 3,35 % | 15.03.2033            | 61.875             | 0,01                         |
| 54.880   | Sri Lanka Government International Bond                  | 3,60 % | 15.06.2035            | 39.788             | 0,01                         |
| 38.088   | Sri Lanka Government International Bond                  | 3,60 % | 15.05.2036            | 29.042             | 0,01                         |
| 76.208   | Sri Lanka Government International Bond                  | 3,60 % | 15.02.2038            | 58.398             | 0,01                         |
| 42.252   | Sri Lanka Government International Bond                  | 4,00 % | 15.04.2028            | 39.666             | 0,01                         |
| 349.000  | Türkiye İhracat Kredi Bankasi AS                         | 9,00 % | 28.01.2027            | 367.274            | 0,08                         |
| 77.428   | Ukraine Government International Bond                    | 0,00 % | 01.02.2030            | 42.508             | 0,01                         |

## Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag  | Wertpapierbezeichnung                    | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|---|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 2,16 % (31. Dezember 2023: 3,94 %) (Fortsetzung)</b>          |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>  |  |         |                       |                  |                              |
| 244.514   | Ukraine Government International Bond    | 0,00 %  | 01.02.2035            | 144.992          | 0,03                         |
| 203.762   | Ukraine Government International Bond    | 0,00 %  | 01.02.2036            | 120.203          | 0,03                         |
| 1.000.000   | Ukraine Government International Bond    | 0,00 %  | 01.08.2041            | 774.368          | 0,17                         |
| 507.434   | Ukraine Government International Bond    | 1,75 %  | 01.02.2034            | 287.334          | 0,06                         |
| 448.738   | Ukraine Government International Bond    | 1,75 %  | 01.02.2036            | 244.297          | 0,06                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>  |  |         |                       | <b>7.864.471</b> | <b>1,77</b>                  |
| <b>Staatsanleihen insgesamt *</b>   |  |         |                       | <b>9.614.540</b> | <b>2,16</b>                  |
| <b>Mittelfristige Schuldverschreibungen^ 8,43 % (31. Dezember 2023: 3,87 %)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar</b>  |  |         |                       |                  |                              |
| 989.770   | Allied Universal Holdco LLC              | 8,21 %  | 12.05.2028            | 994.234          | 0,22                         |
| 987.373   | Alterra Mountain Co                      | 7,11 %  | 17.08.2028            | 995.089          | 0,22                         |
| 1.000.000   | Amentum Holdings Inc                     | 6,61 %  | 29.09.2031            | 997.705          | 0,22                         |
| 498.744   | AssuredPartners Inc                      | 7,86 %  | 14.02.2031            | 500.380          | 0,11                         |
| 989.848   | Bausch & Lomb Corp                       | 7,69 %  | 10.05.2027            | 994.841          | 0,22                         |
| 997.500   | Boost Newco Borrower LLC                 | 6,83 %  | 31.01.2031            | 1.004.777        | 0,23                         |
| 992.500   | Central Parent LLC                       | 7,58 %  | 06.07.2029            | 980.654          | 0,22                         |
| 989.796   | Chariot Buyer LLC                        | 7,71 %  | 03.11.2028            | 996.913          | 0,22                         |
| 1.000.000   | Chart Industries Inc                     | 7,09 %  | 15.03.2030            | 1.005.210        | 0,23                         |
| 916.544   | Coherent Corp                            | 6,86 %  | 02.07.2029            | 920.362          | 0,21                         |
| 999.322   | Commscope LLC                            | 9,86 %  | 17.12.2029            | 1.013.692        | 0,23                         |
| 1.000.000   | Cornerstone Generation LLC               | 0,00 %  | 28.10.2031            | 1.010.000        | 0,23                         |
| 992.513   | Cotiviti Inc                             | 7,30 %  | 01.05.2031            | 999.341          | 0,22                         |
| 1.145.569   | CQP Holdco LP                            | 6,33 %  | 31.12.2030            | 1.148.862        | 0,26                         |
| 990.025   | Crosby US Acquisition Corp               | 7,86 %  | 16.08.2029            | 1.001.415        | 0,23                         |
| 724.444   | Dynasty Acquisition Co Inc B-1 Term Loan | 6,61 %  | 31.10.2031            | 728.690          | 0,16                         |
| 275.556   | Dynasty Acquisition Co Inc B-2 Term Loan | 6,61 %  | 31.10.2031            | 277.170          | 0,06                         |
| 997.500   | EMRLD Borrower LP                        | 0,00 %  | 04.08.2031            | 1.002.697        | 0,23                         |
| 989.796   | Engineered Machinery Holdings Inc        | 8,34 %  | 19.05.2028            | 998.768          | 0,22                         |
| 1.000.000   | First Advantage Holdings LLC             | 0,00 %  | 31.10.2031            | 1.011.875        | 0,23                         |
| 992.416   | Flexera Software LLC                     | 7,35 %  | 03.03.2028            | 1.000.325        | 0,22                         |
| 903.014   | Focus Financial Partners LLC             | 7,61 %  | 11.09.2031            | 912.437          | 0,20                         |
| 992.513   | Hub International Ltd                    | 7,37 %  | 20.06.2030            | 999.778          | 0,22                         |
| 1.000.000   | Icon Parent I Inc                        | 7,52 %  | 13.11.2031            | 1.004.845        | 0,23                         |
| 1.000.000   | Ingram Micro Inc                         | 0,00 %  | 22.09.2031            | 1.006.875        | 0,23                         |
| 1.000.000   | Level 3 Financing Inc                    | 10,92 % | 15.04.2030            | 1.020.875        | 0,23                         |
| 1.000.000   | Life Time Inc                            | 7,03 %  | 05.11.2031            | 1.005.250        | 0,23                         |
| 997.500   | Lightning Power LLC                      | 7,58 %  | 18.08.2031            | 1.010.108        | 0,23                         |
| 935.286   | Lightstone Holdco LLC B Term Loan        | 10,34 % | 29.01.2027            | 947.562          | 0,21                         |
| 52.905  | Lightstone Holdco LLC C Term Loan        | 10,34 % | 29.01.2027            | 53.600           | 0,01                         |

## Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|--------------------------------------|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Mittelfristige Schuldverschreibungen<sup>^</sup> 8,43 % (31. Dezember 2023: 3,87 %) (Fortsetzung)</b> |                                      |         |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |                                      |         |                       |                   |                              |
| 894.929  | Medline Borrower LP                  | 6,61 %  | 23.10.2028            | 899.099           | 0,20                         |
| 992.500  | NRG Energy Inc                       | 6,35 %  | 16.04.2031            | 994.862           | 0,22                         |
| 992.513  | Prairie ECI Acquiror LP              | 8,61 %  | 01.08.2029            | 1.001.197         | 0,23                         |
| 1.000.000  | QualityTech LP                       | 0,00 %  | 04.11.2031            | 1.007.500         | 0,23                         |
| 341.326  | Rackspace Finance LLC                | 10,85 % | 15.05.2028            | 354.268           | 0,08                         |
| 933.333  | Raven Acquisition Holdings LLC       | 7,61 %  | 19.11.2031            | 936.605           | 0,21                         |
| 886.766  | Star Parent Inc                      | 8,33 %  | 27.09.2030            | 867.812           | 0,19                         |
| 997.500  | Thunder Generation Funding LLC       | 7,33 %  | 03.10.2031            | 1.005.290         | 0,23                         |
| 1.000.000  | White Cap Supply Holdings LLC        | 7,61 %  | 19.10.2029            | 1.003.165         | 0,23                         |
| 883.592  | World Wide Technology Holding Co LLC | 6,69 %  | 01.03.2030            | 886.905           | 0,20                         |
| 1.000.000  | Zelis Payments Buyer Inc             | 7,61 %  | 26.11.2031            | 1.004.790         | 0,23                         |
| <b>Mittelfristige Schuldverschreibungen insgesamt <sup>†</sup></b>                                       |                                      |         |                       | <b>37.505.823</b> | <b>8,43</b>                  |

| Anzahl der<br>Anteile                                     | Wertpapierbezeichnung             | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-----------------------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Investmentfonds 0,00 % (31. Dezember 2023: 0,01 %)</b> |                                   |                  |                              |
| <b>Britisches Pfund</b>                                   |                                   |                  |                              |
| 9.642   | NB Global Monthly Income Fund Ltd | 6.944            | 0,00                         |
| <b>Investmentfonds insgesamt <sup>#</sup></b>             |                                   |                  | <b>6.944</b>                 |
| <b>Anlagen insgesamt</b>                                  |                                   |                  | <b>437.617.605</b>           |

### Devisenterminkontrakte 2,00 % (31. Dezember 2023: 2,08 %)

| Geforderter<br>Betrag           | Zu zahlender<br>Betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|---------------------------------|------------------------|-----------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------------|------------------------------|
| 742 US\$                        | 1.000 CAD              | 16.01.2025            | Citibank NA                    | 1         | 47                                   | 0,00                         |
| 255.006 US\$                    | 200.000 £              | 16.01.2025            | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 4.554                                | 0,00                         |
| 23.420.050 US\$                 | 17.528.265 £           | 16.01.2025            | Royal Bank of Canada           | 2         | 1.470.154                            | 0,33                         |
| 89.668.067 US\$                 | 80.091.452 €           | 16.01.2025            | State Street Bank and Trust Co | 2         | 6.689.286                            | 1,51                         |
| <i>Abgesicherte Klassen CAD</i> |                        |                       |                                |           |                                      |                              |
| 79.625 US\$                     | 114.206 CAD            | 16.01.2025            | Goldman Sachs International    | 1         | 177                                  | 0,00                         |
| 111.846 US\$                    | 153.898 CAD            | 16.01.2025            | Westpac Banking Corp           | 2         | 4.787                                | 0,00                         |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> |                        |                       |                                |           |                                      |                              |
| 40.551 US\$                     | 38.780 €               | 16.01.2025            | Goldman Sachs International    | 1         | 373                                  | 0,00                         |
| 26.488 US\$                     | 24.416 €               | 16.01.2025            | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 1.191                                | 0,00                         |
| 22.029 US\$                     | 19.971 €               | 16.01.2025            | State Street Bank and Trust Co | 1         | 1.339                                | 0,00                         |
| 618.564 US\$                    | 570.805 €              | 16.01.2025            | Westpac Banking Corp           | 17        | 27.183                               | 0,01                         |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> |                        |                       |                                |           |                                      |                              |
| 1.162.859 US\$                  | 888.381 £              | 16.01.2025            | Citibank NA                    | 1         | 50.378                               | 0,01                         |
| 1.686.490 US\$                  | 1.338.729 £            | 16.01.2025            | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 10.057                               | 0,00                         |
| 1.387.854 US\$                  | 1.071.025 £            | 16.01.2025            | State Street Bank and Trust Co | 1         | 46.655                               | 0,01                         |

## Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 2,00 % (31. Dezember 2023: 2,08 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei          | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|----------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen GBP (Fortsetzung)</i>                                   |                     |                  |                      |           |                                |                      |
| 26.353.298 US\$   | 20.588.771 £        | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp | 41        | 570.861                        | 0,13                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                      |           | <b>8.877.042</b>               | <b>2,00</b>          |

### Futures-Kontrakte 0,25 % (31. Dezember 2023: 0,96 %)

| Anzahl Kontrakte   | Beschreibung                                   | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |             |
|--|--|--------------------------------|----------------------|-------------|
| (230)  | Euro-BOBL Future March 2025                    | 381.074                        | 0,09                 |             |
| (33)   | Euro-Bund Future March 2025                    | 121.651                        | 0,03                 |             |
| (27)   | Euro-OAT Future March 2025                     | 79.402                         | 0,02                 |             |
| (139)  | Euro-Schatz Future March 2025                  | 65.490                         | 0,01                 |             |
| (59)   | United Kingdom Long Gilt Future March 2025     | 156.475                        | 0,03                 |             |
| (46)   | US Treasury Ultra Bond (CBT) Future March 2025 | 311.341                        | 0,07                 |             |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten <sup>*</sup></b> |  |                                | <b>1.115.433</b>     | <b>0,25</b> |

### Credit-Default-Swap-Kontrakten 0,07 % (31. Dezember 2023: 0,00 %)

| Nominalwert   | Fälligkeit | Gegenpartei                 | Referenzverbindlichkeit                    | Zeitwert US\$  | % des Nettovermögens |
|---|------------|-----------------------------|--|----------------|----------------------|
| USD 4.187.000   | 20.06.2029 | ICE Clear U.S. <sup>1</sup> | Selling default protection on CDX.NA.HY.42 | 333.841        | 0,07                 |
| <b>Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt <sup>*</sup></b> |            |                             |  | <b>333.841</b> | <b>0,07</b>          |

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

|  | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens |
|--|--------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> | <b>447.943.921</b> | <b>100,69</b>        |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (2,67 %) (31. Dezember 2023: (0,89 %))

| Geforderter Betrag              | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 5.732.223 €                     | 6.417.630 US\$      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (478.759)                       | (0,11)               |
| 1.915.899 £                     | 2.566.813 US\$      | 16.01.2025       | Citibank NA                    | 1         | (167.614)                       | (0,04)               |
| <i>Abgesicherte Klassen CAD</i> |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 13.733.356 CAD                  | 10.086.612 US\$     | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | (532.947)                       | (0,12)               |
| 255.452 CAD                     | 186.928 US\$        | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 2         | (9.222)                         | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 46.861 €                        | 52.484 US\$         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | (3.933)                         | (0,00)               |
| 5.364.703 €                     | 5.861.194 US\$      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 33        | (303.092)                       | (0,07)               |

## Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (2,67 %) (31. Dezember 2023: (0,89 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>  |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 3.040.104 £  | 4.006.225 US\$      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 2         | (199.234)                       | (0,05)               |
| 178.227.786 £  | 233.350.502 US\$    | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 19        | (10.163.476)                    | (2,28)               |
| 44.781 US\$  | 35.788 £            | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 2         | (36)                            | (0,00)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                                |           | <b>(11.858.313)</b>             | <b>(2,67)</b>        |

### Futures-Kontrakte (0,29 %) (31. Dezember 2023: (1,32 %))

| Anzahl Kontrakte   | Beschreibung                                     | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|--|---------------------------------|----------------------|
| 195  | US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2025 | (245.060)                       | (0,05)               |
| (55)   | US Treasury 2-Year Note (CBT) Future March 2025  | (4.018)                         | (0,00)               |
| 611  | US Treasury 5-Year Note (CBT) Future March 2025  | (539.143)                       | (0,12)               |
| 19   | US Treasury Long Bond (CBT) Future March 2025    | (87.564)                        | (0,02)               |
| 277  | US Treasury Ultra 10-Year Future March 2025      | (432.717)                       | (0,10)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten *</b> |  | <b>(1.308.502)</b>              | <b>(0,29)</b>        |

|   | Zeitwert US\$       | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(13.166.815)</b> | <b>(2,96)</b>        |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>434.777.106</b>  | <b>97,73</b>         |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>10.083.162</b>   | <b>2,27</b>          |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>444.860.268</b>  | <b>100,00</b>        |

^ Schuldverschreibungen mit einem Zinssatz von 0,00 %, wurden zum 31. Dezember 2024 eventuell noch nicht abgerechnet und haben somit keinen gültigen Zinssatz. Die Zinssätze werden erst bei Abrechnung gültig.

| Portfolioanalyse  | US\$               | % des Gesamtvermögens |
|---|--------------------|-----------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 106.797.437        | 22,99                 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden            | 293.307.401        | 63,12                 |
| † Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente  | 37.505.823         | 8,07                  |
| µ Investmentfonds   | 6.944              | 0,00                  |
| ± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden                          | (193.069)          | (0,04)                |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap                            | (2.647.430)        | (0,57)                |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>434.777.106</b> | <b>93,57</b>          |

## Global High Yield Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                 | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 95,31 % (31. Dezember 2023: 95,40 %)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>Euro</b>  |   |         |                       |                  |                              |
| 1.000.000  | A2A SpA*  | 5,00 %  | 31.12.2149            | 1.074.199        | 0,17                         |
| 200.000  | Abertis Infraestructuras Finance BV*                  | 3,25 %  | 31.12.2149            | 206.727          | 0,03                         |
| 500.000  | Abertis Infraestructuras Finance BV*                  | 4,87 %  | 31.12.2149            | 532.701          | 0,09                         |
| 500.000  | Accor SA*   | 4,88 %  | 31.12.2149            | 527.717          | 0,09                         |
| 800.000  | Accor SA*   | 7,25 %  | 31.12.2149            | 922.734          | 0,15                         |
| 369.000  | AccorInvest Group SA*                                 | 5,50 %  | 15.11.2031            | 392.371          | 0,06                         |
| 795.000  | Ahlstrom Holding 3 Oy*                                | 3,63 %  | 04.02.2028            | 814.699          | 0,13                         |
| 1.000.000  | Air France-KLM*                                       | 4,63 %  | 23.05.2029            | 1.069.184        | 0,17                         |
| 810.000  | Alexandrite Monnet UK Holdco Plc*                     | 10,50 % | 15.05.2029            | 924.597          | 0,15                         |
| 646.000  | Almaviva-The Italian Innovation Co SpA*               | 5,00 %  | 30.10.2030            | 683.662          | 0,11                         |
| 455.000  | Altice Financing SA*                                  | 3,00 %  | 15.01.2028            | 365.304          | 0,06                         |
| 462.000  | Altice Financing SA**                                 | 4,25 %  | 15.08.2029            | 365.768          | 0,06                         |
| 100.000  | Altice France SA**                                    | 2,13 %  | 15.02.2025            | 98.217           | 0,02                         |
| 250.000  | Altice France SA**                                    | 4,13 %  | 15.01.2029            | 196.773          | 0,03                         |
| 958.000  | Altice France SA**                                    | 4,25 %  | 15.10.2029            | 753.775          | 0,12                         |
| 881.000  | Amber Finco Plc*                                      | 6,63 %  | 15.07.2029            | 967.980          | 0,16                         |
| 701.000  | APA Infrastructure Ltd*                               | 7,13 %  | 09.11.2083            | 801.732          | 0,13                         |
| 499.000  | Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc* | 2,13 %  | 15.08.2026            | 465.258          | 0,08                         |
| 923.000  | Ashland Services BV**                                 | 2,00 %  | 30.01.2028            | 917.009          | 0,15                         |
| 720.000  | Assemblin Caverion Group AB**                         | 6,74 %  | 01.07.2031            | 751.152          | 0,12                         |
| 620.000  | Avantor Funding Inc*                                  | 3,88 %  | 15.07.2028            | 642.672          | 0,10                         |
| 465.000  | Balder Finland OYJ*                                   | 1,38 %  | 24.05.2030            | 423.912          | 0,07                         |
| 606.000  | Banijay Entertainment SAS**                           | 7,00 %  | 01.05.2029            | 663.596          | 0,11                         |
| 422.000  | BE Semiconductor Industries NV**                      | 4,50 %  | 15.07.2031            | 456.850          | 0,07                         |
| 995.000  | Benteler International AG*                            | 9,38 %  | 15.05.2028            | 1.089.834        | 0,18                         |
| 1.118.000  | Birkenstock Financing Sarl*                           | 5,25 %  | 30.04.2029            | 1.177.828        | 0,19                         |
| 1.065.000  | Boels Topholding BV**                                 | 5,75 %  | 15.05.2030            | 1.156.273        | 0,19                         |
| 796.000  | Bubbles Bidco SpA**                                   | 6,50 %  | 30.09.2031            | 832.026          | 0,14                         |
| 500.000  | Canpack SA/Canpack US LLC*                            | 2,38 %  | 01.11.2027            | 505.454          | 0,08                         |
| 1.785.000  | Castellum AB*   | 3,13 %  | 31.12.2149            | 1.784.401        | 0,29                         |
| 1.370.000  | CECONOMY AG*  | 6,25 %  | 15.07.2029            | 1.473.121        | 0,24                         |
| 800.000  | Cerba Healthcare SACA*                                | 3,50 %  | 31.05.2028            | 685.825          | 0,11                         |
| 655.000  | Cheplapharm Arzneimittel GmbH**                       | 7,50 %  | 15.05.2030            | 669.350          | 0,11                         |
| 1.341.000  | Constellium SE*                                       | 3,13 %  | 15.07.2029            | 1.325.194        | 0,22                         |
| 372.000  | Constellium SE*                                       | 5,38 %  | 15.08.2032            | 392.718          | 0,06                         |
| 315.000  | CPI Property Group SA*                                | 1,50 %  | 27.01.2031            | 259.662          | 0,04                         |
| 415.000  | CPI Property Group SA*                                | 1,75 %  | 14.01.2030            | 363.359          | 0,06                         |
| 715.000  | CPI Property Group SA*                                | 3,75 %  | 31.12.2149            | 661.668          | 0,11                         |
| 485.000  | CPI Property Group SA*                                | 4,88 %  | 31.12.2149            | 487.302          | 0,08                         |

## Global High Yield Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 95,31 % (31. Dezember 2023: 95,40 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |   |         |                       |                  |                              |
| 617.000  | CPI Property Group SA <sup>*</sup>                                    | 6,00 %  | 27.01.2032            | 644.371          | 0,10                         |
| 735.000  | Ctec II GmbH <sup>**</sup>  | 5,25 %  | 15.02.2030            | 705.987          | 0,12                         |
| 890.000  | Cullinan Holdco Scsp <sup>**</sup>                                    | 4,63 %  | 15.10.2026            | 870.539          | 0,14                         |
| 388.000  | Dufry One BV <sup>*</sup>   | 3,38 %  | 15.04.2028            | 400.851          | 0,06                         |
| 415.000  | Dufry One BV <sup>**</sup>  | 4,75 %  | 18.04.2031            | 446.883          | 0,07                         |
| 1.000.000  | Electricite de France SA <sup>*</sup>                                 | 2,63 %  | 31.12.2149            | 980.587          | 0,16                         |
| 2.000.000  | Electricite de France SA <sup>*</sup>                                 | 3,38 %  | 31.12.2149            | 1.938.680        | 0,32                         |
| 200.000  | Electricite de France SA <sup>*</sup>                                 | 5,63 %  | 31.12.2149            | 214.825          | 0,04                         |
| 1.600.000  | Electricite de France SA <sup>*</sup>                                 | 7,50 %  | 31.12.2149            | 1.834.696        | 0,30                         |
| 870.000  | Elior Group SA <sup>*</sup>   | 3,75 %  | 15.07.2026            | 896.297          | 0,15                         |
| 621.000  | EMRLD Borrower LP/Emerald Co-Issuer Inc <sup>**</sup>                 | 6,38 %  | 15.12.2030            | 682.623          | 0,11                         |
| 753.000  | Enel SpA <sup>*</sup>   | 6,38 %  | 31.12.2149            | 839.910          | 0,14                         |
| 965.000  | Energizer Gamma Acquisition BV <sup>**</sup>                          | 3,50 %  | 30.06.2029            | 966.226          | 0,16                         |
| 1.134.000  | Ephios Subco 3 Sarl <sup>**</sup>                                     | 7,88 %  | 31.01.2031            | 1.284.146        | 0,21                         |
| 1.267.000  | Eroski S Coop <sup>*</sup>  | 10,63 % | 30.04.2029            | 1.433.337        | 0,23                         |
| 1.130.000  | Eurofins Scientific SE <sup>*</sup>                                   | 6,75 %  | 31.12.2149            | 1.235.221        | 0,20                         |
| 1.512.000  | Fastighets AB Balder <sup>*</sup>                                     | 2,87 %  | 02.06.2081            | 1.530.448        | 0,25                         |
| 608.000  | Fedrigoni SpA <sup>**</sup>   | 6,13 %  | 15.06.2031            | 634.898          | 0,10                         |
| 425.000  | Fiber Bidco SpA <sup>*</sup>  | 6,68 %  | 15.01.2030            | 445.529          | 0,07                         |
| 295.000  | Fiber Midco SpA <sup>*</sup>  | 10,00 % | 15.06.2029            | 317.799          | 0,05                         |
| 759.000  | Flora Food Management BV <sup>**</sup>                                | 6,88 %  | 02.07.2029            | 823.058          | 0,13                         |
| 1.198.000  | Forvia SE <sup>*</sup>  | 2,75 %  | 15.02.2027            | 1.198.593        | 0,19                         |
| 355.000  | Forvia SE <sup>*</sup>  | 5,13 %  | 15.06.2029            | 369.257          | 0,06                         |
| 636.000  | Fressnapf Holding SE <sup>**</sup>                                    | 5,25 %  | 31.10.2031            | 681.361          | 0,11                         |
| 474.000  | Goldstory SAS <sup>*</sup>  | 6,75 %  | 01.02.2030            | 515.116          | 0,08                         |
| 326.000  | Gruenthal GmbH <sup>**</sup>  | 4,63 %  | 15.11.2031            | 342.747          | 0,06                         |
| 383.000  | Grupo Antolin-Irausa SA <sup>*</sup>                                  | 10,38 % | 30.01.2030            | 337.262          | 0,06                         |
| 600.000  | Guala Closures SpA <sup>*</sup>                                       | 3,25 %  | 15.06.2028            | 601.515          | 0,10                         |
| 300.000  | Heimstaden AB <sup>*</sup>  | 4,38 %  | 06.03.2027            | 286.504          | 0,05                         |
| 300.000  | Heimstaden AB <sup>*</sup>  | 6,75 %  | 31.12.2149            | 222.369          | 0,03                         |
| 420.000  | Heimstaden Bostad AB <sup>*</sup>                                     | 2,63 %  | 31.12.2149            | 405.010          | 0,07                         |
| 300.000  | Heimstaden Bostad AB <sup>*</sup>                                     | 3,00 %  | 31.12.2149            | 285.928          | 0,05                         |
| 552.000  | Heimstaden Bostad AB <sup>*</sup>                                     | 6,25 %  | 31.12.2149            | 576.712          | 0,09                         |
| 1.230.000  | Heimstaden Bostad Treasury BV <sup>*</sup>                            | 1,63 %  | 13.10.2031            | 1.088.072        | 0,18                         |
| 500.000  | Holding d'Infrastructures des Metiers de l'Environnement <sup>*</sup> | 4,88 %  | 24.10.2029            | 533.618          | 0,09                         |
| 645.000  | House of HR Group BV <sup>**</sup>                                    | 9,00 %  | 03.11.2029            | 669.230          | 0,11                         |
| 380.000  | HT Troplast GmbH <sup>**</sup>  | 9,38 %  | 15.07.2028            | 419.324          | 0,07                         |
| 338.000  | Iliad Holding SASU <sup>**</sup>                                      | 5,38 %  | 15.04.2030            | 360.978          | 0,06                         |
| 1.670.000  | Iliad Holding SASU <sup>**</sup>                                      | 5,63 %  | 15.10.2028            | 1.777.055        | 0,29                         |

## Global High Yield Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung             | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|-----------------------------------|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 95,31 % (31. Dezember 2023: 95,40 %) (Fortsetzung)</b> |                                   |         |                       |                  |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |                                   |         |                       |                  |                              |
| 726.000  | INEOS Quattro Finance 2 Plc*      | 8,50 %  | 15.03.2029            | 808.135          | 0,13                         |
| 446.000  | IQVIA Inc**                       | 2,88 %  | 15.06.2028            | 453.753          | 0,07                         |
| 820.000  | Italmatch Chemicals SpA*          | 10,00 % | 06.02.2028            | 901.339          | 0,15                         |
| 650.000  | Jaguar Land Rover Automotive Plc* | 4,50 %  | 15.07.2028            | 680.556          | 0,11                         |
| 1.090.000  | Kaixo Bondco Telecom SA*          | 5,13 %  | 30.09.2029            | 1.155.536        | 0,19                         |
| 710.000  | Kapla Holding SAS*                | 6,39 %  | 31.07.2030            | 740.741          | 0,12                         |
| 1.000.000  | Koninklijke KPN NV*               | 6,00 %  | 31.12.2149            | 1.105.329        | 0,18                         |
| 805.000  | Kronos International Inc**        | 9,50 %  | 15.03.2029            | 919.500          | 0,15                         |
| 1.438.000  | Lorca Telecom Bondco SA*          | 4,00 %  | 18.09.2027            | 1.496.494        | 0,24                         |
| 500.000  | Loxam SAS*                        | 4,50 %  | 15.04.2027            | 511.343          | 0,08                         |
| 498.000  | Loxam SAS*                        | 5,75 %  | 15.07.2027            | 516.897          | 0,08                         |
| 605.000  | Miller Homes Group Finco Plc**    | 8,27 %  | 15.05.2028            | 632.842          | 0,10                         |
| 945.000  | Motel One GmbH**                  | 7,75 %  | 02.04.2031            | 1.056.837        | 0,17                         |
| 1.144.000  | Motion Finco Sarl*                | 7,38 %  | 15.06.2030            | 1.207.908        | 0,20                         |
| 1.202.000  | Multiversity SpA*                 | 7,30 %  | 30.10.2028            | 1.257.083        | 0,21                         |
| 500.000  | Nexans SA*                        | 4,13 %  | 29.05.2029            | 532.391          | 0,09                         |
| 400.000  | Nexans SA*                        | 4,25 %  | 11.03.2030            | 425.300          | 0,07                         |
| 475.000  | Nidda Healthcare Holding GmbH**   | 5,63 %  | 21.02.2030            | 509.811          | 0,09                         |
| 310.000  | Nidda Healthcare Holding GmbH**   | 6,89 %  | 23.10.2030            | 325.419          | 0,05                         |
| 1.614.000  | Novelis Sheet Ingot GmbH*         | 3,38 %  | 15.04.2029            | 1.612.081        | 0,26                         |
| 950.000  | Odido Group Holding BV**          | 5,50 %  | 15.01.2030            | 980.781          | 0,16                         |
| 802.000  | Olympus Water US Holding Corp*    | 5,38 %  | 01.10.2029            | 796.997          | 0,13                         |
| 900.000  | Olympus Water US Holding Corp*    | 9,63 %  | 15.11.2028            | 997.104          | 0,16                         |
| 1.405.000  | Ontex Group NV*                   | 3,50 %  | 15.07.2026            | 1.454.118        | 0,24                         |
| 794.000  | Optics Bidco SpA*                 | 6,88 %  | 15.02.2028            | 896.389          | 0,15                         |
| 1.468.000  | Optics Bidco SpA*                 | 7,88 %  | 31.07.2028            | 1.721.144        | 0,28                         |
| 965.000  | Orsted AS*                        | 5,13 %  | 14.03.3024            | 1.035.780        | 0,17                         |
| 500.000  | Orsted AS*                        | 5,25 %  | 08.12.3022            | 538.266          | 0,09                         |
| 527.000  | Pachelbel Bidco SpA**             | 7,13 %  | 17.05.2031            | 585.988          | 0,10                         |
| 714.000  | Paprec Holding SA**               | 6,50 %  | 17.11.2027            | 783.708          | 0,13                         |
| 514.150  | PCF GmbH*                         | 4,75 %  | 15.04.2029            | 443.186          | 0,07                         |
| 1.386.000  | PEU Finance Plc*                  | 7,25 %  | 01.07.2028            | 1.510.164        | 0,25                         |
| 347.000  | Picard Groupe SAS**               | 6,38 %  | 01.07.2029            | 375.326          | 0,06                         |
| 490.000  | PLT VII Finance Sarl*             | 6,00 %  | 15.06.2031            | 535.639          | 0,09                         |
| 700.000  | Proximus SADP*                    | 4,75 %  | 31.12.2149            | 725.756          | 0,12                         |
| 433.000  | Q-Park Holding I BV*              | 5,13 %  | 01.03.2029            | 464.628          | 0,08                         |
| 300.000  | Roquette Freres SA*               | 5,49 %  | 31.12.2149            | 317.978          | 0,05                         |
| 927.000  | Rossini Sarl*                     | 6,75 %  | 31.12.2029            | 1.019.638        | 0,17                         |
| 376.761  | Sigma Holdco BV**                 | 5,75 %  | 15.05.2026            | 387.776          | 0,06                         |

## Global High Yield Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|--------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 95,31 % (31. Dezember 2023: 95,40 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                    |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |   |        |                       |                    |                              |
| 1.040.000  | Standard Industries Inc**   | 2,25 % | 21.11.2026            | 1.070.772          | 0,17                         |
| 229.768  | Summer BC Holdco A Sarl**   | 9,25 % | 31.10.2027            | 240.304            | 0,04                         |
| 710.000  | Summer BC Holdco B Sarl**   | 5,75 % | 31.10.2026            | 737.227            | 0,12                         |
| 975.000  | Synthomer Plc*  | 7,38 % | 02.05.2029            | 1.058.725          | 0,17                         |
| 784.000  | Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH**                                      | 5,38 % | 15.07.2029            | 841.717            | 0,14                         |
| 331.000  | Telecom Italia SpA*   | 6,88 % | 15.02.2028            | 375.180            | 0,06                         |
| 784.000  | Telecom Italia SpA*   | 7,88 % | 31.07.2028            | 921.759            | 0,15                         |
| 700.000  | Telefonica Europe BV*   | 5,75 % | 31.12.2149            | 779.214            | 0,13                         |
| 200.000  | Telefonica Europe BV*   | 6,14 % | 31.12.2149            | 224.575            | 0,04                         |
| 1.600.000  | Telefonica Europe BV*   | 6,75 % | 31.12.2149            | 1.865.880          | 0,30                         |
| 1.200.000  | Telefonica Europe BV*   | 7,13 % | 31.12.2149            | 1.374.999          | 0,22                         |
| 510.000  | TI Automotive Finance Plc**   | 3,75 % | 15.04.2029            | 526.482            | 0,09                         |
| 1.008.000  | TK Elevator Holdco GmbH**   | 6,63 % | 15.07.2028            | 1.050.088          | 0,17                         |
| 1.667.000  | TK Elevator Midco GmbH**  | 4,38 % | 15.07.2027            | 1.730.462          | 0,28                         |
| 1.115.000  | Trivium Packaging Finance BV*   | 3,75 % | 15.08.2026            | 1.150.461          | 0,19                         |
| 402.000  | TUI Cruises GmbH**  | 5,00 % | 15.05.2030            | 424.313            | 0,07                         |
| 305.000  | United Group BV**   | 5,25 % | 01.02.2030            | 314.445            | 0,05                         |
| 501.000  | United Group BV**   | 6,50 % | 31.10.2031            | 530.533            | 0,09                         |
| 400.000  | United Group BV**   | 6,75 % | 15.02.2031            | 429.698            | 0,07                         |
| 400.000  | Valeo SE*   | 4,50 % | 11.04.2030            | 415.325            | 0,07                         |
| 1.200.000  | Veolia Environnement SA*  | 2,50 % | 31.12.2149            | 1.165.684          | 0,19                         |
| 1.520.000  | Verisure Holding AB*  | 3,25 % | 15.02.2027            | 1.557.974          | 0,25                         |
| 1.000.000  | Verisure Holding AB*  | 5,50 % | 15.05.2030            | 1.082.499          | 0,18                         |
| 635.000  | Verisure Midholding AB*   | 5,25 % | 15.02.2029            | 661.294            | 0,11                         |
| 785.000  | VF Corp*  | 4,25 % | 07.03.2029            | 815.912            | 0,13                         |
| 625.000  | Virgin Media Finance Plc**  | 3,75 % | 15.07.2030            | 599.990            | 0,10                         |
| 150.000  | Vmed O2 UK Financing I Plc**  | 5,63 % | 15.04.2032            | 158.867            | 0,03                         |
| 498.000  | Zegona Finance Plc*   | 6,75 % | 15.07.2029            | 551.079            | 0,09                         |
| 2.015.000  | Ziggo Bond Co BV*   | 3,38 % | 28.02.2030            | 1.909.915          | 0,31                         |
| <b>Euro insgesamt</b>  |   |        |                       | <b>114.665.200</b> | <b>18,70</b>                 |
| <b>Britisches Pfund</b>  |   |        |                       |                    |                              |
| 276.144  | AA Bond Co Ltd*   | 6,50 % | 31.01.2026            | 346.707            | 0,06                         |
| 279.000  | AA Bond Co Ltd*   | 6,85 % | 31.07.2031            | 357.573            | 0,06                         |
| 470.000  | AA Bond Co Ltd*   | 7,38 % | 31.07.2029            | 613.288            | 0,10                         |
| 1.010.000  | Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl* | 4,88 % | 01.06.2028            | 1.176.405          | 0,19                         |
| 304.000  | B&M European Value Retail SA*   | 6,50 % | 27.11.2031            | 378.624            | 0,06                         |
| 780.000  | B&M European Value Retail SA*   | 8,13 % | 15.11.2030            | 1.044.154          | 0,17                         |
| 947.000  | Bellis Acquisition Co Plc**   | 8,13 % | 14.05.2030            | 1.153.039          | 0,19                         |

## Global High Yield Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 95,31 % (31. Dezember 2023: 95,40 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                   |                              |
| <b>Britisches Pfund (Fortsetzung)</b>  |   |         |                       |                   |                              |
| 280.000  | Bellis Finco Plc**  | 4,00 %  | 16.02.2027            | 332.262           | 0,05                         |
| 799.000  | British Telecommunications Plc*                                   | 8,38 %  | 20.12.2083            | 1.073.216         | 0,17                         |
| 800.000  | Co-operative Group Holdings 2011 Ltd*                             | 7,50 %  | 08.07.2026            | 1.028.872         | 0,17                         |
| 295.000  | CPI Property Group SA*  | 2,75 %  | 22.01.2028            | 338.054           | 0,06                         |
| 1.263.000  | CPUK Finance Ltd**  | 6,50 %  | 28.08.2026            | 1.583.877         | 0,26                         |
| 720.000  | Deuce Finco Plc**   | 5,50 %  | 15.06.2027            | 885.542           | 0,14                         |
| 618.000  | Edge Finco Plc**  | 8,13 %  | 15.08.2031            | 794.683           | 0,13                         |
| 300.000  | Electricite de France SA*   | 7,38 %  | 31.12.2149            | 382.550           | 0,06                         |
| 373.000  | Iceland Bondco Plc**  | 10,88 % | 15.12.2027            | 502.181           | 0,08                         |
| 1.341.000  | Maison Finco Plc**  | 6,00 %  | 31.10.2027            | 1.660.583         | 0,27                         |
| 500.000  | Miller Homes Group Finco Plc**                                    | 7,00 %  | 15.05.2029            | 611.912           | 0,10                         |
| 539.000  | Mobico Group Plc*   | 4,25 %  | 31.12.2149            | 648.130           | 0,11                         |
| 700.000  | MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp*                    | 2,50 %  | 24.03.2026            | 781.122           | 0,13                         |
| 756.000  | Ocado Group Plc*  | 10,50 % | 08.08.2029            | 964.387           | 0,16                         |
| 811.000  | Pinnacle Bidco Plc*   | 10,00 % | 11.10.2028            | 1.084.542         | 0,18                         |
| 1.020.000  | RAC Bond Co Plc**   | 5,25 %  | 04.11.2027            | 1.241.200         | 0,20                         |
| 810.000  | Travis Perkins Plc*   | 3,75 %  | 17.02.2026            | 994.155           | 0,16                         |
| 963.000  | TVL Finance Plc**   | 10,25 % | 28.04.2028            | 1.254.455         | 0,20                         |
| 186.000  | Virgin Media O2 Vendor Financing Notes V DAC*                     | 7,88 %  | 15.03.2032            | 232.827           | 0,04                         |
| 1.449.000  | Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC**                     | 4,88 %  | 15.07.2028            | 1.696.771         | 0,27                         |
| 520.000  | Zenith Finco Plc**  | 6,50 %  | 30.06.2027            | 494.714           | 0,08                         |
| <b>Britisches Pfund insgesamt</b>  |   |         |                       | <b>23.655.825</b> | <b>3,85</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>   |   |         |                       |                   |                              |
| 1.465.000  | 1011778 BC ULC/New Red Finance Inc**                              | 4,00 %  | 15.10.2030            | 1.311.531         | 0,22                         |
| 438.000  | 3R Lux Sarl**   | 9,75 %  | 05.02.2031            | 453.219           | 0,08                         |
| 1.410.000  | Acadia Healthcare Co Inc**  | 5,00 %  | 15.04.2029            | 1.320.462         | 0,21                         |
| 970.000  | Acadia Healthcare Co Inc**  | 5,50 %  | 01.07.2028            | 930.663           | 0,15                         |
| 632.000  | Access Bank Plc*  | 6,13 %  | 21.09.2026            | 605.609           | 0,10                         |
| 2.075.000  | Acrisure LLC/Acrisure Finance Inc**                               | 7,50 %  | 06.11.2030            | 2.138.837         | 0,35                         |
| 930.000  | Acrisure LLC/Acrisure Finance Inc**                               | 8,25 %  | 01.02.2029            | 963.960           | 0,16                         |
| 310.000  | Adient Global Holdings Ltd**                                      | 4,88 %  | 15.08.2026            | 305.664           | 0,05                         |
| 1.315.000  | Adient Global Holdings Ltd**                                      | 8,25 %  | 15.04.2031            | 1.345.329         | 0,22                         |
| 40.000   | ADT Security Corp**   | 4,13 %  | 01.08.2029            | 36.815            | 0,01                         |
| 2.300.000  | ADT Security Corp**   | 4,88 %  | 15.07.2032            | 2.113.292         | 0,35                         |
| 434.000  | Aegea Finance Sarl**  | 9,00 %  | 20.01.2031            | 443.233           | 0,07                         |
| 344.000  | AES Andes SA**  | 8,15 %  | 10.06.2055            | 348.628           | 0,06                         |
| 1.495.000  | Ahead DB Holdings LLC**   | 6,63 %  | 01.05.2028            | 1.466.974         | 0,24                         |
| 474.000  | Akbank TAS**  | 9,37 %  | 31.12.2149            | 482.960           | 0,08                         |
| 410.000  | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC** | 4,63 %  | 15.01.2027            | 401.738           | 0,07                         |

## Global High Yield Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 95,31 % (31. Dezember 2023: 95,40 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 45.000   | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC**           | 4,88 %  | 15.02.2030            | 42.918           | 0,01                         |
| 585.000  | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC**           | 5,88 %  | 15.02.2028            | 583.069          | 0,10                         |
| 520.000  | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC**           | 6,50 %  | 15.02.2028            | 527.307          | 0,09                         |
| 370.000  | Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**              | 6,50 %  | 01.10.2031            | 366.808          | 0,06                         |
| 2.575.000  | Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**              | 6,75 %  | 15.10.2027            | 2.556.305        | 0,42                         |
| 240.000  | Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**              | 6,75 %  | 15.04.2028            | 241.375          | 0,04                         |
| 1.095.000  | Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**              | 7,00 %  | 15.01.2031            | 1.100.476        | 0,18                         |
| 165.000  | Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**              | 7,38 %  | 01.10.2032            | 166.725          | 0,03                         |
| 1.345.000  | Allied Universal Holdco LLC**   | 7,88 %  | 15.02.2031            | 1.376.379        | 0,23                         |
| 1.655.000  | Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp**                 | 6,00 %  | 01.06.2029            | 1.509.743        | 0,25                         |
| 2.135.000  | Alpha Generation LLC**  | 6,75 %  | 15.10.2032            | 2.114.290        | 0,34                         |
| 235.000  | Altice Financing SA**   | 5,00 %  | 15.01.2028            | 184.177          | 0,03                         |
| 405.000  | Altice Financing SA**   | 5,75 %  | 15.08.2029            | 296.913          | 0,05                         |
| 1.100.000  | Altice France SA**  | 5,50 %  | 15.01.2028            | 815.232          | 0,13                         |
| 765.000  | Altice France SA**  | 5,50 %  | 15.10.2029            | 576.819          | 0,09                         |
| 385.000  | Altice France SA**  | 8,13 %  | 01.02.2027            | 312.538          | 0,05                         |
| 375.000  | Ambipar Lux Sarl**  | 9,88 %  | 06.02.2031            | 374.641          | 0,06                         |
| 365.000  | American Airlines Inc**   | 7,25 %  | 15.02.2028            | 374.455          | 0,06                         |
| 1.310.000  | American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd**                           | 5,75 %  | 20.04.2029            | 1.300.145        | 0,21                         |
| 270.000  | Amsted Industries Inc**   | 5,63 %  | 01.07.2027            | 268.735          | 0,04                         |
| 385.000  | AmWINS Group Inc**  | 6,38 %  | 15.02.2029            | 387.602          | 0,06                         |
| 470.000  | Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp**                | 5,38 %  | 15.06.2029            | 458.040          | 0,07                         |
| 305.000  | Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp**                | 5,75 %  | 15.01.2028            | 302.807          | 0,05                         |
| 555.000  | Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp**                | 6,63 %  | 01.02.2032            | 559.425          | 0,09                         |
| 600.000  | Archrock Partners LP/Archrock Partners Finance Corp**                       | 6,63 %  | 01.09.2032            | 599.820          | 0,10                         |
| 1.410.000  | Archrock Partners LP/Archrock Partners Finance Corp**                       | 6,88 %  | 01.04.2027            | 1.418.644        | 0,23                         |
| 660.000  | Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc** | 4,00 %  | 01.09.2029            | 567.694          | 0,09                         |
| 400.000  | Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc** | 6,00 %  | 15.06.2027            | 397.235          | 0,07                         |
| 875.000  | Arsenal AIC Parent LLC**  | 8,00 %  | 01.10.2030            | 906.541          | 0,15                         |
| 550.000  | Arsenal AIC Parent LLC**  | 11,50 % | 01.10.2031            | 616.017          | 0,10                         |
| 965.000  | Asbury Automotive Group Inc**   | 4,63 %  | 15.11.2029            | 899.398          | 0,15                         |
| 830.000  | Asbury Automotive Group Inc**   | 5,00 %  | 15.02.2032            | 758.051          | 0,12                         |
| 1.985.000  | Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**                      | 5,88 %  | 30.06.2029            | 1.935.088        | 0,32                         |
| 900.000  | Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**                      | 6,63 %  | 15.10.2032            | 895.463          | 0,15                         |
| 205.000  | Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**                      | 8,25 %  | 31.12.2028            | 209.433          | 0,03                         |
| 2.090.000  | ASGN Inc**  | 4,63 %  | 15.05.2028            | 1.986.795        | 0,32                         |
| 610.000  | Ashland Inc**   | 3,38 %  | 01.09.2031            | 522.365          | 0,08                         |
| 350.000  | Ashland Inc*  | 6,88 %  | 15.05.2043            | 366.779          | 0,06                         |
| 2.995.000  | AthenaHealth Group Inc**  | 6,50 %  | 15.02.2030            | 2.849.251        | 0,46                         |
| 850.000  | ATI Inc*  | 5,88 %  | 01.12.2027            | 843.234          | 0,14                         |

## Global High Yield Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 95,31 % (31. Dezember 2023: 95,40 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 1.260.000  | ATI Inc <sup>*</sup>                                    | 7,25 %  | 15.08.2030            | 1.297.836        | 0,21                         |
| 1.020.000  | ATS Corp <sup>**</sup>                                  | 4,13 %  | 15.12.2028            | 949.262          | 0,15                         |
| 1.115.000  | Avantor Funding Inc <sup>**</sup>                       | 4,63 %  | 15.07.2028            | 1.065.209        | 0,17                         |
| 240.000  | Avient Corp <sup>**</sup>                               | 6,25 %  | 01.11.2031            | 236.995          | 0,04                         |
| 2.060.000  | Avient Corp <sup>**</sup>                               | 7,13 %  | 01.08.2030            | 2.113.105        | 0,34                         |
| 1.755.000  | Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV <sup>**</sup> | 7,25 %  | 15.02.2031            | 1.818.329        | 0,30                         |
| 375.000  | Axis Bank Ltd <sup>*</sup>                              | 4,10 %  | 31.12.2149            | 359.154          | 0,06                         |
| 1.130.000  | Azorra Finance Ltd <sup>**</sup>                        | 7,75 %  | 15.04.2030            | 1.124.562        | 0,18                         |
| 200.000  | Banco BTG Pactual SA <sup>**</sup>                      | 6,25 %  | 08.04.2029            | 200.434          | 0,03                         |
| 939.000  | Banco Davivienda SA <sup>**</sup>                       | 6,65 %  | 31.12.2149            | 807.950          | 0,13                         |
| 505.000  | Banco de Credito e Inversiones SA <sup>**</sup>         | 8,75 %  | 31.12.2149            | 528.608          | 0,08                         |
| 607.000  | Banco Mercantil del Norte SA <sup>*</sup>               | 7,50 %  | 31.12.2149            | 587.815          | 0,09                         |
| 460.000  | Bancolombia SA <sup>*</sup>                             | 8,63 %  | 24.12.2034            | 482.072          | 0,08                         |
| 1.435.000  | Bath & Body Works Inc <sup>**</sup>                     | 6,63 %  | 01.10.2030            | 1.451.393        | 0,24                         |
| 690.000  | Bath & Body Works Inc <sup>*</sup>                      | 6,75 %  | 01.07.2036            | 702.162          | 0,11                         |
| 2.440.000  | Bausch Health Cos Inc <sup>**</sup>                     | 4,88 %  | 01.06.2028            | 1.954.721        | 0,32                         |
| 475.000  | Bausch Health Cos Inc <sup>**</sup>                     | 5,75 %  | 15.08.2027            | 413.789          | 0,07                         |
| 505.000  | Bausch Health Cos Inc <sup>**</sup>                     | 6,13 %  | 01.02.2027            | 458.851          | 0,07                         |
| 1.170.000  | BBVA Bancomer SA <sup>**</sup>                          | 5,88 %  | 13.09.2034            | 1.111.118        | 0,18                         |
| 925.000  | BCPE Empire Holdings Inc <sup>**</sup>                  | 7,63 %  | 01.05.2027            | 922.783          | 0,15                         |
| 490.000  | Beacon Roofing Supply Inc <sup>**</sup>                 | 4,13 %  | 15.05.2029            | 465.286          | 0,08                         |
| 670.000  | Beazer Homes USA Inc <sup>*</sup>                       | 5,88 %  | 15.10.2027            | 661.865          | 0,11                         |
| 420.000  | Beazer Homes USA Inc <sup>**</sup>                      | 7,25 %  | 15.10.2029            | 426.315          | 0,07                         |
| 1.905.000  | Beazer Homes USA Inc <sup>**</sup>                      | 7,50 %  | 15.03.2031            | 1.937.054        | 0,32                         |
| 225.000  | Benteler International AG <sup>**</sup>                 | 10,50 % | 15.05.2028            | 236.758          | 0,04                         |
| 1.065.000  | Berry Global Inc <sup>**</sup>                          | 5,63 %  | 15.07.2027            | 1.064.309        | 0,17                         |
| 405.000  | Blackstone Mortgage Trust Inc <sup>**</sup>             | 3,75 %  | 15.01.2027            | 386.106          | 0,06                         |
| 430.000  | Blackstone Mortgage Trust Inc <sup>**</sup>             | 7,75 %  | 01.12.2029            | 442.499          | 0,07                         |
| 1.710.000  | Block Inc <sup>**</sup>                                 | 6,50 %  | 15.05.2032            | 1.728.645        | 0,28                         |
| 1.025.000  | Bombardier Inc <sup>**</sup>                            | 6,00 %  | 15.02.2028            | 1.021.718        | 0,17                         |
| 370.000  | Bombardier Inc <sup>**</sup>                            | 7,00 %  | 01.06.2032            | 376.849          | 0,06                         |
| 1.035.000  | Bombardier Inc <sup>**</sup>                            | 7,25 %  | 01.07.2031            | 1.068.664        | 0,17                         |
| 875.000  | Bombardier Inc <sup>**</sup>                            | 8,75 %  | 15.11.2030            | 941.661          | 0,15                         |
| 2.390.000  | Boost Newco Borrower LLC <sup>**</sup>                  | 7,50 %  | 15.01.2031            | 2.507.479        | 0,41                         |
| 525.000  | Braskem Idesa SAPI <sup>**</sup>                        | 6,99 %  | 20.02.2032            | 386.426          | 0,07                         |
| 964.000  | Braskem Netherlands Finance BV <sup>*</sup>             | 7,25 %  | 13.02.2033            | 892.062          | 0,15                         |
| 442.000  | Braskem Netherlands Finance BV <sup>**</sup>            | 8,50 %  | 12.01.2031            | 443.499          | 0,07                         |
| 1.085.000  | BroadStreet Partners Inc <sup>**</sup>                  | 5,88 %  | 15.04.2029            | 1.055.262        | 0,17                         |
| 500.000  | Builders FirstSource Inc <sup>**</sup>                  | 5,00 %  | 01.03.2030            | 476.991          | 0,08                         |

## Global High Yield Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 95,31 % (31. Dezember 2023: 95,40 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 830.000  | Builders FirstSource Inc**  | 6,38 %  | 01.03.2034            | 820.194          | 0,13                         |
| 530.000  | Cable One Inc**   | 4,00 %  | 15.11.2030            | 443.436          | 0,07                         |
| 560.000  | Cablevision Lightpath LLC**   | 5,63 %  | 15.09.2028            | 522.850          | 0,09                         |
| 525.000  | Calderys Financing II LLC**   | 11,75 % | 01.06.2028            | 534.492          | 0,09                         |
| 750.000  | Calderys Financing LLC**  | 11,25 % | 01.06.2028            | 803.732          | 0,13                         |
| 1.265.000  | Calpine Corp**  | 5,00 %  | 01.02.2031            | 1.190.484        | 0,19                         |
| 940.000  | Camelot Return Merger Sub Inc**   | 8,75 %  | 01.08.2028            | 901.778          | 0,15                         |
| 935.000  | Canpack SA/Canpack US LLC**   | 3,88 %  | 15.11.2029            | 842.827          | 0,14                         |
| 542.000  | CAS Capital No 1 Ltd*   | 4,00 %  | 31.12.2149            | 519.489          | 0,09                         |
| 880.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                | 4,25 %  | 01.02.2031            | 768.016          | 0,13                         |
| 295.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                | 4,50 %  | 15.08.2030            | 265.142          | 0,04                         |
| 620.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                | 4,50 %  | 01.05.2032            | 534.017          | 0,09                         |
| 755.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                | 4,75 %  | 01.03.2030            | 690.313          | 0,11                         |
| 170.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                | 4,75 %  | 01.02.2032            | 149.396          | 0,02                         |
| 190.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                | 5,00 %  | 01.02.2028            | 183.300          | 0,03                         |
| 1.815.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                | 5,13 %  | 01.05.2027            | 1.784.989        | 0,29                         |
| 2.975.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                | 6,38 %  | 01.09.2029            | 2.952.871        | 0,48                         |
| 1.250.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                | 7,38 %  | 01.03.2031            | 1.275.135        | 0,21                         |
| 800.000  | Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co/Magnum Management Corp/Millennium Op** | 5,25 %  | 15.07.2029            | 769.572          | 0,13                         |
| 1.560.000  | Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co/Magnum Management Corp/Millennium Op** | 6,50 %  | 01.10.2028            | 1.569.781        | 0,26                         |
| 461.000  | Cemex SAB de CV**   | 5,13 %  | 31.12.2149            | 451.943          | 0,07                         |
| 687.000  | Central American Bottling Corp/CBC Bottling Holdco SL/Beliv Holdco SL**     | 5,25 %  | 27.04.2029            | 651.927          | 0,10                         |
| 265.000  | Central Parent Inc/CDK Global Inc**   | 7,25 %  | 15.06.2029            | 262.197          | 0,04                         |
| 150.000  | Central Parent LLC/CDK Global II LLC/CDK Financing Co Inc**                 | 8,00 %  | 15.06.2029            | 152.909          | 0,03                         |
| 1.290.000  | Champions Financing Inc**   | 8,75 %  | 15.02.2029            | 1.259.246        | 0,21                         |
| 1.565.000  | Chart Industries Inc**  | 7,50 %  | 01.01.2030            | 1.629.051        | 0,26                         |
| 200.000  | Chart Industries Inc**  | 9,50 %  | 01.01.2031            | 215.153          | 0,03                         |
| 650.000  | Civitas Resources Inc**   | 8,38 %  | 01.07.2028            | 675.882          | 0,11                         |
| 765.000  | Civitas Resources Inc**   | 8,63 %  | 01.11.2030            | 801.839          | 0,13                         |
| 1.070.000  | Clear Channel Outdoor Holdings Inc**  | 5,13 %  | 15.08.2027            | 1.031.168        | 0,17                         |
| 870.000  | Clear Channel Outdoor Holdings Inc**  | 7,88 %  | 01.04.2030            | 896.438          | 0,14                         |
| 1.145.000  | Cleveland-Cliffs Inc**  | 6,88 %  | 01.11.2029            | 1.134.031        | 0,19                         |
| 620.000  | Cleveland-Cliffs Inc**  | 7,00 %  | 15.03.2032            | 609.684          | 0,10                         |
| 475.000  | Cleveland-Cliffs Inc**  | 7,38 %  | 01.05.2033            | 467.109          | 0,08                         |
| 2.490.000  | Cloud Software Group Inc**  | 6,50 %  | 31.03.2029            | 2.447.142        | 0,40                         |
| 410.000  | Cloud Software Group Inc**  | 8,25 %  | 30.06.2032            | 423.118          | 0,07                         |
| 1.125.000  | Cloud Software Group Inc**  | 9,00 %  | 30.09.2029            | 1.143.612        | 0,19                         |
| 645.000  | Clydesdale Acquisition Holdings Inc**                                       | 6,88 %  | 15.01.2030            | 650.171          | 0,11                         |
| 450.000  | Clydesdale Acquisition Holdings Inc**                                       | 8,75 %  | 15.04.2030            | 456.999          | 0,08                         |

## Global High Yield Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung  | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 95,31 % (31. Dezember 2023: 95,40 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 500.000  | Colombia Telecomunicaciones SA ESP**                                   | 4,95 %  | 17.07.2030            | 420.317          | 0,07                         |
| 425.000  | CommScope LLC**  | 6,00 %  | 01.03.2026            | 423.406          | 0,07                         |
| 315.000  | CommScope LLC**  | 8,25 %  | 01.03.2027            | 301.627          | 0,05                         |
| 1.254.000  | CommScope LLC**  | 9,50 %  | 15.12.2031            | 1.301.451        | 0,21                         |
| 275.000  | CommScope Technologies LLC**   | 5,00 %  | 15.03.2027            | 246.162          | 0,04                         |
| 535.000  | Community Health Systems Inc**   | 4,75 %  | 15.02.2031            | 415.669          | 0,07                         |
| 1.540.000  | Community Health Systems Inc**   | 5,63 %  | 15.03.2027            | 1.479.682        | 0,24                         |
| 745.000  | Community Health Systems Inc**   | 6,00 %  | 15.01.2029            | 667.886          | 0,11                         |
| 55.000   | Community Health Systems Inc**   | 6,13 %  | 01.04.2030            | 37.792           | 0,00                         |
| 55.000   | Community Health Systems Inc**   | 6,88 %  | 15.04.2029            | 41.607           | 0,01                         |
| 123.000  | Compania de Minas Buenaventura SAA**                                   | 5,50 %  | 23.07.2026            | 122.991          | 0,02                         |
| 1.070.000  | Comstock Resources Inc**   | 5,88 %  | 15.01.2030            | 998.909          | 0,16                         |
| 926.000  | Comstock Resources Inc**   | 6,75 %  | 01.03.2029            | 903.621          | 0,15                         |
| 325.000  | Consolidated Communications Inc**                                      | 5,00 %  | 01.10.2028            | 302.814          | 0,05                         |
| 1.775.000  | Consolidated Communications Inc**                                      | 6,50 %  | 01.10.2028            | 1.712.197        | 0,28                         |
| 337.000  | Consolidated Energy Finance SA**                                       | 12,00 % | 15.02.2031            | 323.869          | 0,05                         |
| 1.680.000  | Constellium SE**   | 5,63 %  | 15.06.2028            | 1.651.132        | 0,27                         |
| 329.333  | Continuum Green Energy India Pvt/Co-Issuers**                          | 7,50 %  | 26.06.2033            | 340.574          | 0,05                         |
| 325.000  | Cornerstone Building Brands Inc**                                      | 6,13 %  | 15.01.2029            | 259.655          | 0,04                         |
| 425.000  | Cornerstone Building Brands Inc**                                      | 9,50 %  | 15.08.2029            | 414.166          | 0,07                         |
| 376.000  | Cosan Luxembourg SA**  | 7,25 %  | 27.06.2031            | 369.600          | 0,06                         |
| 410.000  | Coty Inc/HFC Prestige Products Inc/HFC Prestige International US LLC** | 4,75 %  | 15.01.2029            | 391.093          | 0,06                         |
| 1.065.000  | Coty Inc/HFC Prestige Products Inc/HFC Prestige International US LLC** | 6,63 %  | 15.07.2030            | 1.083.367        | 0,18                         |
| 1.840.000  | Cougar JV Subsidiary LLC**   | 8,00 %  | 15.05.2032            | 1.911.761        | 0,31                         |
| 1.235.000  | CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC**                               | 5,50 %  | 15.06.2031            | 1.180.546        | 0,19                         |
| 1.075.000  | CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC**                               | 7,50 %  | 15.12.2033            | 1.131.260        | 0,18                         |
| 575.000  | Crescent Energy Finance LLC**  | 7,38 %  | 15.01.2033            | 558.960          | 0,09                         |
| 340.000  | Crescent Energy Finance LLC**  | 7,63 %  | 01.04.2032            | 338.565          | 0,06                         |
| 295.000  | CSC Holdings LLC**   | 4,13 %  | 01.12.2030            | 213.010          | 0,04                         |
| 870.000  | CSC Holdings LLC**   | 4,63 %  | 01.12.2030            | 455.556          | 0,07                         |
| 385.000  | CSC Holdings LLC**   | 5,00 %  | 15.11.2031            | 200.926          | 0,03                         |
| 455.000  | CSC Holdings LLC**   | 5,38 %  | 01.02.2028            | 393.028          | 0,06                         |
| 610.000  | CSC Holdings LLC**   | 5,50 %  | 15.04.2027            | 546.633          | 0,09                         |
| 1.505.000  | CSC Holdings LLC**   | 5,75 %  | 15.01.2030            | 857.876          | 0,14                         |
| 380.000  | CSC Holdings LLC**   | 6,50 %  | 01.02.2029            | 320.456          | 0,05                         |
| 385.000  | CSC Holdings LLC**   | 7,50 %  | 01.04.2028            | 265.474          | 0,04                         |
| 570.000  | CSC Holdings LLC**   | 11,25 % | 15.05.2028            | 563.210          | 0,09                         |
| 1.945.000  | CSC Holdings LLC**   | 11,75 % | 31.01.2029            | 1.922.051        | 0,31                         |
| 528.000  | CSN Resources SA**   | 4,63 %  | 10.06.2031            | 410.434          | 0,07                         |

## Global High Yield Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 95,31 % (31. Dezember 2023: 95,40 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 1.150.000  | Cushman & Wakefield US Borrower LLC**   | 6,75 %  | 15.05.2028            | 1.152.120        | 0,19                         |
| 635.000  | Cushman & Wakefield US Borrower LLC**   | 8,88 %  | 01.09.2031            | 684.084          | 0,11                         |
| 1.255.000  | Dealer Tire LLC/DT Issuer LLC**   | 8,00 %  | 01.02.2028            | 1.234.158        | 0,20                         |
| 80.000   | Digicel Intermediate Holdings Ltd/Digicel International Finance Ltd/Difl US** | 12,00 % | 25.05.2027            | 79.190           | 0,01                         |
| 775.000  | Dornoch Debt Merger Sub Inc**   | 6,63 %  | 15.10.2029            | 628.590          | 0,10                         |
| 575.000  | Ecopetrol SA**  | 5,88 %  | 28.05.2045            | 396.575          | 0,07                         |
| 200.000  | Ecopetrol SA*   | 7,75 %  | 01.02.2032            | 194.249          | 0,03                         |
| 309.000  | Ecopetrol SA*   | 8,88 %  | 13.01.2033            | 315.108          | 0,05                         |
| 935.000  | Electricite de France SA**  | 9,13 %  | 31.12.2149            | 1.056.974        | 0,17                         |
| 735.000  | Ellucian Holdings Inc**   | 6,50 %  | 01.12.2029            | 737.149          | 0,12                         |
| 575.000  | Emirates NBD Bank PJSC*   | 6,13 %  | 31.12.2149            | 574.856          | 0,09                         |
| 755.000  | EMRLD Borrower LP/Emerald Co-Issuer Inc**                                     | 6,63 %  | 15.12.2030            | 756.950          | 0,12                         |
| 625.000  | EMRLD Borrower LP/Emerald Co-Issuer Inc**                                     | 6,75 %  | 15.07.2031            | 630.333          | 0,10                         |
| 430.000  | Encompass Health Corp*  | 4,50 %  | 01.02.2028            | 415.271          | 0,07                         |
| 640.000  | Encompass Health Corp*  | 4,63 %  | 01.04.2031            | 591.517          | 0,09                         |
| 500.000  | Endeavour Mining Plc**  | 5,00 %  | 14.10.2026            | 486.813          | 0,08                         |
| 356.075  | Energiean Israel Finance Ltd**  | 5,38 %  | 30.03.2028            | 330.575          | 0,05                         |
| 100.703  | Energiean Israel Finance Ltd**  | 8,50 %  | 30.09.2033            | 99.155           | 0,02                         |
| 830.000  | EnerSys**   | 6,63 %  | 15.01.2032            | 835.227          | 0,14                         |
| 400.000  | EnfraGen Energia Sur SA/EnfraGen Spain SA/Prime Energia SpA**                 | 5,38 %  | 30.12.2030            | 341.527          | 0,06                         |
| 945.000  | EquipmentShare.com Inc**  | 9,00 %  | 15.05.2028            | 981.466          | 0,16                         |
| 300.000  | First Quantum Minerals Ltd**  | 6,88 %  | 15.10.2027            | 299.695          | 0,05                         |
| 385.000  | First Quantum Minerals Ltd**  | 8,63 %  | 01.06.2031            | 396.798          | 0,06                         |
| 480.000  | FMG Resources August 2006 Pty Ltd**   | 4,38 %  | 01.04.2031            | 432.498          | 0,07                         |
| 345.000  | FMG Resources August 2006 Pty Ltd**   | 4,50 %  | 15.09.2027            | 334.125          | 0,05                         |
| 615.000  | FMG Resources August 2006 Pty Ltd**   | 5,88 %  | 15.04.2030            | 604.961          | 0,10                         |
| 470.000  | FMG Resources August 2006 Pty Ltd**   | 6,13 %  | 15.04.2032            | 464.679          | 0,08                         |
| 1.205.000  | Focus Financial Partners LLC**  | 6,75 %  | 15.09.2031            | 1.201.538        | 0,20                         |
| 1.715.000  | Fortrea Holdings Inc**  | 7,50 %  | 01.07.2030            | 1.719.989        | 0,28                         |
| 1.230.000  | Fortress Intermediate 3 Inc**   | 7,50 %  | 01.06.2031            | 1.255.733        | 0,21                         |
| 1.745.000  | Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC**                      | 7,00 %  | 01.05.2031            | 1.782.287        | 0,29                         |
| 485.000  | Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC**                      | 7,00 %  | 15.06.2032            | 495.151          | 0,08                         |
| 90.000   | Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC**                      | 7,88 %  | 01.12.2030            | 94.832           | 0,02                         |
| 400.000  | Fortune Star BVI Ltd**  | 5,00 %  | 18.05.2026            | 384.657          | 0,06                         |
| 219.000  | Franshion Brilliant Ltd*  | 4,25 %  | 23.07.2029            | 186.201          | 0,03                         |
| 1.480.000  | Frontier Communications Holdings LLC**  | 5,88 %  | 15.10.2027            | 1.476.448        | 0,24                         |
| 1.765.000  | Frontier Communications Holdings LLC**  | 5,88 %  | 01.11.2029            | 1.756.738        | 0,29                         |
| 360.000  | Frontier Communications Holdings LLC**  | 8,63 %  | 15.03.2031            | 383.193          | 0,06                         |
| 250.000  | FS Luxembourg Sarl*   | 8,88 %  | 12.02.2031            | 253.850          | 0,04                         |

## Global High Yield Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 95,31 % (31. Dezember 2023: 95,40 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 1.315.000  | Gap Inc**  | 3,63 %  | 01.10.2029            | 1.182.124        | 0,19                         |
| 490.000  | Gap Inc**  | 3,88 %  | 01.10.2031            | 424.188          | 0,07                         |
| 425.000  | Garda World Security Corp**                          | 4,63 %  | 15.02.2027            | 413.156          | 0,07                         |
| 405.000  | Garda World Security Corp**                          | 6,00 %  | 01.06.2029            | 384.395          | 0,06                         |
| 235.000  | Garda World Security Corp**                          | 7,75 %  | 15.02.2028            | 242.703          | 0,04                         |
| 755.000  | Garda World Security Corp**                          | 8,25 %  | 01.08.2032            | 768.189          | 0,13                         |
| 255.000  | Garda World Security Corp**                          | 8,38 %  | 15.11.2032            | 259.868          | 0,04                         |
| 1.740.000  | Gates Corp**   | 6,88 %  | 01.07.2029            | 1.772.134        | 0,29                         |
| 485.000  | Gen Digital Inc**                                    | 6,75 %  | 30.09.2027            | 492.730          | 0,08                         |
| 795.000  | Gen Digital Inc**                                    | 7,13 %  | 30.09.2030            | 819.037          | 0,13                         |
| 1.150.000  | Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp*       | 7,75 %  | 01.02.2028            | 1.152.472        | 0,19                         |
| 3.000  | Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp*       | 7,88 %  | 15.05.2032            | 2.941            | 0,00                         |
| 537.000  | Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp*       | 8,00 %  | 15.01.2027            | 546.867          | 0,09                         |
| 560.000  | Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp*       | 8,25 %  | 15.01.2029            | 566.082          | 0,09                         |
| 905.000  | Global Aircraft Leasing Co Ltd**                     | 8,75 %  | 01.09.2027            | 924.133          | 0,15                         |
| 400.000  | Global Infrastructure Solutions Inc**                | 5,63 %  | 01.06.2029            | 386.497          | 0,06                         |
| 680.000  | Global Infrastructure Solutions Inc**                | 7,50 %  | 15.04.2032            | 676.814          | 0,11                         |
| 400.000  | GLP Pte Ltd**  | 4,50 %  | 31.12.2149            | 232.784          | 0,04                         |
| 310.000  | Goodyear Tire & Rubber Co**                          | 5,00 %  | 31.05.2026            | 305.356          | 0,05                         |
| 1.365.000  | Goodyear Tire & Rubber Co**                          | 5,00 %  | 15.07.2029            | 1.254.905        | 0,20                         |
| 1.425.000  | Goodyear Tire & Rubber Co**                          | 5,25 %  | 15.07.2031            | 1.277.820        | 0,21                         |
| 210.000  | Goodyear Tire & Rubber Co**                          | 5,63 %  | 30.04.2033            | 184.655          | 0,03                         |
| 660.000  | Graham Packaging Co Inc**                            | 7,13 %  | 15.08.2028            | 653.649          | 0,11                         |
| 400.000  | Gran Tierra Energy Inc**                             | 9,50 %  | 15.10.2029            | 373.020          | 0,06                         |
| 353.525  | Greenko Dutch BV**                                   | 3,85 %  | 29.03.2026            | 343.896          | 0,06                         |
| 982.795  | Greenko Power II Ltd*                                | 4,30 %  | 13.12.2028            | 926.403          | 0,15                         |
| 430.000  | Greystar Real Estate Partners LLC**                  | 7,75 %  | 01.09.2030            | 454.707          | 0,08                         |
| 910.000  | Group 1 Automotive Inc**                             | 6,38 %  | 15.01.2030            | 914.093          | 0,15                         |
| 200.000  | Grupo Aeromexico SAB de CV**                         | 8,25 %  | 15.11.2029            | 197.476          | 0,03                         |
| 500.000  | Grupo Aval Ltd*                                      | 4,38 %  | 04.02.2030            | 440.793          | 0,07                         |
| 2.280.000  | GYP Holdings III Corp**                              | 4,63 %  | 01.05.2029            | 2.152.449        | 0,35                         |
| 650.000  | HAH Group Holding Co LLC**                           | 9,75 %  | 01.10.2031            | 651.343          | 0,11                         |
| 1.270.000  | Harvest Midstream I LP**                             | 7,50 %  | 01.09.2028            | 1.282.403        | 0,21                         |
| 410.000  | HDFC Bank Ltd**                                      | 3,70 %  | 31.12.2149            | 384.590          | 0,06                         |
| 510.000  | Heartland Dental LLC/Heartland Dental Finance Corp** | 10,50 % | 30.04.2028            | 541.343          | 0,09                         |
| 460.000  | Herc Holdings Inc**                                  | 5,50 %  | 15.07.2027            | 455.930          | 0,07                         |
| 390.000  | Herc Holdings Inc**                                  | 6,63 %  | 15.06.2029            | 395.276          | 0,06                         |
| 205.000  | Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co**             | 5,75 %  | 01.02.2029            | 195.777          | 0,03                         |
| 800.000  | Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co**             | 6,00 %  | 15.04.2030            | 755.840          | 0,12                         |

## Global High Yield Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 95,31 % (31. Dezember 2023: 95,40 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 350.000  | Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co**                                      | 6,00 % | 01.02.2031            | 324.991          | 0,05                         |
| 350.000  | Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co**                                      | 6,25 % | 01.11.2028            | 339.255          | 0,06                         |
| 765.000  | Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co**                                      | 7,25 % | 15.02.2035            | 719.877          | 0,12                         |
| 500.000  | Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co**                                      | 8,38 % | 01.11.2033            | 510.876          | 0,08                         |
| 590.000  | Hillenbrand Inc*  | 3,75 % | 01.03.2031            | 516.189          | 0,09                         |
| 315.000  | Hillenbrand Inc*  | 6,25 % | 15.02.2029            | 315.189          | 0,05                         |
| 1.800.000  | Howard Midstream Energy Partners LLC**  | 7,38 % | 15.07.2032            | 1.830.442        | 0,30                         |
| 195.000  | Howard Midstream Energy Partners LLC**  | 8,88 % | 15.07.2028            | 205.132          | 0,03                         |
| 825.000  | Howden UK Refinance Plc/Howden UK Refinance 2 Plc/Howden US Refinance LLC**   | 7,25 % | 15.02.2031            | 839.301          | 0,14                         |
| 270.000  | Howden UK Refinance Plc/Howden UK Refinance 2 Plc/Howden US Refinance LLC**   | 8,13 % | 15.02.2032            | 276.038          | 0,05                         |
| 485.000  | HUB International Ltd**   | 5,63 % | 01.12.2029            | 470.829          | 0,08                         |
| 2.145.000  | HUB International Ltd**   | 7,25 % | 15.06.2030            | 2.200.384        | 0,36                         |
| 750.000  | HUB International Ltd**   | 7,38 % | 31.01.2032            | 762.208          | 0,12                         |
| 650.000  | Hudbay Minerals Inc**   | 6,13 % | 01.04.2029            | 653.151          | 0,11                         |
| 560.000  | IHO Verwaltungs GmbH**  | 6,38 % | 15.05.2029            | 541.373          | 0,09                         |
| 190.000  | IHO Verwaltungs GmbH**  | 7,75 % | 15.11.2030            | 189.909          | 0,03                         |
| 260.000  | IHO Verwaltungs GmbH**  | 8,00 % | 15.11.2032            | 262.084          | 0,04                         |
| 200.000  | IHS Holding Ltd**   | 6,25 % | 29.11.2028            | 189.488          | 0,03                         |
| 260.000  | IHS Holding Ltd**   | 7,88 % | 29.05.2030            | 256.743          | 0,04                         |
| 450.000  | IHS Holding Ltd 144A**  | 6,25 % | 29.11.2028            | 426.459          | 0,07                         |
| 1.415.000  | Iliad Holding SASU**  | 7,00 % | 15.10.2028            | 1.435.115        | 0,23                         |
| 335.000  | Iliad Holding SASU**  | 7,00 % | 15.04.2032            | 337.113          | 0,06                         |
| 1.627.000  | Illuminate Buyer LLC/Illuminate Holdings IV Inc**                             | 9,00 % | 01.07.2028            | 1.648.959        | 0,27                         |
| 1.100.000  | INEOS Finance Plc*  | 6,75 % | 15.05.2028            | 1.111.900        | 0,18                         |
| 655.000  | INEOS Finance Plc**   | 7,50 % | 15.04.2029            | 671.291          | 0,11                         |
| 1.385.000  | Intelligent Packaging Ltd Finco Inc/Intelligent Packaging Ltd Co-Issuer LLC** | 6,00 % | 15.09.2028            | 1.366.685        | 0,22                         |
| 485.000  | Iron Mountain Inc**   | 4,88 % | 15.09.2029            | 461.306          | 0,07                         |
| 870.000  | Iron Mountain Inc**   | 5,25 % | 15.03.2028            | 851.664          | 0,14                         |
| 420.000  | Iron Mountain Inc**   | 5,63 % | 15.07.2032            | 401.524          | 0,07                         |
| 965.000  | ITT Holdings LLC**  | 6,50 % | 01.08.2029            | 884.358          | 0,15                         |
| 885.000  | Jane Street Group/JSG Finance Inc**   | 6,13 % | 01.11.2032            | 877.390          | 0,14                         |
| 700.000  | Jane Street Group/JSG Finance Inc**   | 7,13 % | 30.04.2031            | 719.948          | 0,12                         |
| 1.090.000  | JELD-WEN Inc**  | 4,88 % | 15.12.2027            | 1.036.852        | 0,17                         |
| 740.000  | JELD-WEN Inc**  | 7,00 % | 01.09.2032            | 687.719          | 0,11                         |
| 459.000  | JSW Steel Ltd**   | 5,05 % | 05.04.2032            | 410.979          | 0,07                         |
| 1.005.000  | Kaiser Aluminum Corp**  | 4,50 % | 01.06.2031            | 887.104          | 0,14                         |
| 940.000  | Kaiser Aluminum Corp**  | 4,63 % | 01.03.2028            | 884.873          | 0,14                         |
| 2.040.000  | KB Home**   | 7,25 % | 15.07.2030            | 2.094.038        | 0,34                         |
| 1.240.000  | Kinetik Holdings LP**   | 5,88 % | 15.06.2030            | 1.221.461        | 0,20                         |

## Global High Yield Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung  | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 95,31 % (31. Dezember 2023: 95,40 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 430.000  | Kinetik Holdings LP**  | 6,63 %  | 15.12.2028            | 440.203          | 0,07                         |
| 775.000  | Knife River Corp**   | 7,75 %  | 01.05.2031            | 808.068          | 0,13                         |
| 450.000  | Kosmos Energy Ltd**  | 7,50 %  | 01.03.2028            | 426.630          | 0,07                         |
| 506.000  | Kosmos Energy Ltd**  | 8,75 %  | 01.10.2031            | 477.204          | 0,08                         |
| 650.000  | Ladder Capital Finance Holdings LLLP/Ladder Capital Finance Corp** | 4,25 %  | 01.02.2027            | 627.259          | 0,10                         |
| 820.000  | Ladder Capital Finance Holdings LLLP/Ladder Capital Finance Corp** | 4,75 %  | 15.06.2029            | 774.017          | 0,13                         |
| 306.000  | Latam Airlines Group SA**  | 7,88 %  | 15.04.2030            | 310.165          | 0,05                         |
| 1.025.000  | LCM Investments Holdings II LLC**                                  | 4,88 %  | 01.05.2029            | 958.465          | 0,16                         |
| 790.000  | LCM Investments Holdings II LLC**                                  | 8,25 %  | 01.08.2031            | 820.411          | 0,13                         |
| 400.000  | LD Celulose International GmbH**                                   | 7,95 %  | 26.01.2032            | 401.406          | 0,06                         |
| 495.000  | Leeward Renewable Energy Operations LLC**                          | 4,25 %  | 01.07.2029            | 453.633          | 0,07                         |
| 315.000  | Level 3 Financing Inc**  | 3,75 %  | 15.07.2029            | 249.637          | 0,04                         |
| 675.000  | Level 3 Financing Inc**  | 4,50 %  | 01.04.2030            | 563.054          | 0,09                         |
| 630.000  | Level 3 Financing Inc**  | 4,88 %  | 15.06.2029            | 551.250          | 0,09                         |
| 830.000  | Level 3 Financing Inc**  | 10,50 % | 15.05.2030            | 908.020          | 0,15                         |
| 675.000  | Level 3 Financing Inc**  | 10,75 % | 15.12.2030            | 756.440          | 0,12                         |
| 775.222  | Level 3 Financing Inc**  | 11,00 % | 15.11.2029            | 873.031          | 0,14                         |
| 156.075  | Leviathan Bond Ltd*  | 6,75 %  | 30.06.2030            | 148.040          | 0,02                         |
| 150.000  | LGI Homes Inc**  | 4,00 %  | 15.07.2029            | 135.082          | 0,02                         |
| 1.320.000  | LGI Homes Inc**  | 7,00 %  | 15.11.2032            | 1.308.503        | 0,21                         |
| 885.000  | LifePoint Health Inc**   | 4,38 %  | 15.02.2027            | 848.911          | 0,14                         |
| 115.000  | LifePoint Health Inc**   | 5,38 %  | 15.01.2029            | 100.950          | 0,02                         |
| 1.230.000  | LifePoint Health Inc**   | 9,88 %  | 15.08.2030            | 1.328.655        | 0,22                         |
| 885.000  | LifePoint Health Inc**   | 10,00 % | 01.06.2032            | 900.927          | 0,15                         |
| 2.285.000  | Lightning Power LLC**  | 7,25 %  | 15.08.2032            | 2.356.105        | 0,38                         |
| 500.000  | Limak Cimento Sanayi ve Ticaret AS**                               | 9,75 %  | 25.07.2029            | 492.983          | 0,08                         |
| 235.000  | Lindblad Expeditions Holdings Inc**                                | 9,00 %  | 15.05.2028            | 246.123          | 0,04                         |
| 895.000  | Lindblad Expeditions LLC**   | 6,75 %  | 15.02.2027            | 900.165          | 0,15                         |
| 400.000  | Longfor Group Holdings Ltd**                                       | 3,95 %  | 16.09.2029            | 300.843          | 0,05                         |
| 831.646  | Lumen Technologies Inc**   | 4,13 %  | 15.04.2029            | 754.446          | 0,12                         |
| 560.000  | Lumen Technologies Inc**   | 4,50 %  | 15.01.2029            | 477.084          | 0,08                         |
| 365.000  | Macy's Retail Holdings LLC*  | 4,50 %  | 15.12.2034            | 304.433          | 0,05                         |
| 60.000   | Macy's Retail Holdings LLC*  | 5,13 %  | 15.01.2042            | 45.080           | 0,01                         |
| 170.000  | Macy's Retail Holdings LLC**                                       | 5,88 %  | 01.04.2029            | 166.721          | 0,03                         |
| 115.000  | Macy's Retail Holdings LLC**                                       | 5,88 %  | 15.03.2030            | 110.479          | 0,02                         |
| 25.000   | Macy's Retail Holdings LLC**                                       | 6,13 %  | 15.03.2032            | 23.501           | 0,00                         |
| 400.000  | Madison IAQ LLC**  | 4,13 %  | 30.06.2028            | 378.987          | 0,06                         |
| 1.940.000  | Madison IAQ LLC**  | 5,88 %  | 30.06.2029            | 1.833.949        | 0,30                         |
| 530.000  | Magnera Corp**   | 7,25 %  | 15.11.2031            | 518.067          | 0,08                         |

## Global High Yield Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 95,31 % (31. Dezember 2023: 95,40 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 1.350.000  | Manitowoc Co Inc**  | 9,25 %  | 01.10.2031            | 1.385.469        | 0,23                         |
| 325.000  | MARB BondCo Plc*  | 3,95 %  | 29.01.2031            | 272.487          | 0,04                         |
| 1.740.000  | Masterbrand Inc**   | 7,00 %  | 15.07.2032            | 1.754.166        | 0,29                         |
| 468.000  | Mattamy Group Corp**  | 5,25 %  | 15.12.2027            | 457.965          | 0,07                         |
| 1.815.000  | Mauser Packaging Solutions Holding Co**                           | 9,25 %  | 15.04.2027            | 1.844.341        | 0,30                         |
| 1.612.972  | MC Brazil Downstream Trading Sarl**                               | 7,25 %  | 30.06.2031            | 1.341.739        | 0,22                         |
| 990.000  | McAfee Corp**   | 7,38 %  | 15.02.2030            | 962.766          | 0,16                         |
| 870.000  | McGraw-Hill Education Inc**                                       | 5,75 %  | 01.08.2028            | 850.410          | 0,14                         |
| 755.000  | McGraw-Hill Education Inc**                                       | 7,38 %  | 01.09.2031            | 773.636          | 0,13                         |
| 50.000   | McGraw-Hill Education Inc**                                       | 8,00 %  | 01.08.2029            | 50.063           | 0,01                         |
| 1.310.000  | McGraw-Hill Education Inc 144A**                                  | 8,00 %  | 01.08.2029            | 1.311.639        | 0,21                         |
| 651.000  | Medco Bell Pte Ltd**  | 6,38 %  | 30.01.2027            | 651.158          | 0,10                         |
| 4.005.000  | Medline Borrower LP**   | 5,25 %  | 01.10.2029            | 3.868.886        | 0,63                         |
| 160.000  | Mercer International Inc**  | 12,88 % | 01.10.2028            | 172.433          | 0,03                         |
| 150.000  | Merlin Entertainments Ltd**                                       | 5,75 %  | 15.06.2026            | 148.875          | 0,02                         |
| 359.000  | Mersin Uluslararası Liman İşletmeciliği AS*                       | 8,25 %  | 15.11.2028            | 372.300          | 0,06                         |
| 1.110.000  | Midcontinent Communications**                                     | 8,00 %  | 15.08.2032            | 1.141.500        | 0,19                         |
| 279.900  | Millicom International Cellular SA*                               | 6,25 %  | 25.03.2029            | 275.601          | 0,04                         |
| 1.484.000  | Minerva Luxembourg SA*  | 4,38 %  | 18.03.2031            | 1.246.440        | 0,20                         |
| 400.000  | Minsur SA**   | 4,50 %  | 28.10.2031            | 355.188          | 0,06                         |
| 258.000  | Movida Europe SA**  | 7,85 %  | 11.04.2029            | 227.639          | 0,04                         |
| 540.000  | Nationstar Mortgage Holdings Inc**                                | 5,13 %  | 15.12.2030            | 504.361          | 0,08                         |
| 630.000  | Nationstar Mortgage Holdings Inc**                                | 5,50 %  | 15.08.2028            | 612.241          | 0,10                         |
| 1.395.000  | Nationstar Mortgage Holdings Inc**                                | 5,75 %  | 15.11.2031            | 1.334.837        | 0,22                         |
| 210.000  | Nationstar Mortgage Holdings Inc**                                | 6,00 %  | 15.01.2027            | 209.058          | 0,04                         |
| 325.000  | Nationstar Mortgage Holdings Inc**                                | 6,50 %  | 01.08.2029            | 324.786          | 0,05                         |
| 105.000  | Nationstar Mortgage Holdings Inc**                                | 7,13 %  | 01.02.2032            | 106.459          | 0,02                         |
| 700.000  | Navient Corp**  | 5,00 %  | 15.03.2027            | 686.618          | 0,11                         |
| 1.285.000  | Navient Corp**  | 5,50 %  | 15.03.2029            | 1.214.408        | 0,20                         |
| 435.000  | Navoi Mining & Metallurgical Combinat*                            | 6,95 %  | 17.10.2031            | 430.084          | 0,07                         |
| 1.310.000  | NCL Corp Ltd**  | 5,88 %  | 15.02.2027            | 1.306.859        | 0,21                         |
| 655.000  | NCL Corp Ltd**  | 8,13 %  | 15.01.2029            | 690.661          | 0,11                         |
| 365.000  | NCL Finance Ltd**   | 6,13 %  | 15.03.2028            | 366.445          | 0,06                         |
| 885.000  | Necessity Retail REIT Inc/American Finance Operating Partner LP** | 4,50 %  | 30.09.2028            | 813.840          | 0,13                         |
| 420.000  | Neptune Bidco US Inc**  | 9,29 %  | 15.04.2029            | 391.116          | 0,06                         |
| 210.000  | Network i2i Ltd*  | 3,98 %  | 31.12.2149            | 205.341          | 0,03                         |
| 465.000  | New Fortress Energy Inc**   | 6,50 %  | 30.09.2026            | 447.914          | 0,07                         |
| 426.000  | NewCo Holding USD 20 Sarl**                                       | 9,38 %  | 07.11.2029            | 424.722          | 0,07                         |
| 386.000  | Newell Brands Inc**   | 5,70 %  | 01.04.2026            | 386.169          | 0,06                         |

## Global High Yield Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung  | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 95,31 % (31. Dezember 2023: 95,40 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |        |                       |                  |                              |
| 310.000  | Newell Brands Inc**  | 6,38 % | 15.05.2030            | 311.286          | 0,05                         |
| 215.000  | Newell Brands Inc**  | 6,63 % | 15.09.2029            | 219.039          | 0,04                         |
| 210.000  | Newell Brands Inc**  | 6,63 % | 15.05.2032            | 211.698          | 0,03                         |
| 650.000  | Newell Brands Inc**  | 7,00 % | 01.04.2046            | 621.288          | 0,10                         |
| 1.175.000  | NextEra Energy Operating Partners LP**   | 4,50 % | 15.09.2027            | 1.125.947        | 0,18                         |
| 1.520.000  | NGL Energy Operating LLC/NGL Energy Finance Corp**                             | 8,13 % | 15.02.2029            | 1.541.448        | 0,25                         |
| 725.000  | Noble Finance II LLC**   | 8,00 % | 15.04.2030            | 732.961          | 0,12                         |
| 840.000  | Northriver Midstream Finance LP**  | 6,75 % | 15.07.2032            | 845.780          | 0,14                         |
| 1.300.000  | NOVA Chemicals Corp**  | 5,25 % | 01.06.2027            | 1.264.574        | 0,20                         |
| 215.000  | NOVA Chemicals Corp**  | 8,50 % | 15.11.2028            | 228.010          | 0,04                         |
| 840.000  | Novelis Corp**   | 4,75 % | 30.01.2030            | 776.266          | 0,13                         |
| 1.240.000  | NRG Energy Inc**   | 5,75 % | 15.07.2029            | 1.211.628        | 0,20                         |
| 1.360.000  | Olympus Water US Holding Corp**  | 6,25 % | 01.10.2029            | 1.300.613        | 0,21                         |
| 1.210.000  | Olympus Water US Holding Corp**  | 7,13 % | 01.10.2027            | 1.232.656        | 0,20                         |
| 255.000  | Olympus Water US Holding Corp**  | 7,25 % | 15.06.2031            | 260.122          | 0,04                         |
| 925.000  | Olympus Water US Holding Corp**  | 9,75 % | 15.11.2028            | 982.596          | 0,16                         |
| 260.000  | OneMain Finance Corp*  | 3,50 % | 15.01.2027            | 248.218          | 0,04                         |
| 390.000  | OneMain Finance Corp*  | 5,38 % | 15.11.2029            | 375.268          | 0,06                         |
| 1.565.000  | OneMain Finance Corp*  | 6,63 % | 15.01.2028            | 1.585.595        | 0,26                         |
| 475.000  | OneMain Finance Corp*  | 6,63 % | 15.05.2029            | 481.508          | 0,08                         |
| 755.000  | OneMain Finance Corp*  | 7,13 % | 15.11.2031            | 770.049          | 0,12                         |
| 1.025.000  | Open Text Holdings Inc**   | 4,13 % | 15.02.2030            | 930.475          | 0,15                         |
| 960.000  | Open Text Holdings Inc**   | 4,13 % | 01.12.2031            | 852.158          | 0,14                         |
| 920.000  | Optics Bidco SpA**   | 6,00 % | 30.09.2034            | 887.836          | 0,14                         |
| 265.000  | Optics Bidco SpA**   | 7,20 % | 18.07.2036            | 271.816          | 0,04                         |
| 1.093.000  | Oztel Holdings SPC Ltd*  | 6,63 % | 24.04.2028            | 1.128.736        | 0,19                         |
| 660.000  | Panther Escrow Issuer LLC**  | 7,13 % | 01.06.2031            | 667.316          | 0,11                         |
| 1.815.000  | Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/PK Finance Co-Issuer** | 5,88 % | 01.10.2028            | 1.775.099        | 0,29                         |
| 570.000  | Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/PK Finance Co-Issuer** | 7,00 % | 01.02.2030            | 578.925          | 0,10                         |
| 955.000  | Pebblebrook Hotel LP/PEB Finance Corp**  | 6,38 % | 15.10.2029            | 946.218          | 0,15                         |
| 317.000  | Pegasus Hava Tasimaciligi AS*  | 8,00 % | 11.09.2031            | 315.000          | 0,05                         |
| 960.000  | PennyMac Financial Services Inc**  | 5,75 % | 15.09.2031            | 915.360          | 0,15                         |
| 1.000.000  | PennyMac Financial Services Inc**  | 7,13 % | 15.11.2030            | 1.013.668        | 0,16                         |
| 1.085.000  | Performance Food Group Inc**   | 4,25 % | 01.08.2029            | 1.007.914        | 0,16                         |
| 290.000  | Performance Food Group Inc**   | 5,50 % | 15.10.2027            | 287.849          | 0,05                         |
| 445.000  | Performance Food Group Inc**   | 6,13 % | 15.09.2032            | 445.536          | 0,07                         |
| 40.000   | Permian Resources Operating LLC**  | 5,88 % | 01.07.2029            | 39.277           | 0,01                         |
| 340.000  | Permian Resources Operating LLC**  | 6,25 % | 01.02.2033            | 335.889          | 0,05                         |
| 1.625.000  | Permian Resources Operating LLC**  | 7,00 % | 15.01.2032            | 1.651.146        | 0,27                         |

## Global High Yield Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                    | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 95,31 % (31. Dezember 2023: 95,40 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |        |                       |                  |                              |
| 2.065.000  | Perrigo Finance Unlimited Co*                            | 6,13 % | 30.09.2032            | 2.021.822        | 0,33                         |
| 1.074.000  | Petrobras Global Finance BV*                             | 6,50 % | 03.07.2033            | 1.052.139        | 0,17                         |
| 645.000  | Post Holdings Inc**                                      | 6,25 % | 15.10.2034            | 629.933          | 0,11                         |
| 1.325.000  | Post Holdings Inc**                                      | 6,38 % | 01.03.2033            | 1.300.305        | 0,21                         |
| 1.105.000  | Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc** | 5,75 % | 15.04.2026            | 1.105.375        | 0,18                         |
| 2.065.000  | Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc** | 6,25 % | 15.01.2028            | 2.056.056        | 0,33                         |
| 960.000  | Provident Funding Associates LP/PFG Finance Corp**       | 9,75 % | 15.09.2029            | 987.327          | 0,16                         |
| 330.000  | QNB Bank AS**  | 7,25 % | 21.05.2029            | 344.032          | 0,06                         |
| 1.111.100  | Rackspace Finance LLC**                                  | 3,50 % | 15.05.2028            | 670.827          | 0,11                         |
| 985.000  | Raven Acquisition Holdings LLC**                         | 6,88 % | 15.11.2031            | 977.581          | 0,16                         |
| 1.420.000  | Resideo Funding Inc**                                    | 4,00 % | 01.09.2029            | 1.287.514        | 0,21                         |
| 1.120.000  | Resideo Funding Inc**                                    | 6,50 % | 15.07.2032            | 1.122.797        | 0,18                         |
| 865.000  | RHP Hotel Properties LP/RHP Finance Corp**               | 4,50 % | 15.02.2029            | 818.253          | 0,13                         |
| 355.000  | RHP Hotel Properties LP/RHP Finance Corp**               | 4,75 % | 15.10.2027            | 343.698          | 0,06                         |
| 1.575.000  | RHP Hotel Properties LP/RHP Finance Corp**               | 7,25 % | 15.07.2028            | 1.625.145        | 0,26                         |
| 945.000  | Ritchie Bros Holdings Inc**                              | 6,75 % | 15.03.2028            | 967.340          | 0,16                         |
| 1.200.000  | Ritchie Bros Holdings Inc**                              | 7,75 % | 15.03.2031            | 1.256.389        | 0,20                         |
| 600.000  | RLJ Lodging Trust LP**                                   | 3,75 % | 01.07.2026            | 583.999          | 0,10                         |
| 635.000  | RLJ Lodging Trust LP**                                   | 4,00 % | 15.09.2029            | 575.954          | 0,09                         |
| 820.000  | RLJ Lodging Trust LP 144A**                              | 4,00 % | 15.09.2029            | 743.752          | 0,12                         |
| 460.000  | Rockies Express Pipeline LLC**                           | 4,80 % | 15.05.2030            | 433.008          | 0,07                         |
| 630.000  | Rockies Express Pipeline LLC**                           | 6,88 % | 15.04.2040            | 599.486          | 0,10                         |
| 350.000  | Rockies Express Pipeline LLC**                           | 7,50 % | 15.07.2038            | 349.878          | 0,06                         |
| 985.000  | Royal Caribbean Cruises Ltd**                            | 5,63 % | 30.09.2031            | 969.545          | 0,16                         |
| 725.000  | Royal Caribbean Cruises Ltd**                            | 6,00 % | 01.02.2033            | 723.800          | 0,12                         |
| 605.000  | Royal Caribbean Cruises Ltd**                            | 6,25 % | 15.03.2032            | 612.714          | 0,10                         |
| 486.000  | Sable International Finance Ltd**                        | 7,13 % | 15.10.2032            | 476.999          | 0,08                         |
| 932.856  | Samarco Mineracao SA**                                   | 9,00 % | 30.06.2031            | 912.958          | 0,15                         |
| 683.000  | Sasol Financing USA LLC*                                 | 6,50 % | 27.09.2028            | 658.472          | 0,11                         |
| 700.000  | SCIH Salt Holdings Inc**                                 | 4,88 % | 01.05.2028            | 659.283          | 0,11                         |
| 480.000  | SCIH Salt Holdings Inc**                                 | 6,63 % | 01.05.2029            | 456.245          | 0,07                         |
| 2.345.000  | SCIL IV LLC/SCIL USA Holdings LLC**                      | 5,38 % | 01.11.2026            | 2.299.361        | 0,37                         |
| 1.970.000  | SeaWorld Parks & Entertainment Inc**                     | 5,25 % | 15.08.2029            | 1.881.617        | 0,31                         |
| 1.030.000  | Select Medical Corp**                                    | 6,25 % | 01.12.2032            | 992.772          | 0,16                         |
| 955.000  | Sensata Technologies BV**                                | 4,00 % | 15.04.2029            | 877.227          | 0,14                         |
| 595.000  | Sensata Technologies Inc**                               | 6,63 % | 15.07.2032            | 597.080          | 0,10                         |
| 1.289.000  | SEPLAT Energy Plc*                                       | 7,75 % | 01.04.2026            | 1.286.231        | 0,21                         |
| 275.000  | Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp**                  | 4,75 % | 15.02.2028            | 263.692          | 0,04                         |
| 635.000  | Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp**                  | 4,75 % | 01.04.2029            | 601.781          | 0,10                         |

## Global High Yield Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung  | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 95,31 % (31. Dezember 2023: 95,40 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 1.330.000  | Shift4 Payments LLC/Shift4 Payments Finance Sub Inc**        | 6,75 %  | 15.08.2032            | 1.353.790        | 0,22                         |
| 651.000  | SierraCol Energy Andina LLC**                                | 6,00 %  | 15.06.2028            | 588.544          | 0,10                         |
| 400.000  | Sirius XM Radio LLC**  | 3,88 %  | 01.09.2031            | 335.212          | 0,05                         |
| 450.000  | Sirius XM Radio LLC**  | 4,00 %  | 15.07.2028            | 415.106          | 0,07                         |
| 1.785.000  | Sirius XM Radio LLC**  | 5,50 %  | 01.07.2029            | 1.713.500        | 0,28                         |
| 214.000  | Sisecam UK Plc**   | 8,63 %  | 02.05.2032            | 212.926          | 0,03                         |
| 905.000  | Six Flags Entertainment Corp**                               | 7,25 %  | 15.05.2031            | 925.275          | 0,15                         |
| 280.000  | Six Flags Entertainment Corp/Six Flags Theme Parks Inc**     | 6,63 %  | 01.05.2032            | 284.011          | 0,05                         |
| 565.000  | SNF Group SACA**   | 3,13 %  | 15.03.2027            | 534.529          | 0,09                         |
| 745.000  | SNF Group SACA**   | 3,38 %  | 15.03.2030            | 653.583          | 0,11                         |
| 1.525.000  | SPX FLOW Inc**   | 8,75 %  | 01.04.2030            | 1.564.437        | 0,26                         |
| 580.000  | Standard Building Solutions Inc**                            | 6,50 %  | 15.08.2032            | 581.428          | 0,10                         |
| 920.000  | Standard Industries Inc**                                    | 3,38 %  | 15.01.2031            | 789.571          | 0,13                         |
| 205.000  | Standard Industries Inc**                                    | 4,38 %  | 15.07.2030            | 187.983          | 0,03                         |
| 1.600.000  | Star Holding LLC**   | 8,75 %  | 01.08.2031            | 1.587.312        | 0,26                         |
| 985.000  | Starwood Property Trust Inc**                                | 6,50 %  | 01.07.2030            | 986.891          | 0,16                         |
| 310.000  | Starwood Property Trust Inc**                                | 7,25 %  | 01.04.2029            | 318.386          | 0,05                         |
| 400.000  | Stillwater Mining Co*  | 4,00 %  | 16.11.2026            | 380.158          | 0,06                         |
| 2.185.000  | Sunrise FinCo I BV**   | 4,88 %  | 15.07.2031            | 1.984.570        | 0,32                         |
| 1.325.000  | Surgery Center Holdings Inc**                                | 7,25 %  | 15.04.2032            | 1.353.281        | 0,22                         |
| 595.000  | Talen Energy Supply LLC**                                    | 8,63 %  | 01.06.2030            | 634.532          | 0,10                         |
| 2.050.000  | Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp** | 6,00 %  | 31.12.2030            | 1.942.988        | 0,32                         |
| 305.000  | Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp** | 7,38 %  | 15.02.2029            | 306.260          | 0,05                         |
| 795.000  | Taylor Morrison Communities Inc**                            | 5,13 %  | 01.08.2030            | 762.382          | 0,13                         |
| 910.000  | Taylor Morrison Communities Inc**                            | 6,63 %  | 15.07.2027            | 907.716          | 0,15                         |
| 713.935  | Team Health Holdings Inc**                                   | 13,50 % | 30.06.2028            | 789.791          | 0,13                         |
| 257.000  | Telecom Argentina SA**                                       | 9,50 %  | 18.07.2031            | 264.453          | 0,04                         |
| 200.000  | Telecommunications co Telekom Srbija AD Belgrade**           | 7,00 %  | 28.10.2029            | 199.798          | 0,03                         |
| 400.000  | Telecomunicaciones Digitales SA**                            | 4,50 %  | 30.01.2030            | 363.934          | 0,06                         |
| 435.000  | Tenet Healthcare Corp**                                      | 6,13 %  | 15.06.2030            | 432.115          | 0,07                         |
| 2.420.000  | Tenet Healthcare Corp**                                      | 6,75 %  | 15.05.2031            | 2.446.671        | 0,40                         |
| 1.250.000  | Terex Corp**   | 6,25 %  | 15.10.2032            | 1.226.782        | 0,20                         |
| 272.000  | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV*              | 4,10 %  | 01.10.2046            | 195.907          | 0,03                         |
| 442.000  | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV*              | 5,13 %  | 09.05.2029            | 432.033          | 0,07                         |
| 324.000  | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV**             | 8,13 %  | 15.09.2031            | 362.527          | 0,06                         |
| 1.845.000  | TK Elevator Holdco GmbH**                                    | 7,63 %  | 15.07.2028            | 1.847.360        | 0,30                         |
| 1.040.000  | TK Elevator US Newco Inc**                                   | 5,25 %  | 15.07.2027            | 1.018.925        | 0,17                         |
| 1.395.000  | TMS International Corp**                                     | 6,25 %  | 15.04.2029            | 1.346.129        | 0,22                         |
| 470.000  | TransDigm Inc*   | 4,63 %  | 15.01.2029            | 440.509          | 0,07                         |

## Global High Yield Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 95,31 % (31. Dezember 2023: 95,40 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 90.000   | TransDigm Inc**   | 6,00 %  | 15.01.2033            | 88.277           | 0,01                         |
| 780.000  | TransDigm Inc**   | 6,38 %  | 01.03.2029            | 782.708          | 0,13                         |
| 795.000  | TransDigm Inc**   | 6,63 %  | 01.03.2032            | 803.169          | 0,13                         |
| 2.255.000  | TransDigm Inc**   | 6,75 %  | 15.08.2028            | 2.277.491        | 0,37                         |
| 1.295.000  | TransDigm Inc**   | 6,88 %  | 15.12.2030            | 1.315.182        | 0,21                         |
| 211.000  | Transportadora de Gas del Sur SA**                            | 8,50 %  | 24.07.2031            | 220.428          | 0,03                         |
| 1.130.000  | TreeHouse Foods Inc*  | 4,00 %  | 01.09.2028            | 1.027.585        | 0,17                         |
| 40.000   | Tri Pointe Homes Inc*   | 5,25 %  | 01.06.2027            | 39.356           | 0,01                         |
| 1.085.000  | Tri Pointe Homes Inc*   | 5,70 %  | 15.06.2028            | 1.078.880        | 0,18                         |
| 666.000  | Trident Energy Finance Plc**                                  | 12,50 % | 30.11.2029            | 699.904          | 0,11                         |
| 1.025.000  | Trident TPI Holdings Inc**                                    | 12,75 % | 31.12.2028            | 1.131.950        | 0,18                         |
| 1.015.000  | Trivium Packaging Finance BV*                                 | 5,50 %  | 15.08.2026            | 1.004.337        | 0,16                         |
| 410.000  | TTM Technologies Inc**  | 4,00 %  | 01.03.2029            | 380.839          | 0,06                         |
| 300.000  | Turk Telekomunikasyon AS**                                    | 7,38 %  | 20.05.2029            | 305.909          | 0,05                         |
| 400.000  | Turkcell Iletisim Hizmetleri AS*                              | 5,80 %  | 11.04.2028            | 388.174          | 0,06                         |
| 469.000  | Turkiye Garanti Bankasi AS*                                   | 8,38 %  | 28.02.2034            | 478.782          | 0,08                         |
| 323.000  | Turkiye Vakiflar Bankasi TAO**                                | 10,12 % | 31.12.2149            | 338.132          | 0,05                         |
| 2.255.000  | UKG Inc**   | 6,88 %  | 01.02.2031            | 2.290.195        | 0,37                         |
| 1.510.000  | United Airlines Inc**   | 4,38 %  | 15.04.2026            | 1.485.884        | 0,24                         |
| 1.510.000  | United Airlines Inc**   | 4,63 %  | 15.04.2029            | 1.436.910        | 0,23                         |
| 1.035.000  | United Rentals North America Inc**                            | 6,13 %  | 15.03.2034            | 1.028.199        | 0,17                         |
| 885.000  | Uniti Group LP/Uniti Group Finance 2019 Inc/CSL Capital LLC** | 4,75 %  | 15.04.2028            | 830.393          | 0,14                         |
| 685.000  | Uniti Group LP/Uniti Group Finance 2019 Inc/CSL Capital LLC** | 6,50 %  | 15.02.2029            | 622.294          | 0,10                         |
| 1.630.000  | Uniti Group LP/Uniti Group Finance 2019 Inc/CSL Capital LLC** | 10,50 % | 15.02.2028            | 1.739.724        | 0,28                         |
| 1.380.000  | US Acute Care Solutions LLC**                                 | 9,75 %  | 15.05.2029            | 1.408.096        | 0,23                         |
| 835.000  | US Foods Inc**  | 4,75 %  | 15.02.2029            | 800.502          | 0,13                         |
| 600.000  | US Foods Inc**  | 6,88 %  | 15.09.2028            | 614.685          | 0,10                         |
| 825.000  | US Foods Inc**  | 7,25 %  | 15.01.2032            | 854.836          | 0,14                         |
| 210.000  | USI Inc**   | 7,50 %  | 15.01.2032            | 217.446          | 0,03                         |
| 755.000  | UWM Holdings LLC**  | 6,63 %  | 01.02.2030            | 751.057          | 0,12                         |
| 200.000  | Vanke Real Estate Hong Kong Co Ltd*                           | 3,98 %  | 09.11.2027            | 100.765          | 0,02                         |
| 1.176.000  | Vedanta Resources Finance II Plc**                            | 10,88 % | 17.09.2029            | 1.217.912        | 0,20                         |
| 930.000  | Venture Global LNG Inc**                                      | 7,00 %  | 15.01.2030            | 944.828          | 0,15                         |
| 910.000  | Venture Global LNG Inc**                                      | 8,13 %  | 01.06.2028            | 947.358          | 0,15                         |
| 520.000  | Venture Global LNG Inc**                                      | 8,38 %  | 01.06.2031            | 542.860          | 0,09                         |
| 750.000  | Venture Global LNG Inc**                                      | 9,50 %  | 01.02.2029            | 829.418          | 0,14                         |
| 260.000  | Venture Global LNG Inc**                                      | 9,88 %  | 01.02.2032            | 285.455          | 0,05                         |
| 2.025.000  | Veritiv Operating Co**  | 10,50 % | 30.11.2030            | 2.183.416        | 0,36                         |
| 1.555.000  | VF Corp*  | 2,95 %  | 23.04.2030            | 1.329.361        | 0,22                         |

## Global High Yield Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                     | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 95,31 % (31. Dezember 2023: 95,40 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 1.385.000  | Vibrantz Technologies Inc**                               | 9,00 % | 15.02.2030            | 1.273.211        | 0,21                         |
| 780.000  | Viking Cruises Ltd**                                      | 5,88 % | 15.09.2027            | 776.693          | 0,13                         |
| 545.000  | Viking Cruises Ltd**                                      | 7,00 % | 15.02.2029            | 548.541          | 0,09                         |
| 525.000  | Viking Cruises Ltd**                                      | 9,13 % | 15.07.2031            | 565.086          | 0,09                         |
| 475.000  | Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd**                       | 5,63 % | 15.02.2029            | 467.836          | 0,08                         |
| 835.000  | Virgin Media Secured Finance Plc*                         | 5,50 % | 15.05.2029            | 784.128          | 0,13                         |
| 389.000  | Vista Energy Argentina SAU**                              | 7,63 % | 10.12.2035            | 386.958          | 0,06                         |
| 675.000  | VistaJet Malta Finance Plc/Vista Management Holding Inc** | 6,38 % | 01.02.2030            | 590.516          | 0,10                         |
| 1.255.000  | Vistra Operations Co LLC**                                | 6,88 % | 15.04.2032            | 1.286.208        | 0,21                         |
| 2.255.000  | Vistra Operations Co LLC**                                | 7,75 % | 15.10.2031            | 2.367.740        | 0,39                         |
| 2.275.000  | VM Consolidated Inc**                                     | 5,50 % | 15.04.2029            | 2.215.854        | 0,36                         |
| 535.000  | Vmed O2 UK Financing I Plc**                              | 4,75 % | 15.07.2031            | 460.672          | 0,08                         |
| 250.000  | VTR Comunicaciones SpA**                                  | 5,13 % | 15.01.2028            | 233.835          | 0,04                         |
| 715.000  | VTR Finance NV**  | 6,38 % | 15.07.2028            | 679.866          | 0,11                         |
| 985.000  | Walgreens Boots Alliance Inc**                            | 8,13 % | 15.08.2029            | 976.200          | 0,16                         |
| 1.065.000  | Wand NewCo 3 Inc**  | 7,63 % | 30.01.2032            | 1.094.974        | 0,18                         |
| 346.000  | WE Soda Investments Holding Plc**                         | 9,50 % | 06.10.2028            | 356.207          | 0,06                         |
| 1.125.000  | WESCO Distribution Inc**                                  | 6,38 % | 15.03.2029            | 1.141.442        | 0,19                         |
| 575.000  | WESCO Distribution Inc**                                  | 6,63 % | 15.03.2032            | 585.134          | 0,10                         |
| 1.385.000  | White Cap Buyer LLC**                                     | 6,88 % | 15.10.2028            | 1.376.709        | 0,22                         |
| 485.000  | Williams Scotsman Inc**                                   | 6,63 % | 15.06.2029            | 491.221          | 0,08                         |
| 1.160.000  | Williams Scotsman Inc**                                   | 7,38 % | 01.10.2031            | 1.194.324        | 0,20                         |
| 1.875.000  | Windsor Holdings III LLC**                                | 8,50 % | 15.06.2030            | 1.975.239        | 0,32                         |
| 915.000  | Windstream Services LLC/Windstream Escrow Finance Corp**  | 8,25 % | 01.10.2031            | 946.103          | 0,15                         |
| 455.000  | WR Grace Holdings LLC**                                   | 4,88 % | 15.06.2027            | 441.490          | 0,07                         |
| 895.000  | WR Grace Holdings LLC**                                   | 5,63 % | 15.08.2029            | 824.146          | 0,13                         |
| 1.480.000  | WR Grace Holdings LLC**                                   | 7,38 % | 01.03.2031            | 1.518.277        | 0,25                         |
| 875.000  | XHR LP**  | 4,88 % | 01.06.2029            | 826.190          | 0,14                         |
| 303.000  | XP Inc**  | 6,75 % | 02.07.2029            | 301.488          | 0,05                         |
| 395.000  | XPO Inc**   | 7,13 % | 01.06.2031            | 406.622          | 0,07                         |
| 2.005.000  | XPO Inc**   | 7,13 % | 01.02.2032            | 2.055.767        | 0,33                         |
| 317.000  | Yapi ve Kredi Bankasi AS**                                | 9,25 % | 16.10.2028            | 342.276          | 0,05                         |
| 450.000  | Yapi ve Kredi Bankasi AS**                                | 9,25 % | 17.01.2034            | 469.236          | 0,08                         |
| 460.000  | Yapi ve Kredi Bankasi AS**                                | 9,74 % | 31.12.2149            | 474.754          | 0,08                         |
| 440.000  | Yinson Boronia Production BV*                             | 8,95 % | 31.07.2042            | 459.563          | 0,08                         |
| 109.000  | YPF Energia Electrica SA**                                | 7,88 % | 16.10.2032            | 107.908          | 0,02                         |
| 259.000  | YPF SA**  | 7,00 % | 15.12.2047            | 229.325          | 0,04                         |
| 259.000  | YPF SA*   | 8,50 % | 27.06.2029            | 265.933          | 0,05                         |
| 637.000  | YPF SA**  | 9,50 % | 17.01.2031            | 681.914          | 0,11                         |

## Global High Yield Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 95,31 % (31. Dezember 2023: 95,40 %) (Fortsetzung)</b>             |   |         |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                    |                              |
| 2.285.000  | Zayo Group Holdings Inc**   | 4,00 %  | 01.03.2027            | 2.109.727          | 0,35                         |
| 1.170.000  | Zebra Technologies Corp**   | 6,50 %  | 01.06.2032            | 1.187.920          | 0,19                         |
| 800.000  | Ziggo BV*   | 4,88 %  | 15.01.2030            | 736.511            | 0,12                         |
| 300.000  | Zorlu Enerji Elektrik Uretim AS <sup>†</sup>                                  | 11,00 % | 23.04.2030            | 302.665            | 0,05                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |   |         |                       | <b>446.467.416</b> | <b>72,76</b>                 |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>  |   |         |                       | <b>584.788.441</b> | <b>95,31</b>                 |
| <b>Mittelfristige Schuldverschreibungen<sup>^</sup> 1,11 % (31. Dezember 2023: 0,00 %)</b> |   |         |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |   |         |                       |                    |                              |
| 559.223  | Aveanna Healthcare LLC  | 8,36 %  | 17.07.2028            | 555.485            | 0,09                         |
| 480.000  | Aveanna Healthcare LLC  | 11,66 % | 10.12.2029            | 464.400            | 0,08                         |
| 643.383  | Champions Holdco Inc  | 9,27 %  | 23.02.2029            | 611.015            | 0,10                         |
| 530.000  | Cornerstone Generation LLC  | 0,00 %  | 28.10.2031            | 535.300            | 0,09                         |
| 146.552  | Covia Holdings LLC  | 0,00 %  | 31.07.2026            | 146.442            | 0,02                         |
| 518.673  | Galaxy US Opco Inc  | 9,34 %  | 29.04.2029            | 463.564            | 0,07                         |
| 480.000  | Glatfelter Corp   | 8,76 %  | 04.11.2031            | 481.699            | 0,08                         |
| 455.000  | Iris Holding Inc  | 0,00 %  | 28.06.2028            | 439.644            | 0,07                         |
| 555.000  | Level 3 Financing Inc   | 10,92 % | 15.04.2030            | 566.586            | 0,09                         |
| 193.526  | Neptune BidCo US Inc  | 9,76 %  | 11.04.2029            | 174.209            | 0,03                         |
| 218.737  | Rackspace Finance LLC   | 10,85 % | 15.05.2028            | 227.030            | 0,04                         |
| 1.509.732  | Star Parent Inc   | 8,33 %  | 27.09.2030            | 1.477.461          | 0,24                         |
| 683.288  | VS Buyer LLC  | 7,12 %  | 12.04.2031            | 689.266            | 0,11                         |
| <b>Mittelfristige Schuldverschreibungen insgesamt<sup>†</sup></b>                          |   |         |                       | <b>6.832.101</b>   | <b>1,11</b>                  |
| <b>Pensionsgeschäfte 2,53 % (31. Dezember 2023: 0,00 %)</b>                                |   |         |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |   |         |                       |                    |                              |
| 15.500.000   | State Street Bank and Trust Co, repurchase value US\$ 15,503,815 <sup>^</sup> | 4,43 %  | 02.01.2025            | 15.500.000         | 2,53                         |
| <b>Pensionsgeschäfte insgesamt<sup>†</sup></b>   |   |         |                       | <b>15.500.000</b>  | <b>2,53</b>                  |
| <b>Anlagen insgesamt</b>   |   |         |                       | <b>607.120.542</b> | <b>98,95</b>                 |

<sup>^</sup> Besichert über US-Schatz-/Staatsanleihen mit einem Wert von insgesamt USD 15.810.076.

### Devisenterminkontrakte 2,52 % (31. Dezember 2023: 2,14 %)

| Geforderter<br>Betrag | Zu zahlender<br>Betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|-----------------------|------------------------|-----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------------|------------------------------|
| 2.557.149 US\$        | 2.283.199 €            | 16.01.2025            | Goldman Sachs International | 1         | 191.639                              | 0,03                         |
| 27.624.495 US\$       | 20.635.545 £           | 16.01.2025            | UBS AG                      | 1         | 1.783.485                            | 0,29                         |
| 146.498.894 US\$      | 130.527.660 €          | 16.01.2025            | UBS AG                      | 1         | 11.265.658                           | 1,84                         |
| 12.745.090 US\$       | 12.069.741 €           | 16.01.2025            | Westpac Banking Corp        | 4         | 240.230                              | 0,05                         |
| 1.452.117 US\$        | 1.148.032 £            | 16.01.2025            | Westpac Banking Corp        | 1         | 14.486                               | 0,01                         |

## Global High Yield Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 2,52 % (31. Dezember 2023: 2,14 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens        |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|-----------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 40.922 US\$  | 63.341 AUD          | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 2         | 1.704                          | 0,00                        |
| 33.882 US\$  | 52.399 AUD          | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 16        | 1.439                          | 0,00                        |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 30 CHF   | 33 US\$             | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | 0                              | 0,00                        |
| 699.162 US\$   | 621.705 CHF         | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | 12.116                         | 0,00                        |
| 6.245.801 US\$   | 5.441.848 CHF       | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 81        | 232.016                        | 0,03                        |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 4.519 €  | 4.682 US\$          | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 2         | 0                              | 0,00                        |
| 742.069 US\$   | 709.652 €           | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | 6.834                          | 0,00                        |
| 25.271.170 US\$  | 22.925.577 €        | 16.01.2025       | UBS AG                      | 2         | 1.519.117                      | 0,25                        |
| 4.850.163 US\$   | 4.548.131 €         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 87        | 138.065                        | 0,02                        |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 55 £   | 69 US\$             | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 2         | 0                              | 0,00                        |
| 132.265 US\$   | 101.191 £           | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | 5.548                          | 0,00                        |
| 200.907 US\$   | 159.473 £           | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | 1.206                          | 0,00                        |
| 1.374.343 US\$   | 1.068.295 £         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 56        | 36.560                         | 0,00                        |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>                        |                     |                  |                             |           | <b>15.450.103</b>              | <b>2,52</b>                 |
|  |                     |                  |                             |           | <b>Zeitwert US\$</b>           | <b>% des Nettovermögens</b> |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |                     |                  |                             |           | <b>622.570.645</b>             | <b>101,47</b>               |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Umgekehrte Pensionsgeschäfte (0,16 %) (31. Dezember 2023: 0,00 %)

| Kapitalbetrag US\$   | Beschreibung  | Zinsaufwand/ (Zinseinnahmen) | Fälligkeitsdatum*   | Zeitwert US\$    | Vertragliche Restlaufzeit der Vereinbarung* | % des Nettovermögens |
|--|---|------------------------------|---------------------|------------------|---|----------------------|
| 999.796  | Umgekehrtes Pensionsgeschäft BofA Securities, besichert durch Goodyear Tire & Rubber Co, 5,25 %, fällig am 15.07.2031 | 0,00 %                       | Offen/auf Verlangen | (999.796)        | Täglich und fortlaufend                     | (0,16)               |
| <b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte insgesamt <sup>∞</sup></b> |   |                              |                     | <b>(999.796)</b> |   | <b>(0,16)</b>        |

\* Offene umgekehrte Pensionsgeschäfte ohne ein bestimmtes Fälligkeitsdatum. Jede Partei kann die Vereinbarung auf Verlangen kündigen.

## Global High Yield Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (2,83 %) (31. Dezember 2023: (1,21 %))

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 471.077 €  | 499.157 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (11.098)                        | (0,00)               |
| 52.806 €   | 43.691 £            | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (3)                             | (0,00)               |
| 21.554.119 €   | 23.130.967 US\$     | 16.01.2025       | UBS AG                      | 12        | (799.813)                       | (0,13)               |
| 10.472.178 €   | 11.459.510 US\$     | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 4         | (609.806)                       | (0,10)               |
| 1.513.852 £  | 1.966.671 US\$      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (70.939)                        | (0,01)               |
| 2.297.595 £  | 2.972.369 US\$      | 16.01.2025       | UBS AG                      | 3         | (95.189)                        | (0,01)               |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 24.742 AUD   | 15.937 US\$         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (618)                           | (0,00)               |
| 4.695.077 AUD  | 3.162.646 US\$      | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | (255.634)                       | (0,04)               |
| 180.165 AUD  | 120.774 US\$        | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 24        | (9.220)                         | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 84.109.618 CHF   | 99.251.648 US\$     | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | (6.302.059)                     | (1,03)               |
| 2.348.419 CHF  | 2.684.488 US\$      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 26        | (89.250)                        | (0,01)               |
| 67.182 US\$  | 60.822 CHF          | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 2         | (32)                            | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 1.032.834 €  | 1.156.759 US\$      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (86.691)                        | (0,02)               |
| 118.209.516 €  | 130.312.397 US\$    | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | (7.841.380)                     | (1,28)               |
| 974.158 €  | 1.045.524 US\$      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 23        | (36.246)                        | (0,01)               |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 18.623.356 £   | 24.395.049 US\$     | 16.01.2025       | UBS AG                      | 2         | (1.073.817)                     | (0,18)               |
| 761.700 £  | 991.891 US\$        | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 38        | (38.044)                        | (0,01)               |
| 2.875 US\$   | 2.298 £             | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | (3)                             | (0,00)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>(17.319.842)</b>             | <b>(2,83)</b>        |

### Futures-Kontrakte (0,01 %) (31. Dezember 2023: (0,00 %))

| Anzahl Kontrakte   | Beschreibung                                    | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---|---------------------------------|----------------------|
| 79   | US Treasury 5-Year Note (CBT) Future March 2025 | (69.709)                        | (0,01)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten *</b> |   | <b>(69.709)</b>                 | <b>(0,01)</b>        |

|   | Zeitwert US\$       | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(18.389.347)</b> | <b>(3,00)</b>        |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>604.181.298</b>  | <b>98,47</b>         |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>9.384.683</b>    | <b>1,53</b>          |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>613.565.981</b>  | <b>100,00</b>        |

<sup>∧</sup> Schuldverschreibungen mit einem Zinssatz von 0,00 %, wurden zum 31. Dezember 2024 eventuell noch nicht abgerechnet und haben somit keinen gültigen Zinssatz. Die Zinssätze werden erst bei Abrechnung gültig.

## Global High Yield Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

| Portfolioanalyse  | US\$               | % des<br>Gesamtver-<br>mögens |
|---|--------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 131.012.779        | 20,46                         |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden            | 453.775.662        | 70,84                         |
| † Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente  | 21.332.305         | 3,33                          |
| ± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden                          | (69.709)           | (0,01)                        |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente   | (1.869.739)        | (0,29)                        |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>604.181.298</b> | <b>94,33</b>                  |

## Global Investment Grade Credit - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                       | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 95,72 % (31. Dezember 2023: 93,78 %)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>Kanadischer Dollar</b>  |   |        |                       |                  |                              |
| 455.000  | Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada† | 2,50 % | 14.05.2030            | 293.328          | 0,16                         |
| 195.000  | Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada† | 4,45 % | 27.02.2047            | 122.307          | 0,07                         |
| 455.000  | Canadian Pacific Railway Co†                | 2,54 % | 28.02.2028            | 307.099          | 0,17                         |
| 455.000  | Enbridge Inc†                               | 4,24 % | 27.08.2042            | 285.685          | 0,16                         |
| 410.000  | TELUS Corp†                                 | 2,75 % | 08.07.2026            | 282.182          | 0,16                         |
| 325.000  | TELUS Corp*                                 | 4,40 % | 01.04.2043            | 205.037          | 0,11                         |
| 620.000  | Thomson Reuters Corp†                       | 2,24 % | 14.05.2025            | 429.151          | 0,24                         |
| <b>Kanadischer Dollar insgesamt</b>                              |   |        |                       | <b>1.924.789</b> | <b>1,07</b>                  |
| <b>Euro</b>  |   |        |                       |                  |                              |
| 300.000  | Achmea Bank NV*                             | 2,75 % | 10.12.2027            | 311.464          | 0,17                         |
| 350.000  | AIB Group Plc*                              | 2,88 % | 30.05.2031            | 361.149          | 0,20                         |
| 100.000  | Allianz SE*                                 | 5,82 % | 25.07.2053            | 117.573          | 0,07                         |
| 139.000  | American Tower Corp*                        | 0,88 % | 21.05.2029            | 131.687          | 0,07                         |
| 150.000  | American Tower Corp*                        | 0,95 % | 05.10.2030            | 136.076          | 0,08                         |
| 100.000  | American Tower Corp*                        | 4,13 % | 16.05.2027            | 106.696          | 0,06                         |
| 350.000  | Anheuser-Busch InBev SA*                    | 3,75 % | 22.03.2037            | 371.168          | 0,21                         |
| 500.000  | ArcelorMittal SA*                           | 3,13 % | 13.12.2028            | 515.570          | 0,29                         |
| 300.000  | Arkema SA*                                  | 3,50 % | 12.09.2034            | 308.939          | 0,17                         |
| 500.000  | AT&T Inc*                                   | 2,45 % | 15.03.2035            | 472.286          | 0,26                         |
| 190.000  | Athene Global Funding*                      | 0,83 % | 08.01.2027            | 189.666          | 0,11                         |
| 457.000  | AusNet Services Holdings Pty Ltd*           | 1,63 % | 11.03.2081            | 458.738          | 0,25                         |
| 500.000  | Balder Finland OYJ*                         | 2,00 % | 18.01.2031            | 465.492          | 0,26                         |
| 400.000  | Banco BPM SpA*                              | 3,88 % | 09.09.2030            | 422.202          | 0,23                         |
| 400.000  | Banco de Credito Social Cooperativo SA*     | 4,13 % | 03.09.2030            | 427.209          | 0,24                         |
| 150.000  | Bank of America Corp*                       | 1,95 % | 27.10.2026            | 154.746          | 0,09                         |
| 200.000  | Barclays Plc*                               | 3,94 % | 31.01.2036            | 208.721          | 0,12                         |
| 100.000  | Barclays Plc*                               | 4,92 % | 08.08.2030            | 111.151          | 0,06                         |
| 300.000  | Bayerische Landesbank*                      | 1,38 % | 22.11.2032            | 290.111          | 0,16                         |
| 451.000  | Becton Dickinson & Co*                      | 3,83 % | 07.06.2032            | 480.949          | 0,27                         |
| 200.000  | BNP Paribas SA*                             | 4,10 % | 13.02.2034            | 213.174          | 0,12                         |
| 600.000  | Booking Holdings Inc*                       | 3,88 % | 21.03.2045            | 617.874          | 0,34                         |
| 200.000  | BP Capital Markets Plc*                     | 1,10 % | 15.11.2034            | 166.087          | 0,09                         |
| 400.000  | CaixaBank SA*                               | 2,25 % | 17.04.2030            | 414.488          | 0,23                         |
| 1.000.000  | Citigroup Inc*                              | 0,50 % | 08.10.2027            | 998.326          | 0,55                         |
| 100.000  | Citycon Treasury BV*                        | 5,00 % | 11.03.2030            | 104.652          | 0,06                         |
| 600.000  | Citycon Treasury BV*                        | 6,50 % | 08.03.2029            | 662.383          | 0,37                         |
| 700.000  | Comcast Corp*                               | 3,55 % | 26.09.2036            | 729.144          | 0,41                         |
| 300.000  | Crelan SA*                                  | 5,25 % | 23.01.2032            | 338.812          | 0,19                         |

## Global Investment Grade Credit - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                 | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|---------------------------------------|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 95,72 % (31. Dezember 2023: 93,78 %) (Fortsetzung)</b> |                                       |        |                       |                  |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |                                       |        |                       |                  |                              |
| 600.000  | Crelan SA*                            | 5,38 % | 30.04.2035            | 654.464          | 0,36                         |
| 200.000  | Danske Bank A/S*                      | 1,38 % | 12.02.2030            | 206.717          | 0,11                         |
| 310.000  | Digital Dutch Finco BV*               | 1,25 % | 01.02.2031            | 283.481          | 0,16                         |
| 100.000  | Duke Energy Corp*                     | 3,85 % | 15.06.2034            | 104.083          | 0,06                         |
| 100.000  | Electricite de France SA*             | 4,75 % | 12.10.2034            | 112.560          | 0,06                         |
| 1.166.000  | Grand City Properties Finance Sarl*   | 6,13 % | 31.12.2149            | 1.198.790        | 0,67                         |
| 680.000  | Heimstaden Bostad AB*                 | 1,13 % | 21.01.2026            | 687.802          | 0,38                         |
| 500.000  | Heimstaden Bostad AB*                 | 3,88 % | 05.11.2029            | 516.004          | 0,29                         |
| 200.000  | Heimstaden Bostad Treasury BV*        | 0,75 % | 06.09.2029            | 180.191          | 0,10                         |
| 400.000  | Heimstaden Bostad Treasury BV*        | 1,00 % | 13.04.2028            | 379.821          | 0,21                         |
| 740.000  | Heimstaden Bostad Treasury BV*        | 1,38 % | 24.07.2028            | 707.397          | 0,39                         |
| 600.000  | ING Groep NV*                         | 2,00 % | 22.03.2030            | 620.896          | 0,35                         |
| 350.000  | Islandsbanki HF*                      | 4,63 % | 27.03.2028            | 376.698          | 0,21                         |
| 600.000  | JPMorgan Chase & Co*                  | 3,76 % | 21.03.2034            | 638.253          | 0,35                         |
| 300.000  | Landsbankinn HF*                      | 3,75 % | 08.10.2029            | 311.826          | 0,17                         |
| 100.000  | Linde Plc*                            | 3,63 % | 12.06.2034            | 106.780          | 0,06                         |
| 581.000  | Medtronic Inc*                        | 4,15 % | 15.10.2053            | 627.396          | 0,35                         |
| 95.000   | Metropolitan Life Global Funding I*   | 4,00 % | 05.04.2028            | 102.583          | 0,06                         |
| 950.000  | Mobico Group Plc*                     | 4,88 % | 26.09.2031            | 987.123          | 0,55                         |
| 400.000  | MSD Netherlands Capital BV*           | 3,75 % | 30.05.2054            | 409.423          | 0,23                         |
| 386.000  | National Grid Plc*                    | 2,95 % | 30.03.2030            | 397.672          | 0,22                         |
| 500.000  | Nationwide Building Society*          | 3,83 % | 24.07.2032            | 532.658          | 0,30                         |
| 249.000  | NatWest Group Plc*                    | 0,67 % | 14.09.2029            | 237.167          | 0,13                         |
| 100.000  | NIBC Bank NV*                         | 4,50 % | 12.06.2035            | 103.915          | 0,06                         |
| 900.000  | Norddeutsche Landesbank-Girozentrale* | 5,63 % | 23.08.2034            | 968.509          | 0,54                         |
| 900.000  | Public Property Invest AS*            | 4,63 % | 12.03.2030            | 936.550          | 0,52                         |
| 543.000  | PVH Corp*                             | 4,13 % | 16.07.2029            | 580.452          | 0,32                         |
| 600.000  | SCOR SE*                              | 6,00 % | 31.12.2149            | 631.332          | 0,35                         |
| 1.281.000  | Southern Co*                          | 1,88 % | 15.09.2081            | 1.249.491        | 0,69                         |
| 733.000  | Southern Gas Networks Plc*            | 3,50 % | 16.10.2030            | 760.176          | 0,42                         |
| 1.100.000  | Standard Chartered Plc*               | 2,50 % | 09.09.2030            | 1.137.617        | 0,63                         |
| 1.200.000  | Stellantis NV*                        | 2,75 % | 01.04.2032            | 1.160.447        | 0,65                         |
| 800.000  | Stellantis NV*                        | 4,00 % | 19.03.2034            | 826.338          | 0,46                         |
| 200.000  | Swisscom Finance BV*                  | 3,63 % | 29.11.2036            | 211.325          | 0,12                         |
| 500.000  | TAG Immobilien AG*                    | 4,25 % | 04.03.2030            | 528.785          | 0,29                         |
| 400.000  | TenneT Holding BV*                    | 0,88 % | 16.06.2035            | 333.286          | 0,19                         |
| 995.000  | Timken Co*                            | 4,13 % | 23.05.2034            | 1.032.169        | 0,57                         |
| 100.000  | Toyota Finance Australia Ltd*         | 3,39 % | 18.03.2030            | 105.327          | 0,06                         |
| 250.000  | UBS Group AG*                         | 1,00 % | 24.06.2027            | 252.021          | 0,14                         |

## Global Investment Grade Credit - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                               | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 95,72 % (31. Dezember 2023: 93,78 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                   |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |   |        |                       |                   |                              |
| 170.000  | UBS Group AG*                                       | 2,13 % | 13.10.2026            | 176.633           | 0,10                         |
| 400.000  | Verizon Communications Inc*                         | 3,75 % | 28.02.2036            | 421.256           | 0,23                         |
| 116.000  | Verizon Communications Inc*                         | 4,25 % | 31.10.2030            | 127.821           | 0,07                         |
| 100.000  | Virgin Money UK Plc*                                | 4,00 % | 18.03.2028            | 106.112           | 0,06                         |
| 300.000  | Volkswagen Financial Services AG*                   | 3,88 % | 19.11.2031            | 311.713           | 0,17                         |
| 400.000  | Volkswagen Leasing GmbH*                            | 3,63 % | 11.10.2026            | 419.780           | 0,23                         |
| 1.400.000  | Warnermedia Holdings Inc*                           | 4,69 % | 17.05.2033            | 1.451.639         | 0,81                         |
| <b>Euro insgesamt</b>  |   |        |                       | <b>34.499.012</b> | <b>19,18</b>                 |
| <b>Britisches Pfund</b>  |   |        |                       |                   |                              |
| 1.200.000  | AA Bond Co Ltd*                                     | 3,25 % | 31.07.2028            | 1.357.900         | 0,75                         |
| 1.284.000  | AA Bond Co Ltd*                                     | 6,85 % | 31.07.2031            | 1.645.606         | 0,91                         |
| 150.000  | Admiral Group Plc*                                  | 8,50 % | 06.01.2034            | 211.250           | 0,12                         |
| 131.000  | Barclays Plc*                                       | 5,85 % | 21.03.2035            | 165.588           | 0,09                         |
| 180.000  | Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl** | 2,63 % | 20.10.2028            | 204.541           | 0,11                         |
| 100.000  | Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl*  | 4,88 % | 29.04.2032            | 117.587           | 0,07                         |
| 500.000  | Centrica Plc*                                       | 4,25 % | 12.09.2044            | 496.275           | 0,28                         |
| 1.200.000  | Coventry Building Society*                          | 5,88 % | 12.03.2030            | 1.537.173         | 0,85                         |
| 400.000  | DWR Cymru Financing UK Plc*                         | 5,75 % | 10.09.2044            | 486.280           | 0,27                         |
| 400.000  | Electricite de France SA*                           | 6,00 % | 31.12.2149            | 501.068           | 0,28                         |
| 700.000  | Electricite de France SA*                           | 7,38 % | 31.12.2149            | 892.618           | 0,50                         |
| 140.000  | Ford Motor Credit Co LLC*                           | 5,78 % | 30.04.2030            | 173.107           | 0,10                         |
| 100.000  | Great Portland Estates Plc*                         | 5,38 % | 25.09.2031            | 123.145           | 0,07                         |
| 800.000  | Hammerson Plc*                                      | 5,88 % | 08.10.2036            | 966.207           | 0,54                         |
| 130.000  | Holcim Sterling Finance Netherlands BV*             | 2,25 % | 04.04.2034            | 125.489           | 0,07                         |
| 300.000  | HSBC Holdings Plc*                                  | 5,29 % | 16.09.2032            | 374.178           | 0,21                         |
| 800.000  | Morgan Stanley*                                     | 5,21 % | 24.10.2035            | 978.335           | 0,54                         |
| 400.000  | National Gas Transmission Plc*                      | 1,63 % | 14.01.2043            | 262.862           | 0,15                         |
| 1.600.000  | NGG Finance Plc*                                    | 5,63 % | 18.06.2073            | 2.008.615         | 1,12                         |
| 1.000.000  | OSB Group Plc*                                      | 8,88 % | 16.01.2030            | 1.371.278         | 0,76                         |
| 600.000  | Pension Insurance Corp Plc*                         | 6,88 % | 15.11.2034            | 755.056           | 0,42                         |
| 300.000  | Pension Insurance Corp Plc*                         | 8,00 % | 13.11.2033            | 404.269           | 0,22                         |
| 600.000  | Rothsay Life Plc*                                   | 7,02 % | 10.12.2034            | 771.162           | 0,43                         |
| 600.000  | Severn Trent Utilities Finance Plc*                 | 4,88 % | 24.01.2042            | 664.595           | 0,37                         |
| 100.000  | Severn Trent Utilities Finance Plc*                 | 5,88 % | 31.07.2038            | 127.080           | 0,07                         |
| 647.000  | South West Water Finance Plc*                       | 6,38 % | 05.08.2041            | 814.254           | 0,45                         |
| 500.000  | Southern Water Services Finance Ltd*                | 1,63 % | 30.03.2027            | 516.768           | 0,29                         |
| 313.000  | SW Finance I Plc*                                   | 7,00 % | 16.04.2040            | 349.530           | 0,19                         |
| 900.000  | Time Warner Cable LLC*                              | 5,25 % | 15.07.2042            | 933.255           | 0,52                         |
| 600.000  | Traton Finance Luxembourg SA*                       | 5,63 % | 16.01.2029            | 756.342           | 0,42                         |

## Global Investment Grade Credit - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung  | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 95,72 % (31. Dezember 2023: 93,78 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                   |                              |
| <b>Britisches Pfund (Fortsetzung)</b>  |  |        |                       |                   |                              |
| 600.000  | Wessex Water Services Finance Plc <sup>*</sup>                         | 1,25 % | 12.01.2036            | 476.052           | 0,26                         |
| 900.000  | Wessex Water Services Finance Plc <sup>*</sup>                         | 1,50 % | 17.09.2029            | 945.837           | 0,53                         |
| <b>Britisches Pfund insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>21.513.302</b> | <b>11,96</b>                 |
| <b>US-Dollar</b>   |  |        |                       |                   |                              |
| 590.000  | AbbVie Inc <sup>*</sup>  | 4,05 % | 21.11.2039            | 504.456           | 0,28                         |
| 430.000  | AbbVie Inc <sup>*</sup>  | 5,40 % | 15.03.2054            | 414.294           | 0,23                         |
| 350.000  | AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust <sup>*</sup>   | 1,75 % | 30.01.2026            | 338.830           | 0,19                         |
| 885.000  | AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust <sup>*</sup>   | 3,00 % | 29.10.2028            | 819.870           | 0,46                         |
| 710.000  | AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust <sup>*</sup>   | 3,30 % | 30.01.2032            | 618.891           | 0,34                         |
| 805.000  | Air Lease Corp <sup>*</sup>  | 4,63 % | 01.10.2028            | 792.017           | 0,44                         |
| 610.000  | Air Lease Corp <sup>*</sup>  | 5,10 % | 01.03.2029            | 611.863           | 0,34                         |
| 1.405.000  | Algonquin Power & Utilities Corp <sup>**</sup>                         | 5,37 % | 15.06.2026            | 1.412.903         | 0,79                         |
| 1.425.000  | Ally Financial Inc <sup>**</sup>                                       | 6,18 % | 26.07.2035            | 1.409.447         | 0,78                         |
| 515.000  | American Express Co <sup>**</sup>                                      | 5,65 % | 23.04.2027            | 520.622           | 0,29                         |
| 455.000  | American Express Co <sup>**</sup>                                      | 6,49 % | 30.10.2031            | 486.482           | 0,27                         |
| 485.000  | American International Group Inc <sup>*</sup>                          | 4,75 % | 01.04.2048            | 429.281           | 0,24                         |
| 460.000  | American Tower Corp <sup>*</sup>                                       | 5,00 % | 31.01.2030            | 457.531           | 0,25                         |
| 835.000  | Americold Realty Operating Partnership LP <sup>*</sup>                 | 5,41 % | 12.09.2034            | 800.906           | 0,45                         |
| 600.000  | Amgen Inc <sup>**</sup>  | 2,80 % | 15.08.2041            | 418.120           | 0,23                         |
| 540.000  | Amgen Inc <sup>**</sup>  | 4,40 % | 01.05.2045            | 448.330           | 0,25                         |
| 1.045.000  | Amgen Inc <sup>**</sup>  | 5,15 % | 02.03.2028            | 1.052.846         | 0,59                         |
| 230.000  | Amgen Inc <sup>**</sup>  | 5,75 % | 02.03.2063            | 220.777           | 0,12                         |
| 875.000  | Anheuser-Busch Cos LLC/Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc <sup>*</sup> | 4,70 % | 01.02.2036            | 830.723           | 0,46                         |
| 695.000  | Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc <sup>*</sup>                        | 5,45 % | 23.01.2039            | 697.311           | 0,39                         |
| 280.000  | Aon North America Inc <sup>*</sup>                                     | 5,75 % | 01.03.2054            | 273.308           | 0,15                         |
| 665.000  | AT&T Inc <sup>*</sup>  | 3,50 % | 01.06.2041            | 509.938           | 0,28                         |
| 1.455.000  | AT&T Inc <sup>**</sup>   | 3,50 % | 15.09.2053            | 980.640           | 0,54                         |
| 335.000  | Baker Hughes Holdings LLC/Baker Hughes Co-Obligor Inc <sup>**</sup>    | 4,08 % | 15.12.2047            | 263.878           | 0,15                         |
| 400.000  | Banco Santander SA <sup>*</sup>  | 5,55 % | 14.03.2028            | 403.674           | 0,22                         |
| 1.050.000  | Bank of America Corp <sup>**</sup>                                     | 1,92 % | 24.10.2031            | 877.590           | 0,49                         |
| 500.000  | Bank of America Corp <sup>**</sup>                                     | 5,20 % | 25.04.2029            | 502.454           | 0,28                         |
| 455.000  | Bank of America Corp <sup>**</sup>                                     | 5,43 % | 15.08.2035            | 443.083           | 0,25                         |
| 1.040.000  | Bank of America Corp <sup>**</sup>                                     | 5,52 % | 25.10.2035            | 1.017.403         | 0,57                         |
| 1.110.000  | Barclays Plc <sup>*</sup>  | 5,67 % | 12.03.2028            | 1.124.230         | 0,62                         |
| 1.070.000  | BNP Paribas SA <sup>**</sup>   | 5,28 % | 19.11.2030            | 1.059.394         | 0,59                         |
| 960.000  | Boeing Co <sup>*</sup>   | 3,63 % | 01.02.2031            | 872.002           | 0,48                         |
| 530.000  | Boeing Co <sup>*</sup>   | 5,81 % | 01.05.2050            | 493.767           | 0,27                         |
| 430.000  | BPCE SA <sup>**</sup>  | 5,94 % | 30.05.2035            | 426.400           | 0,24                         |
| 570.000  | Bristol-Myers Squibb Co <sup>*</sup>                                   | 5,10 % | 22.02.2031            | 573.816           | 0,32                         |

## Global Investment Grade Credit - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 95,72 % (31. Dezember 2023: 93,78 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 335.000  | Bristol-Myers Squibb Co <sup>*</sup>  | 5,65 % | 22.02.2064            | 322.711          | 0,18                         |
| 570.000  | Brixmor Operating Partnership LP <sup>*</sup>   | 5,75 % | 15.02.2035            | 575.979          | 0,32                         |
| 815.000  | Broadcom Inc <sup>**</sup>  | 4,35 % | 15.02.2030            | 793.170          | 0,44                         |
| 650.000  | Broadcom Inc <sup>**</sup>  | 4,80 % | 15.10.2034            | 627.545          | 0,35                         |
| 600.000  | Cadence Design Systems Inc <sup>**</sup>  | 4,70 % | 10.09.2034            | 575.534          | 0,32                         |
| 750.000  | Capital One Financial Corp <sup>**</sup>  | 5,70 % | 01.02.2030            | 760.523          | 0,42                         |
| 605.000  | Capital One Financial Corp <sup>**</sup>  | 7,62 % | 30.10.2031            | 668.194          | 0,37                         |
| 725.000  | CDW LLC/CDW Finance Corp <sup>**</sup>  | 3,25 % | 15.02.2029            | 668.527          | 0,37                         |
| 975.000  | CenterPoint Energy Inc <sup>*</sup>   | 5,40 % | 01.06.2029            | 986.744          | 0,55                         |
| 330.000  | Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital <sup>**</sup> | 4,80 % | 01.03.2050            | 248.231          | 0,14                         |
| 695.000  | Cisco Systems Inc <sup>**</sup>   | 4,95 % | 26.02.2031            | 697.671          | 0,39                         |
| 200.000  | Cisco Systems Inc <sup>**</sup>   | 5,30 % | 26.02.2054            | 194.553          | 0,11                         |
| 840.000  | Citibank NA <sup>**</sup>   | 5,57 % | 30.04.2034            | 850.205          | 0,47                         |
| 575.000  | Citigroup Inc <sup>**</sup>   | 4,41 % | 31.03.2031            | 552.938          | 0,31                         |
| 860.000  | Citigroup Inc <sup>**</sup>   | 4,54 % | 19.09.2030            | 835.847          | 0,46                         |
| 335.000  | Consolidated Edison Co of New York Inc <sup>*</sup>   | 5,70 % | 15.05.2054            | 333.608          | 0,19                         |
| 470.000  | Constellation Brands Inc <sup>*</sup>   | 4,75 % | 09.05.2032            | 452.377          | 0,25                         |
| 900.000  | Cooperatieve Rabobank UA <sup>**</sup>  | 5,50 % | 18.07.2025            | 904.705          | 0,50                         |
| 500.000  | Corebridge Financial Inc <sup>**</sup>  | 3,65 % | 05.04.2027            | 486.220          | 0,27                         |
| 270.000  | CVS Health Corp <sup>*</sup>  | 5,05 % | 25.03.2048            | 222.916          | 0,12                         |
| 640.000  | CVS Health Corp <sup>*</sup>  | 5,13 % | 21.02.2030            | 626.739          | 0,35                         |
| 950.000  | Dell International LLC/EMC Corp <sup>*</sup>  | 4,85 % | 01.02.2035            | 902.499          | 0,50                         |
| 365.000  | Devon Energy Corp <sup>*</sup>  | 5,75 % | 15.09.2054            | 331.430          | 0,18                         |
| 395.000  | Diamondback Energy Inc <sup>**</sup>  | 5,40 % | 18.04.2034            | 388.618          | 0,22                         |
| 280.000  | Diamondback Energy Inc <sup>**</sup>  | 5,75 % | 18.04.2054            | 262.995          | 0,15                         |
| 380.000  | Diamondback Energy Inc <sup>*</sup>   | 6,25 % | 15.03.2053            | 379.429          | 0,21                         |
| 820.000  | Dominion Energy Inc <sup>*</sup>  | 5,38 % | 15.11.2032            | 822.126          | 0,46                         |
| 890.000  | Dominion Energy Inc <sup>**</sup>   | 6,63 % | 15.05.2055            | 907.056          | 0,50                         |
| 810.000  | Duke Energy Corp <sup>*</sup>   | 3,75 % | 01.09.2046            | 597.265          | 0,33                         |
| 595.000  | Duke Energy Corp <sup>*</sup>   | 4,50 % | 15.08.2032            | 567.046          | 0,31                         |
| 400.000  | Duke Energy Corp <sup>*</sup>   | 5,80 % | 15.06.2054            | 390.216          | 0,22                         |
| 770.000  | Enbridge Inc <sup>*</sup>   | 5,70 % | 08.03.2033            | 778.381          | 0,43                         |
| 610.000  | Enbridge Inc <sup>*</sup>   | 5,95 % | 05.04.2054            | 603.477          | 0,34                         |
| 595.000  | Energy Transfer LP <sup>**</sup>  | 5,55 % | 15.05.2034            | 592.343          | 0,33                         |
| 460.000  | Energy Transfer LP <sup>*</sup>   | 5,95 % | 15.05.2054            | 444.991          | 0,25                         |
| 535.000  | Energy Transfer LP <sup>*</sup>   | 6,55 % | 01.12.2033            | 569.893          | 0,32                         |
| 500.000  | Essential Utilities Inc <sup>*</sup>  | 4,80 % | 15.08.2027            | 499.670          | 0,28                         |
| 300.000  | Exelon Corp <sup>**</sup>   | 4,45 % | 15.04.2046            | 250.355          | 0,14                         |
| 420.000  | Fifth Third Bancorp <sup>**</sup>   | 5,63 % | 29.01.2032            | 424.825          | 0,24                         |
| 1.000.000  | FirstEnergy Corp <sup>*</sup>   | 3,90 % | 15.07.2027            | 974.527          | 0,54                         |

## Global Investment Grade Credit - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                          | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 95,72 % (31. Dezember 2023: 93,78 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |        |                       |                  |                              |
| 585.000  | Fiserv Inc <sup>*</sup>                        | 5,15 % | 15.03.2027            | 589.902          | 0,33                         |
| 1.305.000  | Ford Motor Credit Co LLC <sup>*</sup>          | 6,80 % | 07.11.2028            | 1.352.792        | 0,75                         |
| 630.000  | GATX Corp <sup>*</sup>                         | 5,40 % | 15.03.2027            | 637.211          | 0,35                         |
| 1.275.000  | GE HealthCare Technologies Inc <sup>**</sup>   | 5,86 % | 15.03.2030            | 1.320.989        | 0,73                         |
| 990.000  | General Motors Financial Co Inc <sup>*</sup>   | 3,60 % | 21.06.2030            | 908.010          | 0,50                         |
| 500.000  | General Motors Financial Co Inc <sup>*</sup>   | 5,80 % | 23.06.2028            | 510.201          | 0,28                         |
| 600.000  | General Motors Financial Co Inc <sup>*</sup>   | 5,95 % | 04.04.2034            | 603.437          | 0,34                         |
| 865.000  | Global Payments Inc <sup>*</sup>               | 2,15 % | 15.01.2027            | 820.358          | 0,46                         |
| 435.000  | Goldman Sachs Bank USA <sup>**</sup>           | 5,28 % | 18.03.2027            | 437.546          | 0,24                         |
| 470.000  | Goldman Sachs Group Inc <sup>**</sup>          | 1,54 % | 10.09.2027            | 444.584          | 0,25                         |
| 625.000  | Goldman Sachs Group Inc <sup>**</sup>          | 1,99 % | 27.01.2032            | 516.028          | 0,29                         |
| 740.000  | Goldman Sachs Group Inc <sup>**</sup>          | 3,81 % | 23.04.2029            | 712.089          | 0,40                         |
| 640.000  | Goldman Sachs Group Inc <sup>*</sup>           | 5,85 % | 25.04.2035            | 652.367          | 0,36                         |
| 790.000  | HCA Inc <sup>*</sup>                           | 5,25 % | 15.06.2049            | 684.496          | 0,38                         |
| 500.000  | Healthpeak OP LLC <sup>*</sup>                 | 2,13 % | 01.12.2028            | 449.606          | 0,25                         |
| 780.000  | Hewlett Packard Enterprise Co <sup>*</sup>     | 4,40 % | 25.09.2027            | 771.925          | 0,43                         |
| 465.000  | Home Depot Inc <sup>*</sup>                    | 4,25 % | 01.04.2046            | 387.176          | 0,22                         |
| 1.095.000  | HSBC Holdings Plc <sup>*</sup>                 | 5,13 % | 19.11.2028            | 1.094.939        | 0,61                         |
| 315.000  | HSBC USA Inc <sup>*</sup>                      | 5,29 % | 04.03.2027            | 319.036          | 0,18                         |
| 920.000  | Intel Corp <sup>**</sup>                       | 4,90 % | 05.08.2052            | 726.954          | 0,40                         |
| 350.000  | Intel Corp <sup>**</sup>                       | 5,60 % | 21.02.2054            | 307.164          | 0,17                         |
| 605.000  | Intel Corp <sup>**</sup>                       | 5,70 % | 10.02.2053            | 535.445          | 0,30                         |
| 585.000  | ITC Holdings Corp <sup>**</sup>                | 2,95 % | 14.05.2030            | 523.732          | 0,29                         |
| 230.000  | JPMorgan Chase & Co <sup>**</sup>              | 1,47 % | 22.09.2027            | 217.656          | 0,12                         |
| 585.000  | JPMorgan Chase & Co <sup>**</sup>              | 2,58 % | 22.04.2032            | 502.063          | 0,28                         |
| 1.260.000  | JPMorgan Chase & Co <sup>**</sup>              | 4,60 % | 22.10.2030            | 1.236.392        | 0,69                         |
| 1.130.000  | JPMorgan Chase & Co <sup>**</sup>              | 5,29 % | 22.07.2035            | 1.118.508        | 0,62                         |
| 410.000  | Kenvue Inc <sup>**</sup>                       | 5,00 % | 22.03.2030            | 413.181          | 0,23                         |
| 300.000  | Kenvue Inc <sup>**</sup>                       | 5,10 % | 22.03.2043            | 287.954          | 0,16                         |
| 400.000  | Kimco Realty OP LLC <sup>*</sup>               | 4,85 % | 01.03.2035            | 381.140          | 0,21                         |
| 1.250.000  | Lloyds Banking Group Plc <sup>*</sup>          | 5,09 % | 26.11.2028            | 1.251.819        | 0,70                         |
| 235.000  | Lloyds Banking Group Plc <sup>*</sup>          | 5,87 % | 06.03.2029            | 239.446          | 0,13                         |
| 500.000  | Lockheed Martin Corp <sup>*</sup>              | 5,20 % | 15.02.2064            | 464.332          | 0,26                         |
| 355.000  | LYB International Finance III LLC <sup>*</sup> | 4,20 % | 15.10.2049            | 266.237          | 0,15                         |
| 220.000  | Marriott International Inc <sup>**</sup>       | 4,88 % | 15.05.2029            | 219.291          | 0,12                         |
| 410.000  | Marsh & McLennan Cos Inc <sup>*</sup>          | 5,35 % | 15.11.2044            | 398.162          | 0,22                         |
| 850.000  | McCormick & Co Inc <sup>*</sup>                | 4,70 % | 15.10.2034            | 800.650          | 0,44                         |
| 285.000  | McDonald's Corp <sup>*</sup>                   | 3,63 % | 01.09.2049            | 205.633          | 0,11                         |
| 495.000  | Meta Platforms Inc <sup>**</sup>               | 5,55 % | 15.08.2064            | 482.967          | 0,27                         |
| 405.000  | Meta Platforms Inc <sup>**</sup>               | 5,60 % | 15.05.2053            | 405.197          | 0,23                         |

## Global Investment Grade Credit - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                               | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 95,72 % (31. Dezember 2023: 93,78 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 245.000  | MidAmerican Energy Co <sup>*</sup>                  | 5,30 % | 01.02.2055            | 231.746          | 0,13                         |
| 665.000  | Mitsubishi UFJ Financial Group Inc <sup>**</sup>    | 5,26 % | 17.04.2030            | 670.935          | 0,37                         |
| 370.000  | Molson Coors Beverage Co <sup>*</sup>               | 3,00 % | 15.07.2026            | 360.655          | 0,20                         |
| 540.000  | Morgan Stanley <sup>**</sup>                        | 1,93 % | 28.04.2032            | 441.908          | 0,25                         |
| 500.000  | Morgan Stanley <sup>**</sup>                        | 2,70 % | 22.01.2031            | 444.427          | 0,25                         |
| 405.000  | Morgan Stanley <sup>**</sup>                        | 5,12 % | 01.02.2029            | 406.192          | 0,23                         |
| 475.000  | Morgan Stanley <sup>**</sup>                        | 5,47 % | 18.01.2035            | 472.576          | 0,26                         |
| 510.000  | Morgan Stanley <sup>**</sup>                        | 5,52 % | 19.11.2055            | 491.934          | 0,27                         |
| 270.000  | Morgan Stanley <sup>**</sup>                        | 5,83 % | 19.04.2035            | 275.264          | 0,15                         |
| 1.000.000  | National Bank of Canada <sup>**</sup>               | 4,50 % | 10.10.2029            | 972.930          | 0,54                         |
| 605.000  | Nationwide Building Society <sup>*</sup>            | 6,56 % | 18.10.2027            | 620.993          | 0,34                         |
| 715.000  | NatWest Group Plc <sup>*</sup>                      | 5,58 % | 01.03.2028            | 723.836          | 0,40                         |
| 1.460.000  | NatWest Group Plc <sup>*</sup>                      | 5,81 % | 13.09.2029            | 1.489.365        | 0,83                         |
| 975.000  | Netflix Inc <sup>**</sup>                           | 5,88 % | 15.11.2028            | 1.010.881        | 0,56                         |
| 800.000  | Newmont Corp/Newcrest Finance Pty Ltd <sup>**</sup> | 5,35 % | 15.03.2034            | 796.457          | 0,44                         |
| 500.000  | NextEra Energy Capital Holdings Inc <sup>*</sup>    | 4,90 % | 28.02.2028            | 500.830          | 0,28                         |
| 500.000  | NextEra Energy Capital Holdings Inc <sup>*</sup>    | 5,00 % | 15.07.2032            | 492.678          | 0,27                         |
| 675.000  | NextEra Energy Capital Holdings Inc <sup>*</sup>    | 5,25 % | 28.02.2053            | 620.276          | 0,34                         |
| 335.000  | NextEra Energy Capital Holdings Inc <sup>**</sup>   | 6,05 % | 01.03.2025            | 335.622          | 0,19                         |
| 600.000  | NXP BV/NXP Funding LLC/NXP USA Inc <sup>**</sup>    | 4,30 % | 18.06.2029            | 582.788          | 0,32                         |
| 335.000  | Occidental Petroleum Corp <sup>*</sup>              | 6,05 % | 01.10.2054            | 318.054          | 0,18                         |
| 460.000  | Occidental Petroleum Corp <sup>*</sup>              | 6,13 % | 01.01.2031            | 470.992          | 0,26                         |
| 630.000  | Occidental Petroleum Corp <sup>**</sup>             | 6,45 % | 15.09.2036            | 645.387          | 0,36                         |
| 1.210.000  | OGE Energy Corp <sup>*</sup>                        | 5,45 % | 15.05.2029            | 1.230.288        | 0,68                         |
| 400.000  | ONEOK Inc <sup>*</sup>                              | 5,05 % | 01.11.2034            | 382.814          | 0,21                         |
| 250.000  | ONEOK Inc <sup>*</sup>                              | 5,70 % | 01.11.2054            | 235.297          | 0,13                         |
| 350.000  | ONEOK Inc <sup>*</sup>                              | 6,63 % | 01.09.2053            | 368.332          | 0,20                         |
| 880.000  | Oracle Corp <sup>*</sup>                            | 4,00 % | 15.07.2046            | 677.902          | 0,38                         |
| 1.299.000  | Otis Worldwide Corp <sup>*</sup>                    | 5,13 % | 19.11.2031            | 1.300.241        | 0,72                         |
| 500.000  | Pacific Gas & Electric Co <sup>**</sup>             | 3,45 % | 01.07.2025            | 496.190          | 0,28                         |
| 635.000  | Pacific Gas & Electric Co <sup>**</sup>             | 4,95 % | 01.07.2050            | 552.166          | 0,31                         |
| 205.000  | Pacific Gas & Electric Co <sup>*</sup>              | 6,75 % | 15.01.2053            | 223.605          | 0,12                         |
| 635.000  | Pacific Gas & Electric Co <sup>*</sup>              | 6,95 % | 15.03.2034            | 695.870          | 0,39                         |
| 740.000  | Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd <sup>*</sup>  | 5,11 % | 19.05.2043            | 695.093          | 0,39                         |
| 470.000  | Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd <sup>*</sup>  | 5,34 % | 19.05.2063            | 431.869          | 0,24                         |
| 880.000  | PNC Financial Services Group Inc <sup>**</sup>      | 4,81 % | 21.10.2032            | 856.771          | 0,48                         |
| 485.000  | PNC Financial Services Group Inc <sup>**</sup>      | 5,10 % | 23.07.2027            | 487.442          | 0,27                         |
| 630.000  | Potomac Electric Power Co <sup>**</sup>             | 5,50 % | 15.03.2054            | 611.986          | 0,34                         |
| 675.000  | PPL Capital Funding Inc <sup>*</sup>                | 5,25 % | 01.09.2034            | 664.933          | 0,37                         |
| 360.000  | Public Service Electric & Gas Co <sup>*</sup>       | 5,45 % | 01.08.2053            | 352.655          | 0,20                         |

## Global Investment Grade Credit - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                               | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 95,72 % (31. Dezember 2023: 93,78 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 675.000  | Rogers Communications Inc**                         | 4,50 % | 15.03.2042            | 571.056          | 0,32                         |
| 555.000  | Rogers Communications Inc*                          | 5,00 % | 15.03.2044            | 493.382          | 0,27                         |
| 225.000  | RTX Corp*   | 4,63 % | 16.11.2048            | 191.484          | 0,11                         |
| 310.000  | RTX Corp*   | 6,10 % | 15.03.2034            | 326.595          | 0,18                         |
| 155.000  | RTX Corp*   | 6,40 % | 15.03.2054            | 168.745          | 0,09                         |
| 370.000  | Santander UK Group Holdings Plc*                    | 3,82 % | 03.11.2028            | 356.459          | 0,20                         |
| 1.095.000  | Santander UK Group Holdings Plc*                    | 4,86 % | 11.09.2030            | 1.065.163        | 0,59                         |
| 215.000  | Smith & Nephew Plc*                                 | 5,15 % | 20.03.2027            | 216.584          | 0,12                         |
| 315.000  | Solventum Corp**                                    | 5,45 % | 25.02.2027            | 318.126          | 0,18                         |
| 765.000  | Southern California Edison Co*                      | 5,45 % | 01.06.2031            | 777.789          | 0,43                         |
| 370.000  | Takeda Pharmaceutical Co Ltd**                      | 3,03 % | 09.07.2040            | 268.378          | 0,15                         |
| 795.000  | Tampa Electric Co**                                 | 4,90 % | 01.03.2029            | 794.810          | 0,44                         |
| 650.000  | Texas Instruments Inc**                             | 5,05 % | 18.05.2063            | 586.200          | 0,33                         |
| 210.000  | The Campbell's Co**                                 | 4,75 % | 23.03.2035            | 198.124          | 0,11                         |
| 450.000  | The Campbell's Co**                                 | 5,25 % | 13.10.2054            | 407.076          | 0,23                         |
| 700.000  | T-Mobile USA Inc**                                  | 3,40 % | 15.10.2052            | 467.310          | 0,26                         |
| 290.000  | T-Mobile USA Inc**                                  | 4,50 % | 15.04.2050            | 238.076          | 0,13                         |
| 970.000  | T-Mobile USA Inc**                                  | 5,05 % | 15.07.2033            | 950.171          | 0,53                         |
| 535.000  | T-Mobile USA Inc**                                  | 5,80 % | 15.09.2062            | 516.635          | 0,29                         |
| 1.000.000  | Toronto-Dominion Bank**                             | 4,98 % | 05.04.2027            | 1.003.495        | 0,56                         |
| 290.000  | Uber Technologies Inc*                              | 5,35 % | 15.09.2054            | 269.920          | 0,15                         |
| 240.000  | Union Electric Co*                                  | 5,13 % | 15.03.2055            | 220.087          | 0,12                         |
| 380.000  | Union Pacific Corp*                                 | 3,20 % | 20.05.2041            | 284.677          | 0,16                         |
| 818.880  | United Airlines 2020-1 Class A Pass Through Trust** | 5,88 % | 15.10.2027            | 837.052          | 0,47                         |
| 255.000  | UnitedHealth Group Inc*                             | 5,20 % | 15.04.2063            | 229.573          | 0,13                         |
| 565.000  | US Bancorp**  | 5,38 % | 23.01.2030            | 569.833          | 0,32                         |
| 735.000  | Verizon Communications Inc**                        | 2,36 % | 15.03.2032            | 609.734          | 0,34                         |
| 650.000  | Verizon Communications Inc*                         | 2,65 % | 20.11.2040            | 444.766          | 0,25                         |
| 450.000  | Verizon Communications Inc*                         | 2,85 % | 03.09.2041            | 311.402          | 0,17                         |
| 400.000  | Verizon Communications Inc*                         | 5,50 % | 23.02.2054            | 383.153          | 0,21                         |
| 1.025.000  | Vodafone Group Plc**                                | 5,75 % | 28.06.2054            | 989.533          | 0,55                         |
| 735.000  | Vulcan Materials Co*                                | 4,95 % | 01.12.2029            | 732.985          | 0,41                         |
| 705.000  | Warnermedia Holdings Inc**                          | 4,28 % | 15.03.2032            | 621.438          | 0,35                         |
| 1.275.000  | Warnermedia Holdings Inc**                          | 5,05 % | 15.03.2042            | 1.024.299        | 0,57                         |
| 220.000  | Warnermedia Holdings Inc**                          | 5,14 % | 15.03.2052            | 163.579          | 0,09                         |
| 500.000  | Wells Fargo & Co**                                  | 2,88 % | 30.10.2030            | 451.222          | 0,25                         |
| 300.000  | Wells Fargo & Co**                                  | 3,07 % | 30.04.2041            | 218.418          | 0,12                         |
| 660.000  | Wells Fargo & Co**                                  | 5,21 % | 03.12.2035            | 642.448          | 0,36                         |
| 305.000  | Wells Fargo & Co**                                  | 5,57 % | 25.07.2029            | 309.746          | 0,17                         |

## Global Investment Grade Credit - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|-----------------------|--------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 95,72 % (31. Dezember 2023: 93,78 %) (Fortsetzung)</b> |                       |        |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |                       |        |                       |                    |                              |
| 955.000  | Wells Fargo & Co**    | 6,30 % | 23.10.2029            | 994.129            | 0,55                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |                       |        |                       | <b>114.239.603</b> | <b>63,51</b>                 |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>  |                       |        |                       | <b>172.176.706</b> | <b>95,72</b>                 |
| <b>Anlagen insgesamt</b>   |                       |        |                       | <b>172.176.706</b> | <b>95,72</b>                 |

Devisenterminkontrakte 2,14 % (31. Dezember 2023: 0,00 %)

| Geforderter<br>Betrag  | Zu zahlender<br>Betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei             | Kontrakte | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|------------------------|-----------------------|-------------------------|-----------|--------------------------------------|------------------------------|
| 1.880.665 US\$   | 1.750.000 €            | 16.01.2025            | Citibank NA             | 2         | 67.577                               | 0,04                         |
| 4.698.622 US\$   | 3.611.528 £            | 16.01.2025            | Citibank NA             | 2         | 176.060                              | 0,10                         |
| 1.961.047 US\$   | 2.640.019 CAD          | 16.01.2025            | JPMorgan Chase Bank     | 1         | 124.507                              | 0,07                         |
| 6.117.221 US\$   | 5.625.651 €            | 16.01.2025            | Standard Chartered Bank | 3         | 288.762                              | 0,16                         |
| 843.127 US\$   | 650.000 £              | 16.01.2025            | Standard Chartered Bank | 2         | 29.160                               | 0,02                         |
| 543.484 US\$   | 485.305 €              | 16.01.2025            | UBS AG                  | 1         | 40.683                               | 0,02                         |
| 11.692.356 US\$  | 8.733.617 £            | 16.01.2025            | UBS AG                  | 1         | 755.622                              | 0,42                         |
| 28.780.848 US\$  | 25.827.927 €           | 16.01.2025            | Westpac Banking Corp    | 3         | 2.021.814                            | 1,12                         |
| 7.125.000 US\$   | 5.452.345 £            | 16.01.2025            | Westpac Banking Corp    | 2         | 297.262                              | 0,16                         |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>                                      |                        |                       |                         |           |                                      |                              |
| 762 US\$   | 718 €                  | 16.01.2025            | Standard Chartered Bank | 4         | 18                                   | 0,00                         |
| 703 US\$   | 650 €                  | 16.01.2025            | Westpac Banking Corp    | 3         | 30                                   | 0,00                         |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>                                      |                        |                       |                         |           |                                      |                              |
| 1.829.638 US\$   | 1.422.305 £            | 16.01.2025            | Standard Chartered Bank | 3         | 48.545                               | 0,03                         |
| 537.615 US\$   | 428.185 £              | 16.01.2025            | Westpac Banking Corp    | 5         | 1.417                                | 0,00                         |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ~</b> |                        |                       |                         |           | <b>3.851.457</b>                     | <b>2,14</b>                  |

|  |  |  |  | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|--|--|--------------------|------------------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |  |  |  | <b>176.028.163</b> | <b>97,86</b>                 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (2,05 %) (31. Dezember 2023: (1,28 %))

| Geforderter<br>Betrag           | Zu zahlender<br>Betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei             | Kontrakte | Nicht<br>realisierter<br>Verlust US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|---------------------------------|------------------------|-----------------------|-------------------------|-----------|---------------------------------------|------------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> |                        |                       |                         |           |                                       |                              |
| 178 €                           | 190 US\$               | 16.01.2025            | Standard Chartered Bank | 1         | (6)                                   | (0,00)                       |
| 30.709 €                        | 33.844 US\$            | 16.01.2025            | Westpac Banking Corp    | 3         | (2.028)                               | (0,00)                       |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> |                        |                       |                         |           |                                       |                              |
| 779.745 £                       | 1.014.521 US\$         | 16.01.2025            | Standard Chartered Bank | 2         | (38.079)                              | (0,02)                       |

## Global Investment Grade Credit - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (2,05 %) (31. Dezember 2023: (1,28 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei          | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|----------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen GBP (Fortsetzung)</i>                                    |                     |                  |                      |           |                                 |                      |
| 75.499.961 £   | 98.191.789 US\$     | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp | 12        | (3.646.420)                     | (2,03)               |
| 529.413 US\$   | 423.062 £           | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp | 1         | (369)                           | (0,00)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                      |           | <b>(3.686.902)</b>              | <b>(2,05)</b>        |

|   | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens |
|---|--------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(3.686.902)</b> | <b>(2,05)</b>        |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>172.341.261</b> | <b>95,81</b>         |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>7.529.655</b>   | <b>4,19</b>          |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>179.870.916</b> | <b>100,00</b>        |

| Portfolioanalyse  | US\$               | % des Gesamtvermögens |
|---|--------------------|-----------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 112.311.505        | 61,16                 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden            | 58.145.449         | 31,67                 |
| † Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente  | 1.719.752          | 0,94                  |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente   | 164.555            | 0,09                  |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>172.341.261</b> | <b>93,86</b>          |

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag  | Wertpapierbezeichnung                                      | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 0,52 % (31. Dezember 2023: 2,78 %)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>Euro</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 87.020  | FTA Santander Consumo 4 Class C                            | 2,20 %  | 18.09.2032            | 88.727           | 0,13                         |
| <b>Euro insgesamt</b>   |  |         |                       | <b>88.727</b>    | <b>0,13</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>  |  |         |                       |                  |                              |
| 150.996   | Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 1M2         | 7,33 %  | 25.02.2030            | 155.458          | 0,23                         |
| 108.426   | Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 2M2         | 6,88 %  | 25.08.2030            | 110.661          | 0,16                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>  |  |         |                       | <b>266.119</b>   | <b>0,39</b>                  |
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) insgesamt **</b>                       |  |         |                       | <b>354.846</b>   | <b>0,52</b>                  |
| <b>Unternehmensanleihen 39,60 % (31. Dezember 2023: 41,91 %)</b>                          |  |         |                       |                  |                              |
| <b>Australischer Dollar</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 390.000   | Inter-American Development Bank <sup>*</sup>               | 4,70 %  | 03.10.2030            | 244.422          | 0,36                         |
| 350.000   | International Finance Corp <sup>*</sup>                    | 4,90 %  | 05.12.2034            | 216.698          | 0,32                         |
| <b>Australischer Dollar insgesamt</b>   |  |         |                       | <b>461.120</b>   | <b>0,68</b>                  |
| <b>Euro</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 100.000   | 888 Acquisitions Ltd <sup>**</sup>                         | 7,56 %  | 15.07.2027            | 101.757          | 0,15                         |
| 100.000   | A2A SpA <sup>*</sup>                                       | 5,00 %  | 31.12.2149            | 107.420          | 0,16                         |
| 100.000   | Abertis Infraestructuras Finance BV <sup>*</sup>           | 3,25 %  | 31.12.2149            | 103.363          | 0,15                         |
| 100.000   | Ahlstrom Holding 3 Oy <sup>*</sup>                         | 3,63 %  | 04.02.2028            | 102.478          | 0,15                         |
| 100.000   | Air France-KLM <sup>*</sup>                                | 4,63 %  | 23.05.2029            | 106.918          | 0,16                         |
| 100.000   | Albion Financing 1 Sarl/Aggreko Holdings Inc <sup>**</sup> | 5,25 %  | 15.10.2026            | 104.973          | 0,15                         |
| 100.000   | Alexandrite Monnet UK Holdco Plc <sup>*</sup>              | 10,50 % | 15.05.2029            | 114.148          | 0,17                         |
| 100.000   | Almaviva-The Italian Innovation Co SpA <sup>*</sup>        | 5,00 %  | 30.10.2030            | 105.830          | 0,16                         |
| 100.000   | Altice Financing SA <sup>*</sup>                           | 3,00 %  | 15.01.2028            | 80.287           | 0,12                         |
| 100.000   | Altice France SA <sup>**</sup>                             | 4,13 %  | 15.01.2029            | 78.709           | 0,12                         |
| 100.000   | Amber Finco Plc <sup>*</sup>                               | 6,63 %  | 15.07.2029            | 109.873          | 0,16                         |
| 100.000   | American Tower Corp <sup>*</sup>                           | 0,88 %  | 21.05.2029            | 94.739           | 0,14                         |
| 100.000   | Aramark International Finance Sarl <sup>*</sup>            | 3,13 %  | 01.04.2025            | 103.809          | 0,15                         |
| 100.000   | ArcelorMittal SA <sup>*</sup>                              | 3,50 %  | 13.12.2031            | 102.228          | 0,15                         |
| 100.000   | Arkema SA <sup>*</sup>                                     | 3,50 %  | 12.09.2034            | 102.980          | 0,15                         |
| 100.000   | Ashland Services BV <sup>**</sup>                          | 2,00 %  | 30.01.2028            | 99.351           | 0,15                         |
| 100.000   | Avantor Funding Inc <sup>*</sup>                           | 3,88 %  | 15.07.2028            | 103.657          | 0,15                         |
| 100.000   | Azelis Finance NV <sup>*</sup>                             | 4,75 %  | 25.09.2029            | 107.049          | 0,16                         |
| 100.000   | Balder Finland OYJ <sup>*</sup>                            | 2,00 %  | 18.01.2031            | 93.098           | 0,14                         |
| 200.000   | Banco BPM SpA <sup>*</sup>                                 | 3,88 %  | 09.09.2030            | 211.101          | 0,31                         |
| 100.000   | Banco de Credito Social Cooperativo SA <sup>*</sup>        | 4,13 %  | 03.09.2030            | 106.802          | 0,16                         |
| 61.258  | Banijay SAS <sup>**</sup>                                  | 6,50 %  | 01.03.2026            | 63.751           | 0,09                         |
| 270.000   | Barclays Plc <sup>*</sup>                                  | 0,58 %  | 09.08.2029            | 256.685          | 0,38                         |

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                     | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 39,60 % (31. Dezember 2023: 41,91 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |   |         |                       |                  |                              |
| 100.000  | Barclays Plc*                             | 3,94 %  | 31.01.2036            | 104.360          | 0,15                         |
| 178.000  | BCP V Modular Services Finance Plc**      | 6,75 %  | 30.11.2029            | 167.634          | 0,25                         |
| 100.000  | BE Semiconductor Industries NV**          | 4,50 %  | 15.07.2031            | 108.258          | 0,16                         |
| 100.000  | Becton Dickinson & Co*                    | 3,83 %  | 07.06.2032            | 106.641          | 0,16                         |
| 100.000  | Belden Inc*                               | 3,38 %  | 15.07.2031            | 100.634          | 0,15                         |
| 100.000  | Benteler International AG*                | 9,38 %  | 15.05.2028            | 109.531          | 0,16                         |
| 100.000  | Bertrand Franchise Finance SAS*           | 6,96 %  | 18.07.2030            | 104.591          | 0,15                         |
| 100.000  | Birkenstock Financing Sarl*               | 5,25 %  | 30.04.2029            | 105.351          | 0,15                         |
| 100.000  | BNP Paribas SA*                           | 4,10 %  | 13.02.2034            | 106.587          | 0,16                         |
| 100.000  | Boels Topholding BV**                     | 5,75 %  | 15.05.2030            | 108.570          | 0,16                         |
| 100.000  | Booking Holdings Inc*                     | 3,88 %  | 21.03.2045            | 102.979          | 0,15                         |
| 100.000  | Bubbles Bidco SpA**                       | 6,50 %  | 30.09.2031            | 104.526          | 0,15                         |
| 100.000  | Castellum AB*                             | 3,13 %  | 31.12.2149            | 99.966           | 0,15                         |
| 100.000  | CECONOMY AG*                              | 6,25 %  | 15.07.2029            | 107.527          | 0,16                         |
| 150.000  | Cheplapharm Arzneimittel GmbH**           | 4,38 %  | 15.01.2028            | 144.786          | 0,21                         |
| 100.000  | Cirsa Finance International Sarl*         | 7,88 %  | 31.07.2028            | 110.024          | 0,16                         |
| 100.000  | Clarios Global LP/Clarios US Finance Co** | 4,38 %  | 15.05.2026            | 103.986          | 0,15                         |
| 100.000  | Comcast Corp*                             | 3,55 %  | 26.09.2036            | 104.163          | 0,15                         |
| 100.000  | Constellium SE*                           | 5,38 %  | 15.08.2032            | 105.569          | 0,16                         |
| 100.000  | Coty Inc**                                | 3,88 %  | 15.04.2026            | 104.161          | 0,15                         |
| 100.000  | CPI Property Group SA*                    | 3,75 %  | 31.12.2149            | 92.541           | 0,14                         |
| 100.000  | CPI Property Group SA*                    | 6,00 %  | 27.01.2032            | 104.436          | 0,15                         |
| 100.000  | Crelan SA*                                | 5,38 %  | 30.04.2035            | 109.077          | 0,16                         |
| 100.000  | Crown European Holdings SACA*             | 4,50 %  | 15.01.2030            | 107.611          | 0,16                         |
| 100.000  | CT Investment GmbH*                       | 6,38 %  | 15.04.2030            | 108.347          | 0,16                         |
| 100.000  | CTEC II GmbH**                            | 5,25 %  | 15.02.2030            | 96.053           | 0,14                         |
| 100.000  | EDP SA*                                   | 4,75 %  | 29.05.2054            | 106.398          | 0,16                         |
| 400.000  | Electricite de France SA*                 | 7,50 %  | 31.12.2149            | 458.674          | 0,68                         |
| 100.000  | Elior Group SA*                           | 3,75 %  | 15.07.2026            | 103.023          | 0,15                         |
| 100.000  | Enel SpA*                                 | 4,75 %  | 31.12.2149            | 106.549          | 0,16                         |
| 127.000  | Energia Group Roi Financeco DAC**         | 6,88 %  | 31.07.2028            | 138.244          | 0,20                         |
| 100.000  | Energizer Gamma Acquisition BV**          | 3,50 %  | 30.06.2029            | 100.127          | 0,15                         |
| 100.000  | Ephios Subco 3 Sarl**                     | 7,88 %  | 31.01.2031            | 113.240          | 0,17                         |
| 100.000  | Eroski S Coop*                            | 10,63 % | 30.04.2029            | 113.128          | 0,17                         |
| 59.000   | European Investment Bank*                 | 2,88 %  | 15.10.2031            | 62.424           | 0,09                         |
| 100.000  | Fastighets AB Balder*                     | 2,87 %  | 02.06.2081            | 101.220          | 0,15                         |
| 100.000  | Fedrigoni SpA**                           | 6,13 %  | 15.06.2031            | 104.424          | 0,15                         |
| 100.000  | Fnac Darty SA*                            | 6,00 %  | 01.04.2029            | 108.874          | 0,16                         |
| 100.000  | Forvia SE*                                | 2,38 %  | 15.06.2027            | 98.743           | 0,15                         |

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung             | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|-----------------------------------|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 39,60 % (31. Dezember 2023: 41,91 %) (Fortsetzung)</b> |                                   |         |                       |                  |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |                                   |         |                       |                  |                              |
| 100.000  | Forvia SE*                        | 5,13 %  | 15.06.2029            | 104.016          | 0,15                         |
| 100.000  | Grifols SA*                       | 3,88 %  | 15.10.2028            | 93.925           | 0,14                         |
| 100.000  | Gruenthal GmbH**                  | 4,13 %  | 15.05.2028            | 104.352          | 0,15                         |
| 100.000  | Guala Closures SpA*               | 3,25 %  | 15.06.2028            | 100.253          | 0,15                         |
| 100.000  | Heimstaden Bostad AB*             | 3,00 %  | 31.12.2149            | 95.309           | 0,14                         |
| 100.000  | Heimstaden Bostad Treasury BV*    | 1,38 %  | 24.07.2028            | 95.594           | 0,14                         |
| 100.000  | Heimstaden Bostad Treasury BV*    | 1,63 %  | 13.10.2031            | 88.461           | 0,13                         |
| 100.000  | IHO Verwaltungs GmbH*             | 7,00 %  | 15.11.2031            | 106.331          | 0,16                         |
| 100.000  | Iliad Holding SASU**              | 5,63 %  | 15.10.2028            | 106.410          | 0,16                         |
| 100.000  | INEOS Finance Plc*                | 6,38 %  | 15.04.2029            | 109.038          | 0,16                         |
| 100.000  | INEOS Quattro Finance 2 Plc*      | 8,50 %  | 15.03.2029            | 111.313          | 0,16                         |
| 100.000  | ING Groep NV*                     | 2,00 %  | 22.03.2030            | 103.483          | 0,15                         |
| 100.000  | Islandsbanki HF*                  | 4,63 %  | 27.03.2028            | 107.628          | 0,16                         |
| 100.000  | Italmatch Chemicals SpA*          | 10,00 % | 06.02.2028            | 109.919          | 0,16                         |
| 100.000  | Jaguar Land Rover Automotive Plc* | 4,50 %  | 15.07.2028            | 104.701          | 0,15                         |
| 100.000  | JPMorgan Chase & Co*              | 3,76 %  | 21.03.2034            | 106.375          | 0,16                         |
| 100.000  | Koninklijke KPN NV*               | 6,00 %  | 31.12.2149            | 110.533          | 0,16                         |
| 59.000   | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau*  | 0,00 %  | 15.06.2026            | 59.155           | 0,09                         |
| 21.000   | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau*  | 0,00 %  | 15.09.2031            | 18.444           | 0,03                         |
| 27.000   | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau*  | 0,01 %  | 05.05.2027            | 26.554           | 0,04                         |
| 18.000   | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau** | 0,38 %  | 09.03.2026            | 18.252           | 0,03                         |
| 47.000   | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau*  | 0,75 %  | 28.06.2028            | 46.125           | 0,07                         |
| 32.000   | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau*  | 0,75 %  | 15.01.2029            | 31.076           | 0,05                         |
| 98.000   | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau*  | 1,25 %  | 30.06.2027            | 99.047           | 0,15                         |
| 22.000   | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau*  | 2,50 %  | 15.10.2031            | 22.856           | 0,03                         |
| 28.000   | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau*  | 2,75 %  | 15.03.2028            | 29.401           | 0,04                         |
| 68.000   | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau*  | 2,88 %  | 28.12.2029            | 71.790           | 0,11                         |
| 100.000  | Kronos International Inc**        | 9,50 %  | 15.03.2029            | 114.224          | 0,17                         |
| 100.000  | Landsbankinn HF*                  | 3,75 %  | 08.10.2029            | 103.942          | 0,15                         |
| 60.484   | LHMC Finco 2 Sarl*                | 7,25 %  | 02.10.2025            | 62.962           | 0,09                         |
| 200.000  | Lorca Telecom Bondco SA*          | 4,00 %  | 18.09.2027            | 208.135          | 0,31                         |
| 100.000  | Lottomatica Group SpA**           | 5,38 %  | 01.06.2030            | 107.986          | 0,16                         |
| 100.000  | Lottomatica Group SpA**           | 7,13 %  | 01.06.2028            | 109.132          | 0,16                         |
| 100.000  | Loxam SAS*                        | 5,75 %  | 15.07.2027            | 103.795          | 0,15                         |
| 100.000  | Medtronic Inc*                    | 4,15 %  | 15.10.2053            | 107.986          | 0,16                         |
| 100.000  | Morgan Stanley*                   | 3,96 %  | 21.03.2035            | 106.487          | 0,16                         |
| 100.000  | Motability Operations Group Plc*  | 4,00 %  | 17.01.2030            | 107.730          | 0,16                         |
| 100.000  | Motion Finco Sarl**               | 7,38 %  | 15.06.2030            | 105.586          | 0,16                         |
| 100.000  | Multiversity SpA*                 | 7,30 %  | 30.10.2028            | 104.583          | 0,15                         |
| 105.000  | Neopharmed Gentili SpA*           | 7,13 %  | 08.04.2030            | 115.825          | 0,17                         |

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                      | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 39,60 % (31. Dezember 2023: 41,91 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                  |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |  |        |                       |                  |                              |
| 100.000  | Nexans SA*   | 4,13 % | 29.05.2029            | 106.478          | 0,16                         |
| 100.000  | Nidda Healthcare Holding GmbH**                            | 5,63 % | 21.02.2030            | 107.329          | 0,16                         |
| 99.089   | Nidda Healthcare Holding GmbH**                            | 7,50 % | 21.08.2026            | 106.198          | 0,16                         |
| 100.000  | Norddeutsche Landesbank-Girozentrale*                      | 5,63 % | 23.08.2034            | 107.612          | 0,16                         |
| 100.000  | Odido Group Holding BV**                                   | 5,50 % | 15.01.2030            | 103.240          | 0,15                         |
| 100.000  | Olympus Water US Holding Corp*                             | 3,88 % | 01.10.2028            | 101.463          | 0,15                         |
| 100.000  | Optics Bidco SpA**   | 1,63 % | 18.01.2029            | 96.121           | 0,14                         |
| 100.000  | Optics Bidco SpA*  | 2,38 % | 12.10.2027            | 100.445          | 0,15                         |
| 100.000  | Optics Bidco SpA*  | 7,88 % | 31.07.2028            | 117.244          | 0,17                         |
| 100.000  | Orsted AS*   | 5,13 % | 14.03.2024            | 107.335          | 0,16                         |
| 100.000  | Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara* | 1,88 % | 05.11.2031            | 88.317           | 0,13                         |
| 100.000  | Petroleos Mexicanos*                                       | 4,75 % | 26.02.2029            | 95.782           | 0,14                         |
| 100.000  | PEU Finance Plc*   | 7,25 % | 01.07.2028            | 108.958          | 0,16                         |
| 55.000   | ProGroup AG*   | 5,38 % | 15.04.2031            | 55.794           | 0,08                         |
| 100.000  | Proximus SADP*   | 4,75 % | 31.12.2149            | 103.679          | 0,15                         |
| 100.000  | PVH Corp*  | 4,13 % | 16.07.2029            | 106.897          | 0,16                         |
| 100.000  | Q-Park Holding I BV*                                       | 5,13 % | 01.03.2029            | 107.304          | 0,16                         |
| 100.000  | RAY Financing LLC*   | 6,50 % | 15.07.2031            | 108.713          | 0,16                         |
| 100.000  | Rossini Sarl*  | 6,75 % | 31.12.2029            | 109.993          | 0,16                         |
| 100.000  | Sappi Papier Holding GmbH*                                 | 3,13 % | 15.04.2026            | 103.182          | 0,15                         |
| 100.000  | Schaeffler AG*   | 4,50 % | 28.03.2030            | 104.500          | 0,15                         |
| 100.000  | Southern Co*   | 1,88 % | 15.09.2081            | 97.540           | 0,14                         |
| 200.000  | Southern Gas Networks Plc*                                 | 3,50 % | 16.10.2030            | 207.415          | 0,31                         |
| 100.000  | Stellantis NV*   | 3,50 % | 19.09.2030            | 103.535          | 0,15                         |
| 100.000  | Stellantis NV*   | 4,00 % | 19.03.2034            | 103.292          | 0,15                         |
| 100.000  | Summer BC Holdco B Sarl**                                  | 5,75 % | 31.10.2026            | 103.835          | 0,15                         |
| 100.000  | Swisscom Finance BV*                                       | 3,63 % | 29.11.2036            | 105.663          | 0,16                         |
| 100.000  | Synthomer Plc*   | 7,38 % | 02.05.2029            | 108.587          | 0,16                         |
| 100.000  | TAG Immobilien AG*   | 4,25 % | 04.03.2030            | 105.757          | 0,16                         |
| 87.920   | Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH**                   | 6,00 % | 30.07.2026            | 91.579           | 0,13                         |
| 100.000  | Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH**                   | 5,38 % | 15.07.2029            | 107.362          | 0,16                         |
| 100.000  | Telefonica Europe BV*                                      | 2,88 % | 31.12.2149            | 101.241          | 0,15                         |
| 200.000  | Telefonica Europe BV*                                      | 6,75 % | 31.12.2149            | 233.235          | 0,34                         |
| 100.000  | TenneT Holding BV*   | 0,88 % | 16.06.2035            | 83.321           | 0,12                         |
| 225.000  | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV*             | 4,38 % | 09.05.2030            | 239.808          | 0,35                         |
| 100.000  | Timken Co*   | 4,13 % | 23.05.2034            | 103.736          | 0,15                         |
| 92.700   | TK Elevator Holdco GmbH**                                  | 6,63 % | 15.07.2028            | 96.571           | 0,14                         |
| 100.000  | TK Elevator Midco GmbH**                                   | 4,38 % | 15.07.2027            | 103.807          | 0,15                         |
| 115.000  | Trivium Packaging Finance BV*                              | 3,75 % | 15.08.2026            | 118.657          | 0,17                         |
| 150.000  | UGI International LLC**                                    | 2,50 % | 01.12.2029            | 145.307          | 0,21                         |

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                 | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---------------------------------------|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 39,60 % (31. Dezember 2023: 41,91 %) (Fortsetzung)</b> |                                       |         |                       |                   |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |                                       |         |                       |                   |                              |
| 100.000  | United Group BV**                     | 6,50 %  | 31.10.2031            | 105.895           | 0,16                         |
| 270.000  | Utah Acquisition Sub Inc*             | 3,13 %  | 22.11.2028            | 282.145           | 0,42                         |
| 100.000  | Veolia Environnement SA*              | 2,50 %  | 31.12.2149            | 97.140            | 0,14                         |
| 130.000  | Verisure Holding AB*                  | 5,50 %  | 15.05.2030            | 140.725           | 0,21                         |
| 100.000  | Verisure Midholding AB*               | 5,25 %  | 15.02.2029            | 104.141           | 0,15                         |
| 100.000  | Verizon Communications Inc*           | 3,75 %  | 28.02.2036            | 105.314           | 0,15                         |
| 100.000  | VF Corp*                              | 4,25 %  | 07.03.2029            | 103.938           | 0,15                         |
| 100.000  | Virgin Money UK Plc*                  | 4,00 %  | 18.03.2028            | 106.112           | 0,16                         |
| 100.000  | Vodafone Group Plc*                   | 4,20 %  | 03.10.2078            | 105.647           | 0,16                         |
| 100.000  | Volkswagen Financial Services AG*     | 3,88 %  | 19.11.2031            | 103.904           | 0,15                         |
| 100.000  | Volkswagen International Finance NV*  | 3,88 %  | 31.12.2149            | 96.876            | 0,14                         |
| 100.000  | Walgreens Boots Alliance Inc*         | 2,13 %  | 20.11.2026            | 100.130           | 0,15                         |
| 200.000  | Warnermedia Holdings Inc*             | 4,69 %  | 17.05.2033            | 207.377           | 0,31                         |
| 100.000  | Westlake Corp*                        | 1,63 %  | 17.07.2029            | 97.098            | 0,14                         |
| 100.000  | Wintershall Dea Finance 2 BV*         | 3,00 %  | 31.12.2149            | 96.302            | 0,14                         |
| 100.000  | ZF Europe Finance BV*                 | 4,75 %  | 31.01.2029            | 101.125           | 0,15                         |
| 100.000  | ZF Finance GmbH*                      | 3,75 %  | 21.09.2028            | 98.713            | 0,15                         |
| 200.000  | Ziggo Bond Co BV*                     | 3,38 %  | 28.02.2030            | 189.570           | 0,28                         |
| <b>Euro insgesamt</b>  |                                       |         |                       | <b>17.491.681</b> | <b>25,76</b>                 |
| <b>Britisches Pfund</b>  |                                       |         |                       |                   |                              |
| 53.180   | AA Bond Co Ltd*                       | 6,50 %  | 31.01.2026            | 66.770            | 0,10                         |
| 194.000  | AA Bond Co Ltd*                       | 6,85 %  | 31.07.2031            | 248.635           | 0,37                         |
| 100.000  | B&M European Value Retail SA*         | 8,13 %  | 15.11.2030            | 133.866           | 0,20                         |
| 142.000  | Barclays Plc*                         | 5,85 %  | 21.03.2035            | 179.493           | 0,26                         |
| 100.000  | Bellis Acquisition Co Plc**           | 8,13 %  | 14.05.2030            | 121.757           | 0,18                         |
| 100.000  | British Telecommunications Plc*       | 8,38 %  | 20.12.2083            | 134.320           | 0,20                         |
| 100.000  | Co-operative Group Holdings 2011 Ltd* | 7,50 %  | 08.07.2026            | 128.609           | 0,19                         |
| 112.000  | CPUK Finance Ltd**                    | 6,50 %  | 28.08.2026            | 140.455           | 0,21                         |
| 100.000  | Deuce Finco Plc**                     | 5,50 %  | 15.06.2027            | 122.992           | 0,18                         |
| 160.000  | Lloyds Banking Group Plc*             | 2,71 %  | 03.12.2035            | 169.807           | 0,25                         |
| 100.000  | Maison Finco Plc**                    | 6,00 %  | 31.10.2027            | 123.832           | 0,18                         |
| 100.000  | Miller Homes Group Finco Plc**        | 7,00 %  | 15.05.2029            | 122.382           | 0,18                         |
| 600.000  | NGG Finance Plc*                      | 5,63 %  | 18.06.2073            | 753.231           | 1,11                         |
| 200.000  | Pension Insurance Corp Plc*           | 8,00 %  | 13.11.2033            | 269.512           | 0,40                         |
| 100.000  | Pinnacle Bidco Plc*                   | 10,00 % | 11.10.2028            | 133.729           | 0,20                         |
| 100.000  | RAC Bond Co Plc**                     | 5,25 %  | 04.11.2027            | 121.686           | 0,18                         |
| 100.000  | Rothsay Life Plc*                     | 7,02 %  | 10.12.2034            | 128.527           | 0,19                         |
| 100.000  | Severn Trent Utilities Finance Plc*   | 5,88 %  | 31.07.2038            | 127.080           | 0,19                         |
| 100.000  | Travis Perkins Plc*                   | 3,75 %  | 17.02.2026            | 122.735           | 0,18                         |

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 39,60 % (31. Dezember 2023: 41,91 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>Britisches Pfund (Fortsetzung)</b>  |   |         |                       |                  |                              |
| 100.000  | TVL Finance Plc**   | 10,25 % | 28.04.2028            | 130.265          | 0,19                         |
| 150.000  | Virgin Media Secured Finance Plc*   | 4,25 %  | 15.01.2030            | 165.776          | 0,24                         |
| 100.000  | Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC**                                   | 4,88 %  | 15.07.2028            | 117.099          | 0,17                         |
| 100.000  | Volkswagen Financial Services NV*   | 6,50 %  | 18.09.2027            | 128.051          | 0,19                         |
| 200.000  | Wessex Water Services Finance Plc*  | 1,50 %  | 17.09.2029            | 210.186          | 0,31                         |
| 172.000  | Westfield America Management Ltd*   | 2,63 %  | 30.03.2029            | 193.706          | 0,28                         |
| <b>Britisches Pfund insgesamt</b>  |   |         |                       | <b>4.294.501</b> | <b>6,33</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 200.000  | Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC*   | 4,60 %  | 02.11.2047            | 176.303          | 0,26                         |
| 15.000   | Ally Financial Inc**  | 5,54 %  | 17.01.2031            | 14.794           | 0,02                         |
| 40.000   | American Electric Power Co Inc**  | 7,05 %  | 15.12.2054            | 41.543           | 0,06                         |
| 40.000   | Amgen Inc**   | 5,75 %  | 02.03.2063            | 38.396           | 0,06                         |
| 25.000   | Aon North America Inc*  | 5,45 %  | 01.03.2034            | 24.974           | 0,04                         |
| 45.000   | Aon North America Inc*  | 5,75 %  | 01.03.2054            | 43.924           | 0,06                         |
| 60.000   | AT&T Inc**  | 3,50 %  | 15.09.2053            | 40.439           | 0,06                         |
| 80.000   | AT&T Inc*   | 3,65 %  | 01.06.2051            | 56.550           | 0,08                         |
| 60.000   | Bank of America Corp**  | 2,50 %  | 13.02.2031            | 52.778           | 0,08                         |
| 125.000  | Bank of America Corp**  | 2,97 %  | 04.02.2033            | 107.475          | 0,16                         |
| 110.000  | Bank of America Corp**  | 3,71 %  | 24.04.2028            | 107.162          | 0,16                         |
| 145.000  | Barclays Plc*   | 2,85 %  | 07.05.2026            | 143.909          | 0,21                         |
| 80.000   | Brazil Minas SPE via State of Minas Gerais**                                    | 5,33 %  | 15.02.2028            | 79.607           | 0,12                         |
| 65.000   | Broadcom Inc**  | 5,15 %  | 15.11.2031            | 65.439           | 0,10                         |
| 25.000   | CenterPoint Energy Inc**  | 6,70 %  | 15.05.2055            | 24.924           | 0,04                         |
| 130.000  | Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital** | 4,80 %  | 01.03.2050            | 97.788           | 0,14                         |
| 15.000   | Cigna Group*  | 3,20 %  | 15.03.2040            | 11.021           | 0,02                         |
| 70.000   | Citigroup Inc**   | 2,98 %  | 05.11.2030            | 63.162           | 0,09                         |
| 105.000  | Citigroup Inc**   | 3,52 %  | 27.10.2028            | 101.082          | 0,15                         |
| 40.000   | CVS Health Corp**   | 7,00 %  | 10.03.2055            | 40.234           | 0,06                         |
| 20.000   | Diamondback Energy Inc**  | 5,75 %  | 18.04.2054            | 18.785           | 0,03                         |
| 25.000   | Diamondback Energy Inc*   | 6,25 %  | 15.03.2053            | 24.962           | 0,04                         |
| 80.000   | Discovery Communications LLC**  | 3,63 %  | 15.05.2030            | 71.199           | 0,10                         |
| 84.000   | DTE Energy Co*  | 3,40 %  | 15.06.2029            | 78.677           | 0,12                         |
| 20.000   | Duke Energy Corp**  | 6,45 %  | 01.09.2054            | 20.293           | 0,03                         |
| 15.000   | Eastern Energy Gas Holdings LLC*  | 5,65 %  | 15.10.2054            | 14.163           | 0,02                         |
| 200.000  | Empresa de los Ferrocarriles del Estado*  | 3,83 %  | 14.09.2061            | 132.096          | 0,19                         |
| 40.000   | Energy Transfer LP*   | 5,95 %  | 15.05.2054            | 38.695           | 0,06                         |
| 20.000   | EOG Resources Inc*  | 5,65 %  | 01.12.2054            | 19.604           | 0,03                         |
| 25.000   | Every Inc**   | 6,65 %  | 01.06.2055            | 25.055           | 0,04                         |
| 200.000  | Gaci First Investment Co*   | 5,38 %  | 13.10.2122            | 166.720          | 0,24                         |

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung        | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|------------------------------|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 39,60 % (31. Dezember 2023: 41,91 %) (Fortsetzung)</b> |                              |        |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |                              |        |                       |                   |                              |
| 130.000  | Goldman Sachs Group Inc**    | 2,62 % | 22.04.2032            | 110.829           | 0,16                         |
| 85.000   | Goldman Sachs Group Inc**    | 3,69 % | 05.06.2028            | 82.582            | 0,12                         |
| 105.000  | Goldman Sachs Group Inc**    | 3,81 % | 23.04.2029            | 101.040           | 0,15                         |
| 80.000   | HCA Inc*                     | 5,25 % | 15.06.2049            | 69.316            | 0,10                         |
| 40.000   | Intel Corp**                 | 4,75 % | 25.03.2050            | 30.957            | 0,04                         |
| 10.000   | Intel Corp**                 | 4,90 % | 05.08.2052            | 7.902             | 0,01                         |
| 5.000  | Intel Corp**                 | 5,70 % | 10.02.2053            | 4.425             | 0,01                         |
| 60.000   | JPMorgan Chase & Co**        | 2,96 % | 13.05.2031            | 53.693            | 0,08                         |
| 50.000   | JPMorgan Chase & Co**        | 3,11 % | 22.04.2041            | 37.091            | 0,05                         |
| 200.000  | KazMunayGas National Co JSC* | 5,38 % | 24.04.2030            | 194.944           | 0,29                         |
| 15.000   | Las Vegas Sands Corp*        | 6,20 % | 15.08.2034            | 15.092            | 0,02                         |
| 240.000  | Lloyds Banking Group Plc*    | 3,51 % | 18.03.2026            | 239.167           | 0,35                         |
| 55.000   | Marathon Petroleum Corp**    | 4,70 % | 01.05.2025            | 54.947            | 0,08                         |
| 135.000  | Morgan Stanley**             | 2,70 % | 22.01.2031            | 119.995           | 0,18                         |
| 60.000   | Morgan Stanley*              | 3,63 % | 20.01.2027            | 58.919            | 0,09                         |
| 55.000   | Morgan Stanley**             | 5,25 % | 21.04.2034            | 54.179            | 0,08                         |
| 20.000   | Morgan Stanley**             | 5,83 % | 19.04.2035            | 20.390            | 0,03                         |
| 60.000   | MPLX LP*                     | 4,70 % | 15.04.2048            | 49.238            | 0,07                         |
| 95.000   | Oracle Corp*                 | 4,00 % | 15.07.2046            | 73.183            | 0,11                         |
| 39.622   | Pacific Gas & Electric Co**  | 4,95 % | 01.07.2050            | 34.453            | 0,05                         |
| 1.360.000  | Petroleos de Venezuela SA*   | 5,38 % | 12.04.2027            | 148.240           | 0,22                         |
| 200.000  | Petroleos del Peru SA*       | 5,63 % | 19.06.2047            | 128.363           | 0,19                         |
| 249.000  | Petroleos Mexicanos**        | 7,69 % | 23.01.2050            | 188.047           | 0,28                         |
| 55.000   | Rogers Communications Inc**  | 3,80 % | 15.03.2032            | 49.486            | 0,07                         |
| 20.000   | Sempra**                     | 6,40 % | 01.10.2054            | 19.881            | 0,03                         |
| 48.000   | Sysco Corp*                  | 6,60 % | 01.04.2050            | 52.698            | 0,08                         |
| 35.000   | The Campbell's Co**          | 5,40 % | 21.03.2034            | 34.847            | 0,05                         |
| 95.000   | T-Mobile USA Inc**           | 4,50 % | 15.04.2050            | 77.990            | 0,11                         |
| 50.000   | Uber Technologies Inc*       | 5,35 % | 15.09.2054            | 46.538            | 0,07                         |
| 235.000  | Verizon Communications Inc*  | 2,55 % | 21.03.2031            | 202.473           | 0,30                         |
| 15.000   | Verizon Communications Inc*  | 5,50 % | 23.02.2054            | 14.368            | 0,02                         |
| 80.000   | Vodafone Group Plc**         | 4,88 % | 19.06.2049            | 69.014            | 0,10                         |
| 55.000   | Vodafone Group Plc**         | 5,75 % | 28.06.2054            | 53.097            | 0,08                         |
| 15.000   | Vulcan Materials Co*         | 5,70 % | 01.12.2054            | 14.578            | 0,02                         |
| 190.000  | Warnermedia Holdings Inc**   | 5,05 % | 15.03.2042            | 152.641           | 0,22                         |
| 30.000   | Wells Fargo & Co**           | 6,49 % | 23.10.2034            | 31.902            | 0,05                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |                              |        |                       | <b>4.638.258</b>  | <b>6,83</b>                  |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>  |                              |        |                       | <b>26.885.560</b> | <b>39,60</b>                 |

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                              | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 29,55 % (31. Dezember 2023: 32,31 %)</b> |  |        |                       |                  |                              |
| <b>Australischer Dollar</b>                                |  |        |                       |                  |                              |
| 136.000  | New Zealand Local Government Funding Agency Bond** | 5,00 % | 08.03.2034            | 83.783           | 0,12                         |
| 350.000  | New Zealand Local Government Funding Agency Bond** | 5,10 % | 28.11.2030            | 220.761          | 0,33                         |
| 150.000  | Province of British Columbia Canada*               | 5,25 % | 23.05.2034            | 94.065           | 0,14                         |
| 160.000  | Province of Manitoba Canada*                       | 4,85 % | 28.08.2034            | 97.134           | 0,14                         |
| 310.000  | Queensland Treasury Corp*                          | 4,50 % | 09.03.2033            | 187.319          | 0,28                         |
| 118.000  | South Australian Government Financing Authority*   | 1,75 % | 24.05.2034            | 54.989           | 0,08                         |
| 170.000  | Western Australian Treasury Corp**                 | 4,50 % | 21.07.2032            | 104.007          | 0,15                         |
| <b>Australischer Dollar insgesamt</b>                      |  |        |                       | <b>842.058</b>   | <b>1,24</b>                  |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi</b>                          |  |        |                       |                  |                              |
| 5.980.000  | China Government Bond**                            | 2,88 % | 25.02.2033            | 893.826          | 1,32                         |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt</b>                |  |        |                       | <b>893.826</b>   | <b>1,32</b>                  |
| <b>Tschechische Krone</b>                                  |  |        |                       |                  |                              |
| 8.340.000  | Czech Republic Government Bond*                    | 4,50 % | 11.11.2032            | 353.183          | 0,52                         |
| 21.830.000   | Czech Republic Government Bond*                    | 4,90 % | 14.04.2034            | 955.262          | 1,41                         |
| <b>Tschechische Krone insgesamt</b>                        |  |        |                       | <b>1.308.445</b> | <b>1,93</b>                  |
| <b>Euro</b>  |  |        |                       |                  |                              |
| 100.000  | Andorra International Bond*                        | 1,25 % | 23.02.2027            | 100.063          | 0,15                         |
| 20.000   | Autonomous Community of Madrid Spain*              | 3,46 % | 30.04.2034            | 21.269           | 0,03                         |
| 100.000  | Bank Gospodarstwa Krajowego*                       | 3,88 % | 13.03.2035            | 103.443          | 0,15                         |
| 7.000  | Bulgaria Government International Bond*            | 3,63 % | 05.09.2032            | 7.426            | 0,01                         |
| 8.000  | Bulgaria Government International Bond*            | 4,38 % | 13.05.2031            | 8.882            | 0,01                         |
| 47.279   | Bundesobligation*                                  | 2,10 % | 12.04.2029            | 49.139           | 0,07                         |
| 80.000   | Bundesobligation*                                  | 2,40 % | 19.10.2028            | 84.191           | 0,12                         |
| 85.000   | Bundesobligation*                                  | 2,50 % | 11.10.2029            | 89.765           | 0,13                         |
| 28.767   | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*          | 0,00 % | 15.08.2030            | 26.660           | 0,04                         |
| 34.595   | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*          | 0,00 % | 15.02.2031            | 31.656           | 0,05                         |
| 18.582   | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*          | 0,00 % | 15.08.2031            | 16.800           | 0,02                         |
| 31.500   | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*          | 0,00 % | 15.08.2052            | 16.401           | 0,02                         |
| 162.529  | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*          | 0,50 % | 15.02.2026            | 165.396          | 0,24                         |
| 262.395  | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*          | 1,70 % | 15.08.2032            | 263.064          | 0,39                         |
| 100.000  | Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale*        | 1,50 % | 25.05.2032            | 93.309           | 0,14                         |
| 140.000  | Egypt Government International Bond*               | 6,38 % | 11.04.2031            | 128.329          | 0,19                         |
| 47.000   | European Union*                                    | 2,00 % | 04.10.2027            | 48.318           | 0,07                         |
| 30.000   | European Union*                                    | 2,50 % | 04.12.2031            | 30.764           | 0,05                         |
| 129.000  | European Union*                                    | 3,00 % | 04.12.2034            | 134.578          | 0,20                         |

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                      | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 29,55 % (31. Dezember 2023: 32,31 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                  |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |  |        |                       |                  |                              |
| 4.800  | European Union*                            | 3,00 % | 04.03.2053            | 4.643            | 0,01                         |
| 4.000  | European Union*                            | 3,38 % | 04.10.2039            | 4.223            | 0,01                         |
| 12.000   | European Union*                            | 4,00 % | 04.04.2044            | 13.590           | 0,02                         |
| 215.000  | French Republic Government Bond OAT**      | 0,00 % | 25.11.2031            | 183.056          | 0,27                         |
| 78.273   | French Republic Government Bond OAT*       | 0,10 % | 01.03.2028            | 79.053           | 0,12                         |
| 12.000   | French Republic Government Bond OAT*       | 0,50 % | 25.05.2072            | 4.276            | 0,01                         |
| 20.000   | French Republic Government Bond OAT*       | 0,75 % | 25.02.2028            | 19.747           | 0,03                         |
| 266.000  | French Republic Government Bond OAT*       | 0,75 % | 25.05.2053            | 137.298          | 0,20                         |
| 330.000  | French Republic Government Bond OAT*       | 1,25 % | 25.05.2038            | 264.925          | 0,39                         |
| 197.000  | French Republic Government Bond OAT*       | 2,50 % | 25.05.2043            | 176.230          | 0,26                         |
| 77.000   | French Republic Government Bond OAT*       | 3,00 % | 25.11.2034            | 78.720           | 0,12                         |
| 4.000  | Hungary Government International Bond*     | 1,75 % | 05.06.2035            | 3.289            | 0,00                         |
| 100.000  | Indonesia Government International Bond*   | 1,40 % | 30.10.2031            | 90.333           | 0,13                         |
| 21.000   | Ireland Government Bond**                  | 0,20 % | 18.10.2030            | 19.202           | 0,03                         |
| 35.000   | Ireland Government Bond*                   | 0,55 % | 22.04.2041            | 25.575           | 0,04                         |
| 23.000   | Ireland Government Bond*                   | 2,40 % | 15.05.2030            | 23.893           | 0,03                         |
| 8.400  | Ireland Government Bond*                   | 3,00 % | 18.10.2043            | 8.850            | 0,01                         |
| 32.000   | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**        | 0,50 % | 15.07.2028            | 30.978           | 0,05                         |
| 53.000   | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*         | 0,90 % | 01.04.2031            | 48.462           | 0,07                         |
| 94.000   | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*         | 0,95 % | 15.09.2027            | 93.977           | 0,14                         |
| 20.000   | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**        | 0,95 % | 01.06.2032            | 17.793           | 0,03                         |
| 31.000   | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**        | 1,20 % | 15.08.2025            | 32.028           | 0,05                         |
| 30.021   | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**        | 1,40 % | 26.05.2025            | 31.034           | 0,05                         |
| 5.000  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*         | 1,45 % | 01.03.2036            | 4.201            | 0,01                         |
| 15.009   | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**        | 1,60 % | 22.11.2028            | 15.421           | 0,02                         |
| 11.000   | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**        | 1,85 % | 01.07.2025            | 11.417           | 0,02                         |
| 13.042   | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*         | 2,00 % | 14.03.2028            | 13.564           | 0,02                         |
| 26.000   | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**        | 3,00 % | 01.10.2029            | 27.222           | 0,04                         |
| 186.000  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**        | 3,15 % | 15.11.2031            | 193.166          | 0,28                         |
| 118.000  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*         | 3,40 % | 28.03.2025            | 122.996          | 0,18                         |
| 20.000   | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**        | 3,45 % | 15.07.2027            | 21.287           | 0,03                         |
| 23.000   | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*         | 3,70 % | 15.06.2030            | 24.680           | 0,04                         |
| 22.000   | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**        | 3,85 % | 01.02.2035            | 23.546           | 0,03                         |
| 25.000   | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**        | 4,05 % | 30.10.2037            | 27.071           | 0,04                         |
| 18.000   | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**        | 4,15 % | 01.10.2039            | 19.394           | 0,03                         |
| 8.000  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**        | 4,30 % | 01.10.2054            | 8.503            | 0,01                         |
| 49.000   | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*         | 4,35 % | 01.11.2033            | 54.774           | 0,08                         |
| 110.000  | Ivory Coast Government International Bond* | 5,88 % | 17.10.2031            | 107.112          | 0,16                         |
| 100.000  | Ivory Coast Government International Bond* | 6,63 % | 22.03.2048            | 83.890           | 0,12                         |
| 23.128   | Kingdom of Belgium Government Bond*        | 0,40 % | 22.06.2040            | 15.711           | 0,02                         |

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                             | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 29,55 % (31. Dezember 2023: 32,31 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |   |        |                       |                  |                              |
| 18.000   | Kingdom of Belgium Government Bond*               | 3,75 % | 22.06.2045            | 19.538           | 0,03                         |
| 100.000  | Magyar Export-Import Bank Zrt*                    | 6,00 % | 16.05.2029            | 112.181          | 0,17                         |
| 100.000  | Philippine Government International Bond*         | 1,75 % | 28.04.2041            | 74.952           | 0,11                         |
| 31.129   | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT*                | 1,65 % | 16.07.2032            | 30.361           | 0,04                         |
| 217.000  | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT*                | 2,88 % | 15.10.2025            | 225.730          | 0,33                         |
| 35.000   | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT**               | 2,88 % | 21.07.2026            | 36.723           | 0,05                         |
| 29.000   | Republic of Poland Government International Bond* | 3,13 % | 22.10.2031            | 30.296           | 0,04                         |
| 23.000   | Republic of Poland Government International Bond* | 3,88 % | 22.10.2039            | 24.034           | 0,04                         |
| 123.000  | Romanian Government International Bond*           | 2,00 % | 28.01.2032            | 101.703          | 0,15                         |
| 37.000   | Romanian Government International Bond*           | 3,75 % | 07.02.2034            | 32.986           | 0,05                         |
| 22.000   | Romanian Government International Bond*           | 3,88 % | 29.10.2035            | 18.926           | 0,03                         |
| 17.000   | Romanian Government International Bond*           | 5,13 % | 24.09.2031            | 17.273           | 0,03                         |
| 19.000   | Romanian Government International Bond*           | 5,25 % | 30.05.2032            | 19.348           | 0,03                         |
| 15.000   | Romanian Government International Bond*           | 6,38 % | 18.09.2033            | 16.215           | 0,02                         |
| 23.000   | Romanian Government International Bond*           | 6,63 % | 27.09.2029            | 25.752           | 0,04                         |
| 18.300   | Slovakia Government Bond*                         | 0,38 % | 21.04.2036            | 13.521           | 0,02                         |
| 36.000   | Slovakia Government Bond*                         | 3,75 % | 06.03.2034            | 38.462           | 0,06                         |
| 12.000   | Slovakia Government Bond*                         | 3,75 % | 23.02.2035            | 12.793           | 0,02                         |
| 17.000   | Slovenia Government Bond*                         | 3,00 % | 10.03.2034            | 17.630           | 0,03                         |
| 14.000   | Spain Government Bond*                            | 1,40 % | 30.04.2028            | 14.107           | 0,02                         |
| 35.000   | Spain Government Bond*                            | 1,45 % | 31.10.2027            | 35.528           | 0,05                         |
| 35.000   | Spain Government Bond*                            | 3,15 % | 30.04.2033            | 37.041           | 0,05                         |
| 19.000   | Spain Government Bond*                            | 3,55 % | 31.10.2033            | 20.613           | 0,03                         |
| 28.000   | Spain Government Bond*                            | 4,00 % | 31.10.2054            | 30.639           | 0,04                         |
| 30.000   | State of North Rhine-Westphalia Germany*          | 0,13 % | 04.06.2031            | 26.588           | 0,04                         |
| 70.000   | State of North Rhine-Westphalia Germany*          | 1,45 % | 16.02.2043            | 55.484           | 0,08                         |
| 12.000   | State of North Rhine-Westphalia Germany*          | 1,65 % | 22.02.2038            | 10.669           | 0,02                         |
| <b>Euro insgesamt</b>  |   |        |                       | <b>4.683.676</b> | <b>6,90</b>                  |
| <b>Ungarischer Forint</b>  |   |        |                       |                  |                              |
| 108.060.000  | Hungary Government Bond*                          | 4,75 % | 24.11.2032            | 242.808          | 0,36                         |
| 236.820.000  | Hungary Government Bond*                          | 7,00 % | 24.10.2035            | 615.723          | 0,90                         |
| <b>Ungarischer Forint insgesamt</b>                                      |   |        |                       | <b>858.531</b>   | <b>1,26</b>                  |
| <b>Indonesische Rupiah</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 5.237.000.000  | Indonesia Treasury Bond*                          | 6,38 % | 15.04.2032            | 310.636          | 0,46                         |
| 16.026.000.000   | Indonesia Treasury Bond*                          | 6,63 % | 15.02.2034            | 969.640          | 1,43                         |
| 10.865.000.000   | Indonesia Treasury Bond*                          | 7,00 % | 15.02.2033            | 673.463          | 0,99                         |
| <b>Indonesische Rupiah insgesamt</b>                                     |   |        |                       | <b>1.953.739</b> | <b>2,88</b>                  |

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                             | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 29,55 % (31. Dezember 2023: 32,31 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>Japanischer Yen</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 116.250.000  | Japan Government Ten Year Bond*                   | 0,80 % | 20.03.2034            | 724.548          | 1,07                         |
| 46.650.000   | Japan Government Thirty Year Bond*                | 2,20 % | 20.06.2054            | 293.652          | 0,43                         |
| <b>Japanischer Yen insgesamt</b>   |   |        |                       | <b>1.018.200</b> | <b>1,50</b>                  |
| <b>Mexikanischer Peso</b>  |   |        |                       |                  |                              |
| 33.100.000   | Mexican Bonos*                                    | 7,50 % | 26.05.2033            | 1.346.557        | 1,98                         |
| 12.260.000   | Mexican Bonos*                                    | 7,75 % | 29.05.2031            | 526.332          | 0,78                         |
| 20.700.000   | Mexican Bonos*                                    | 7,75 % | 23.11.2034            | 833.446          | 1,23                         |
| <b>Mexikanischer Peso insgesamt</b>                                      |   |        |                       | <b>2.706.335</b> | <b>3,99</b>                  |
| <b>Neuseeländischer Dollar</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 1.090.000  | New Zealand Government Bond*                      | 3,50 % | 14.04.2033            | 574.212          | 0,84                         |
| 650.000  | New Zealand Government Bond*                      | 4,25 % | 15.05.2036            | 351.912          | 0,52                         |
| 255.000  | New Zealand Local Government Funding Agency Bond* | 4,50 % | 14.05.2032            | 141.414          | 0,21                         |
| <b>Neuseeländischer Dollar insgesamt</b>                                 |   |        |                       | <b>1.067.538</b> | <b>1,57</b>                  |
| <b>Britisches Pfund</b>  |   |        |                       |                  |                              |
| 296.972  | United Kingdom Gilt*                              | 1,25 % | 31.07.2051            | 166.445          | 0,24                         |
| 348.000  | United Kingdom Gilt*                              | 4,13 % | 22.07.2029            | 431.830          | 0,64                         |
| 66.000   | United Kingdom Gilt*                              | 4,63 % | 31.01.2034            | 82.952           | 0,12                         |
| <b>Britisches Pfund insgesamt</b>  |   |        |                       | <b>681.227</b>   | <b>1,00</b>                  |
| <b>Südkoreanischer Won</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 308.330.000  | Korea Treasury Bond*                              | 4,25 % | 10.12.2032            | 226.728          | 0,33                         |
| <b>Südkoreanischer Won insgesamt</b>                                     |   |        |                       | <b>226.728</b>   | <b>0,33</b>                  |
| <b>Thailändischer Baht</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 9.569.000  | Thailand Government Bond**                        | 2,00 % | 17.12.2031            | 277.263          | 0,41                         |
| <b>Thailändischer Baht insgesamt</b>                                     |   |        |                       | <b>277.263</b>   | <b>0,41</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 86.400   | Argentine Republic Government International Bond* | 0,75 % | 09.07.2030            | 66.804           | 0,10                         |
| 30.000   | Argentine Republic Government International Bond* | 1,00 % | 09.07.2029            | 24.435           | 0,04                         |
| 170.000  | Argentine Republic Government International Bond* | 4,13 % | 09.07.2035            | 113.161          | 0,17                         |
| 200.000  | Colombia Government International Bond*           | 6,13 % | 18.01.2041            | 163.866          | 0,24                         |
| 200.000  | Costa Rica Government International Bond*         | 6,55 % | 03.04.2034            | 203.725          | 0,30                         |
| 160.000  | Dominican Republic International Bond*            | 4,88 % | 23.09.2032            | 143.200          | 0,21                         |
| 14.629   | Ecuador Government International Bond*            | 0,00 % | 31.07.2030            | 8.032            | 0,01                         |
| 3.972  | Ecuador Government International Bond*            | 5,00 % | 31.07.2040            | 2.050            | 0,00                         |
| 78.271   | Ecuador Government International Bond*            | 5,50 % | 31.07.2035            | 44.650           | 0,07                         |

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 29,55 % (31. Dezember 2023: 32,31 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |        |                       |                   |                              |
| 47.207   | Ecuador Government International Bond*                  | 6,90 % | 31.07.2030            | 32.992            | 0,05                         |
| 117.000  | El Salvador Government International Bond*              | 7,65 % | 15.06.2035            | 113.402           | 0,17                         |
| 6.400  | Ghana Government International Bond*                    | 0,00 % | 03.07.2026            | 5.963             | 0,01                         |
| 9.908  | Ghana Government International Bond*                    | 0,00 % | 03.01.2030            | 7.700             | 0,01                         |
| 48.400   | Ghana Government International Bond*                    | 5,00 % | 03.07.2029            | 41.921            | 0,06                         |
| 69.600   | Ghana Government International Bond*                    | 5,00 % | 03.07.2035            | 49.113            | 0,07                         |
| 112.000  | Lebanon Government International Bond*                  | 6,38 % | 09.03.2020            | 14.532            | 0,02                         |
| 108.000  | Lebanon Government International Bond*                  | 6,65 % | 26.02.2030            | 14.079            | 0,02                         |
| 62.000   | Lebanon Government International Bond*                  | 8,25 % | 17.05.2034            | 8.064             | 0,01                         |
| 80.000   | Mexico Government International Bond*                   | 5,75 % | 12.10.2110            | 61.528            | 0,09                         |
| 200.000  | Nigeria Government International Bond*                  | 8,38 % | 24.03.2029            | 194.695           | 0,29                         |
| 11.561   | Provincia de Buenos Aires*                              | 6,63 % | 01.09.2037            | 7.737             | 0,01                         |
| 200.000  | Republic of South Africa Government International Bond* | 7,30 % | 20.04.2052            | 181.631           | 0,27                         |
| 20.718   | Sri Lanka Government International Bond*                | 3,10 % | 15.01.2030            | 17.196            | 0,02                         |
| 40.638   | Sri Lanka Government International Bond*                | 3,35 % | 15.03.2033            | 30.938            | 0,05                         |
| 27.440   | Sri Lanka Government International Bond*                | 3,60 % | 15.06.2035            | 19.894            | 0,03                         |
| 19.044   | Sri Lanka Government International Bond*                | 3,60 % | 15.05.2036            | 14.521            | 0,02                         |
| 38.104   | Sri Lanka Government International Bond*                | 3,60 % | 15.02.2038            | 29.199            | 0,04                         |
| 26.241   | Sri Lanka Government International Bond*                | 4,00 % | 15.04.2028            | 24.635            | 0,04                         |
| 200.000  | Turkiye Ihracat Kredi Bankasi AS**                      | 7,50 % | 06.02.2028            | 204.034           | 0,30                         |
| 3.939  | Ukraine Government International Bond*                  | 0,00 % | 01.02.2030            | 2.163             | 0,00                         |
| 14.719   | Ukraine Government International Bond*                  | 0,00 % | 01.02.2034            | 6.127             | 0,01                         |
| 12.439   | Ukraine Government International Bond*                  | 0,00 % | 01.02.2035            | 7.376             | 0,01                         |
| 10.365   | Ukraine Government International Bond*                  | 0,00 % | 01.02.2036            | 6.114             | 0,01                         |
| 36.055   | Ukraine Government International Bond*                  | 1,75 % | 01.02.2034            | 20.416            | 0,03                         |
| 21.633   | Ukraine Government International Bond*                  | 1,75 % | 01.02.2035            | 11.946            | 0,02                         |
| 14.422   | Ukraine Government International Bond*                  | 1,75 % | 01.02.2036            | 7.851             | 0,01                         |
| 284.000  | United States Treasury Note/Bond*                       | 3,50 % | 30.09.2029            | 273.441           | 0,40                         |
| 656.000  | United States Treasury Note/Bond*                       | 3,63 % | 30.09.2031            | 623.525           | 0,92                         |
| 526.000  | United States Treasury Note/Bond*                       | 3,88 % | 15.08.2034            | 497.518           | 0,73                         |
| 106.000  | United States Treasury Note/Bond*                       | 4,50 % | 15.02.2044            | 101.207           | 0,15                         |
| 92.228   | Zambia Government International Bond*                   | 0,50 % | 31.12.2053            | 52.942            | 0,08                         |
| 98.240   | Zambia Government International Bond*                   | 5,75 % | 30.06.2033            | 86.373            | 0,13                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |   |        |                       | <b>3.540.696</b>  | <b>5,22</b>                  |
| <b>Staatsanleihen insgesamt</b>  |   |        |                       | <b>20.058.262</b> | <b>29,55</b>                 |
| <b>Mortgage-Backed Securities 16,97 % (31. Dezember 2023: 22,27 %)</b>   |   |        |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |   |        |                       |                   |                              |
| 33.005   | Fannie Mae Pool   | 2,50 % | 01.07.2050            | 27.262            | 0,04                         |
| 159.670  | Fannie Mae Pool   | 2,50 % | 01.09.2051            | 131.241           | 0,19                         |

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung    | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--------------------------|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Mortgage-Backed Securities 16,97 % (31. Dezember 2023: 22,27 %) (Fortsetzung)</b> |                          |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |                          |        |                       |                  |                              |
| 119.952  | Fannie Mae Pool          | 2,50 % | 01.10.2051            | 97.936           | 0,14                         |
| 285.742  | Fannie Mae Pool          | 2,50 % | 01.01.2052            | 233.799          | 0,34                         |
| 455.315  | Fannie Mae Pool          | 2,50 % | 01.03.2052            | 371.966          | 0,55                         |
| 98.257   | Fannie Mae Pool          | 2,50 % | 01.04.2052            | 80.426           | 0,12                         |
| 50.405   | Fannie Mae Pool          | 3,00 % | 01.11.2045            | 43.874           | 0,06                         |
| 42.792   | Fannie Mae Pool          | 3,00 % | 01.08.2046            | 37.140           | 0,06                         |
| 65.180   | Fannie Mae Pool          | 3,00 % | 01.01.2050            | 56.224           | 0,08                         |
| 80.137   | Fannie Mae Pool          | 3,00 % | 01.03.2050            | 69.026           | 0,10                         |
| 69.531   | Fannie Mae Pool          | 3,00 % | 01.04.2050            | 59.890           | 0,09                         |
| 43.723   | Fannie Mae Pool          | 3,00 % | 01.07.2051            | 37.324           | 0,06                         |
| 90.638   | Fannie Mae Pool          | 3,00 % | 01.05.2052            | 77.226           | 0,11                         |
| 33.483   | Fannie Mae Pool          | 3,50 % | 01.03.2047            | 30.064           | 0,04                         |
| 53.393   | Fannie Mae Pool          | 3,50 % | 01.09.2047            | 47.942           | 0,07                         |
| 66.199   | Fannie Mae Pool          | 3,50 % | 01.02.2048            | 59.439           | 0,09                         |
| 167.011  | Fannie Mae Pool          | 4,00 % | 01.04.2052            | 153.140          | 0,23                         |
| 74.817   | Fannie Mae Pool          | 4,00 % | 01.07.2052            | 68.574           | 0,10                         |
| 230.425  | Fannie Mae Pool          | 4,50 % | 01.09.2052            | 217.255          | 0,32                         |
| 400.840  | Fannie Mae Pool          | 4,50 % | 01.10.2052            | 377.944          | 0,56                         |
| 216.367  | Fannie Mae Pool          | 4,50 % | 01.01.2053            | 203.748          | 0,30                         |
| 120.654  | Fannie Mae Pool          | 5,00 % | 01.08.2052            | 116.915          | 0,17                         |
| 65.952   | Fannie Mae Pool          | 5,00 % | 01.11.2052            | 63.857           | 0,09                         |
| 382.467  | Fannie Mae Pool          | 5,00 % | 01.01.2053            | 370.437          | 0,55                         |
| 384.371  | Fannie Mae Pool          | 5,00 % | 01.04.2053            | 371.271          | 0,55                         |
| 412.401  | Fannie Mae Pool          | 5,50 % | 01.01.2053            | 407.408          | 0,60                         |
| 252.940  | Fannie Mae Pool          | 5,50 % | 01.02.2053            | 249.957          | 0,37                         |
| 197.072  | Fannie Mae Pool          | 5,50 % | 01.07.2053            | 194.933          | 0,29                         |
| 143.960  | Fannie Mae Pool          | 5,50 % | 01.01.2054            | 142.194          | 0,21                         |
| 91.450   | Fannie Mae Pool          | 5,50 % | 01.02.2054            | 90.448           | 0,13                         |
| 50.158   | Fannie Mae Pool          | 5,50 % | 01.03.2054            | 49.533           | 0,07                         |
| 88.563   | Fannie Mae Pool          | 6,00 % | 01.12.2052            | 89.159           | 0,13                         |
| 270.515  | Fannie Mae Pool          | 6,00 % | 01.07.2053            | 272.096          | 0,40                         |
| 74.790   | Fannie Mae Pool          | 6,00 % | 01.10.2053            | 75.589           | 0,11                         |
| 56.601   | Fannie Mae Pool          | 6,00 % | 01.08.2054            | 56.963           | 0,08                         |
| 101.278  | Fannie Mae Pool          | 6,50 % | 01.01.2054            | 103.430          | 0,15                         |
| 187.309  | Fannie Mae Pool (CB3349) | 2,50 % | 01.04.2052            | 153.796          | 0,23                         |
| 43.122   | Fannie Mae Pool (MA4599) | 3,00 % | 01.05.2052            | 36.737           | 0,05                         |
| 105.330  | Fannie Mae Pool (MA5072) | 5,50 % | 01.07.2053            | 104.151          | 0,15                         |
| 172.432  | Freddie Mac Pool         | 2,50 % | 01.12.2050            | 140.966          | 0,21                         |
| 75.389   | Freddie Mac Pool         | 2,50 % | 01.08.2051            | 61.960           | 0,09                         |
| 185.626  | Freddie Mac Pool         | 2,50 % | 01.09.2051            | 151.780          | 0,22                         |

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung     | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---------------------------|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Mortgage-Backed Securities 16,97 % (31. Dezember 2023: 22,27 %) (Fortsetzung)</b> |                           |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |                           |        |                       |                  |                              |
| 83.636   | Freddie Mac Pool          | 2,50 % | 01.01.2052            | 68.705           | 0,10                         |
| 269.090  | Freddie Mac Pool          | 2,50 % | 01.02.2052            | 220.237          | 0,32                         |
| 258.664  | Freddie Mac Pool          | 2,50 % | 01.03.2052            | 212.837          | 0,31                         |
| 280.851  | Freddie Mac Pool          | 2,50 % | 01.04.2052            | 229.770          | 0,34                         |
| 106.621  | Freddie Mac Pool          | 2,50 % | 01.06.2052            | 87.463           | 0,13                         |
| 16.249   | Freddie Mac Pool          | 3,00 % | 01.03.2050            | 14.089           | 0,02                         |
| 91.718   | Freddie Mac Pool          | 3,00 % | 01.07.2050            | 78.403           | 0,12                         |
| 39.757   | Freddie Mac Pool          | 3,00 % | 01.09.2052            | 33.843           | 0,05                         |
| 185.287  | Freddie Mac Pool          | 3,50 % | 01.05.2052            | 164.243          | 0,24                         |
| 317.211  | Freddie Mac Pool          | 4,50 % | 01.08.2052            | 298.857          | 0,44                         |
| 29.560   | Freddie Mac Pool          | 5,00 % | 01.10.2052            | 28.633           | 0,04                         |
| 223.743  | Freddie Mac Pool          | 5,00 % | 01.11.2052            | 216.706          | 0,32                         |
| 135.862  | Freddie Mac Pool          | 5,00 % | 01.01.2053            | 131.243          | 0,19                         |
| 249.460  | Freddie Mac Pool          | 5,00 % | 01.02.2053            | 241.575          | 0,36                         |
| 241.316  | Freddie Mac Pool          | 5,00 % | 01.04.2053            | 233.589          | 0,34                         |
| 42.314   | Freddie Mac Pool          | 5,00 % | 01.08.2053            | 40.881           | 0,06                         |
| 71.084   | Freddie Mac Pool          | 5,00 % | 01.11.2053            | 68.707           | 0,10                         |
| 148.321  | Freddie Mac Pool          | 5,00 % | 01.10.2054            | 143.237          | 0,21                         |
| 168.552  | Freddie Mac Pool          | 5,50 % | 01.09.2052            | 167.382          | 0,25                         |
| 175.897  | Freddie Mac Pool          | 5,50 % | 01.10.2052            | 173.979          | 0,26                         |
| 33.657   | Freddie Mac Pool          | 5,50 % | 01.12.2052            | 33.316           | 0,05                         |
| 105.641  | Freddie Mac Pool          | 5,50 % | 01.02.2053            | 104.523          | 0,15                         |
| 238.319  | Freddie Mac Pool          | 5,50 % | 01.05.2053            | 235.644          | 0,35                         |
| 63.873   | Freddie Mac Pool          | 5,50 % | 01.04.2054            | 63.078           | 0,09                         |
| 219.204  | Freddie Mac Pool          | 5,50 % | 01.07.2054            | 216.441          | 0,32                         |
| 23.818   | Freddie Mac Pool          | 6,00 % | 01.01.2053            | 23.947           | 0,04                         |
| 102.284  | Freddie Mac Pool          | 6,00 % | 01.03.2053            | 102.829          | 0,15                         |
| 287.976  | Freddie Mac Pool          | 6,00 % | 01.04.2053            | 289.951          | 0,43                         |
| 438.583  | Freddie Mac Pool          | 6,00 % | 01.05.2053            | 441.051          | 0,65                         |
| 341.934  | Freddie Mac Pool          | 6,00 % | 01.06.2053            | 344.034          | 0,51                         |
| 24.684   | Freddie Mac Pool          | 6,00 % | 01.10.2054            | 24.811           | 0,04                         |
| 195.271  | Freddie Mac Pool (RA7021) | 2,50 % | 01.03.2052            | 160.307          | 0,24                         |
| 34.799   | Freddie Mac Pool (RA7091) | 2,50 % | 01.03.2052            | 28.590           | 0,04                         |
| 72.513   | Ginnie Mae II Pool        | 4,50 % | 20.09.2052            | 68.714           | 0,10                         |
| 54.112   | Ginnie Mae II Pool        | 4,50 % | 20.04.2054            | 51.190           | 0,08                         |
| 140.057  | Ginnie Mae II Pool        | 5,00 % | 20.03.2053            | 136.261          | 0,20                         |
| 32.168   | Ginnie Mae II Pool        | 5,00 % | 20.07.2053            | 31.271           | 0,05                         |
| 71.244   | Ginnie Mae II Pool        | 5,00 % | 20.11.2053            | 69.225           | 0,10                         |
| 39.644   | Ginnie Mae II Pool        | 5,00 % | 20.07.2054            | 38.500           | 0,06                         |
| 39.843   | Ginnie Mae II Pool        | 5,00 % | 20.10.2054            | 38.690           | 0,06                         |

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung             | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|-----------------------------------|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Mortgage-Backed Securities 16,97 % (31. Dezember 2023: 22,27 %) (Fortsetzung)</b> |                                   |        |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |                                   |        |                       |                   |                              |
| 130.452  | Ginnie Mae II Pool                | 5,50 % | 20.03.2053            | 129.851           | 0,19                         |
| 64.677   | Ginnie Mae II Pool                | 5,50 % | 20.07.2053            | 64.326            | 0,10                         |
| 79.264   | Ginnie Mae II Pool                | 5,50 % | 20.08.2054            | 78.696            | 0,12                         |
| 48.727   | Ginnie Mae II Pool                | 6,00 % | 20.08.2053            | 49.107            | 0,07                         |
| 53.728   | Ginnie Mae II Pool                | 6,00 % | 20.05.2054            | 54.192            | 0,08                         |
| <b>Mortgage-Backed Securities insgesamt **</b>                                       |                                   |        |                       | <b>11.517.944</b> | <b>16,97</b>                 |
| Anzahl der<br>Anteile  | Wertpapierbezeichnung             |        |                       | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
| <b>Investmentfonds 0,00 % (31. Dezember 2023: 0,03 %)</b>                            |                                   |        |                       |                   |                              |
| <b>Britisches Pfund</b>  |                                   |        |                       |                   |                              |
| 3.054  | NB Global Monthly Income Fund Ltd |        |                       | 2.199             | 0,00                         |
| <b>Investmentfonds insgesamt #</b>   |                                   |        |                       | <b>2.199</b>      | <b>0,00</b>                  |
| <b>Anlagen insgesamt</b>   |                                   |        |                       | <b>58.818.811</b> | <b>86,64</b>                 |

Devisenterminkontrakte 9,25 % (31. Dezember 2023: 7,14 %)

| Geforderter<br>Betrag | Zu zahlender<br>Betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei                        | Kontrakte | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|-----------------------|------------------------|-----------------------|------------------------------------|-----------|--------------------------------------|------------------------------|
| 160.613 £             | 200.726 US\$           | 16.01.2025            | Goldman Sachs International        | 1         | 403                                  | 0,00                         |
| 80.000 £              | 94.836 €               | 16.01.2025            | Standard Chartered Bank            | 1         | 1.925                                | 0,00                         |
| 100.498 £             | 120.000 €              | 16.01.2025            | Westpac Banking Corp               | 1         | 1.524                                | 0,00                         |
| 2.006.297 ILS         | 540.908 US\$           | 16.01.2025            | BNP Paribas                        | 2         | 9.876                                | 0,01                         |
| 2.563.370 ILS         | 685.393 US\$           | 16.01.2025            | State Street Bank and Trust Co     | 3         | 18.322                               | 0,03                         |
| 389.676 ILS           | 104.191 US\$           | 16.01.2025            | UBS AG                             | 1         | 2.785                                | 0,00                         |
| 4.246.232 MXN         | 203.170 US\$           | 16.01.2025            | State Street Bank and Trust Co     | 1         | 567                                  | 0,00                         |
| 4.104.174 MXN         | 196.829 US\$           | 16.01.2025            | UBS AG                             | 1         | 92                                   | 0,00                         |
| 7.416.751 TRY         | 203.032 US\$           | 16.01.2025            | Goldman Sachs International        | 1         | 4.028                                | 0,01                         |
| 23.495.985 TRY        | 623.743 US\$           | 16.01.2025            | UBS AG                             | 2         | 32.215                               | 0,05                         |
| 1.735.300 US\$        | 1.637.025 €            | 16.01.2025            | BNP Paribas                        | 7         | 39.260                               | 0,06                         |
| 1.049.531 US\$        | 1.583.031 AUD          | 16.01.2025            | BNP Paribas                        | 4         | 69.378                               | 0,10                         |
| 1.241.743 US\$        | 13.530.189 SEK         | 16.01.2025            | BNP Paribas                        | 7         | 16.361                               | 0,02                         |
| 419.153 US\$          | 361.508 CHF            | 16.01.2025            | BNP Paribas                        | 1         | 19.650                               | 0,03                         |
| 2.719.193 US\$        | 413.957.427 ¥          | 16.01.2025            | BNP Paribas                        | 10        | 81.056                               | 0,12                         |
| 42.123 US\$           | 295.658 CNY            | 16.01.2025            | BNP Paribas                        | 1         | 1.187                                | 0,00                         |
| 419.512 US\$          | 1.687.614 PLN          | 16.01.2025            | BNP Paribas                        | 2         | 11.122                               | 0,02                         |
| 724.662 US\$          | 7.945.846 NOK          | 16.01.2025            | BNP Paribas                        | 5         | 25.056                               | 0,04                         |
| 2.071.554 US\$        | 1.626.828 £            | 16.01.2025            | BNP Paribas                        | 7         | 34.347                               | 0,05                         |
| 403.698 US\$          | 701.038 NZD            | 16.01.2025            | BNP Paribas                        | 2         | 10.912                               | 0,02                         |
| 682.529 US\$          | 949.655 CAD            | 16.01.2025            | BNP Paribas                        | 2         | 21.898                               | 0,03                         |
| 1.459.182 US\$        | 33.230.331 CZK         | 16.01.2025            | Canadian Imperial Bank of Commerce | 2         | 92.052                               | 0,14                         |
| 51.897 US\$           | 77.000 AUD             | 16.01.2025            | Canadian Imperial Bank of Commerce | 1         | 4.222                                | 0,01                         |

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 9,25 % (31. Dezember 2023: 7,14 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                        | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|------------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 144.685 US\$       | 136.198 €           | 16.01.2025       | Canadian Imperial Bank of Commerce | 2         | 3.577                          | 0,01                 |
| 645.236 US\$       | 874.516 CAD         | 16.01.2025       | Canadian Imperial Bank of Commerce | 2         | 36.876                         | 0,05                 |
| 1.568.440 US\$     | 2.485.193 NZD       | 16.01.2025       | Canadian Imperial Bank of Commerce | 2         | 176.007                        | 0,26                 |
| 5.753 US\$         | 58.463 SEK          | 16.01.2025       | Citibank NA                        | 2         | 459                            | 0,00                 |
| 2.712.456 US\$     | 54.146.622 MXN      | 16.01.2025       | Citibank NA                        | 1         | 114.468                        | 0,17                 |
| 607 US\$           | 4.234 CNY           | 16.01.2025       | Citibank NA                        | 1         | 31                             | 0,00                 |
| 40.636 US\$        | 708.353 ZAR         | 16.01.2025       | Citibank NA                        | 1         | 3.144                          | 0,00                 |
| 42.174 US\$        | 66.094 AUD          | 16.01.2025       | Deutsche Bank AG                   | 1         | 1.251                          | 0,00                 |
| 1.120.163 US\$     | 159.115.874 ¥       | 16.01.2025       | Deutsche Bank AG                   | 1         | 106.123                        | 0,16                 |
| 580.040 US\$       | 881.979 AUD         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 2         | 33.952                         | 0,05                 |
| 1.985.920 US\$     | 21.466.838 SEK      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 6         | 41.741                         | 0,06                 |
| 779.850 US\$       | 8.560.154 NOK       | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 5         | 26.157                         | 0,04                 |
| 1.313.816 US\$     | 27.065.269 MXN      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 5         | 15.207                         | 0,02                 |
| 1.456.475 US\$     | 2.034.671 CAD       | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 3         | 41.048                         | 0,06                 |
| 1.150.473 US\$     | 901.909 £           | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 5         | 21.052                         | 0,03                 |
| 309.884 US\$       | 1.808.949 BRL       | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 2         | 17.815                         | 0,03                 |
| 102.916 US\$       | 2.424.777 CZK       | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 1         | 3.158                          | 0,00                 |
| 428.346 US\$       | 7.577.148 ZAR       | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 1         | 27.297                         | 0,04                 |
| 314.518 US\$       | 26.588.939 INR      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 2         | 4.261                          | 0,01                 |
| 407.811 US\$       | 362.133 CHF         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 1         | 7.617                          | 0,01                 |
| 2.367.502 US\$     | 2.188.431 €         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 6         | 100.177                        | 0,15                 |
| 847.233 US\$       | 312.078.832 HUF     | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 1         | 62.170                         | 0,09                 |
| 836.998 US\$       | 128.752.245 ¥       | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 3         | 16.463                         | 0,02                 |
| 981.815 US\$       | 3.927.984 PLN       | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 5         | 31.271                         | 0,05                 |
| 790.863 US\$       | 1.266.004 NZD       | 16.01.2025       | Royal Bank of Canada               | 3         | 81.532                         | 0,12                 |
| 840.025 US\$       | 733.637 CHF         | 16.01.2025       | Royal Bank of Canada               | 2         | 29.282                         | 0,04                 |
| 4.747.705 US\$     | 6.946.613 AUD       | 16.01.2025       | Royal Bank of Canada               | 6         | 446.629                        | 0,66                 |
| 529.910 US\$       | 78.151.272 ¥        | 16.01.2025       | Royal Bank of Canada               | 2         | 31.855                         | 0,05                 |
| 847.889 US\$       | 652.694 £           | 16.01.2025       | Royal Bank of Canada               | 1         | 30.549                         | 0,05                 |
| 213.797 US\$       | 3.732.412 ZAR       | 16.01.2025       | Royal Bank of Canada               | 1         | 16.246                         | 0,02                 |
| 419.910 US\$       | 583.161 CAD         | 16.01.2025       | Royal Bank of Canada               | 2         | 14.232                         | 0,02                 |
| 631.729 US\$       | 6.828.608 NOK       | 16.01.2025       | Royal Bank of Canada               | 1         | 30.493                         | 0,04                 |
| 413.698 US\$       | 393.199 €           | 16.01.2025       | Royal Bank of Canada               | 2         | 6.324                          | 0,01                 |
| 1.006.420 US\$     | 362.500.000 HUF     | 16.01.2025       | Royal Bank of Canada               | 2         | 94.519                         | 0,14                 |
| 207.410 US\$       | 179.947 CHF         | 16.01.2025       | Standard Chartered Bank            | 1         | 8.550                          | 0,01                 |
| 193.019 US\$       | 176.731 €           | 16.01.2025       | Standard Chartered Bank            | 2         | 9.917                          | 0,01                 |
| 46.041 US\$        | 331.138 CNY         | 16.01.2025       | Standard Chartered Bank            | 1         | 193                            | 0,00                 |
| 210.781 US\$       | 3.333.654.568 IDR   | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co     | 2         | 4.759                          | 0,01                 |
| 48.184 US\$        | 17.235.687 HUF      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co     | 1         | 4.826                          | 0,01                 |
| 2.520.254 US\$     | 2.315.255 €         | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co     | 9         | 121.533                        | 0,18                 |
| 209.309 US\$       | 17.696.418 INR      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co     | 2         | 2.816                          | 0,00                 |

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 9,25 % (31. Dezember 2023: 7,14 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag              | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 1.692.326 US\$                  | 2.824.880 NZD       | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 7         | 109.570                        | 0,16                 |
| 310.465 US\$                    | 6.278.741 MXN       | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 4         | 9.207                          | 0,01                 |
| 420.053 US\$                    | 2.972.542 CNY       | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 15.172                         | 0,02                 |
| 226.829 US\$                    | 1.329.286 BRL       | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 12.205                         | 0,02                 |
| 668.585 US\$                    | 898.471.439 KRW     | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 3         | 60.342                         | 0,09                 |
| 2.120.124 US\$                  | 1.827.522 CHF       | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 8         | 100.528                        | 0,15                 |
| 592.518 US\$                    | 2.355.483 PLN       | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 4         | 22.508                         | 0,03                 |
| 1.612.543 US\$                  | 2.468.651 AUD       | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 11        | 84.049                         | 0,12                 |
| 2.363.882 US\$                  | 356.955.888 ¥       | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 12        | 89.013                         | 0,13                 |
| 1.669.474 US\$                  | 1.305.878 £         | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 9         | 34.179                         | 0,05                 |
| 1.038.709 US\$                  | 11.445.588 NOK      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 6         | 30.964                         | 0,05                 |
| 740.615 US\$                    | 13.171.589 ZAR      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 3         | 43.459                         | 0,06                 |
| 1.097.040 US\$                  | 1.527.812 CAD       | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 5         | 34.212                         | 0,05                 |
| 2.643.813 US\$                  | 27.886.175 SEK      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 7         | 118.259                        | 0,17                 |
| 6.297.467 US\$                  | 4.728.009 £         | 16.01.2025       | UBS AG                         | 3         | 376.784                        | 0,56                 |
| 460.673 US\$                    | 5.096.469 NOK       | 16.01.2025       | UBS AG                         | 2         | 11.947                         | 0,02                 |
| 31.557.766 US\$                 | 28.404.737 €        | 16.01.2025       | UBS AG                         | 7         | 2.129.026                      | 3,14                 |
| 990.308 US\$                    | 1.360.821 CAD       | 16.01.2025       | UBS AG                         | 2         | 43.647                         | 0,06                 |
| 246.681 US\$                    | 1.727.851 CNY       | 16.01.2025       | UBS AG                         | 1         | 11.336                         | 0,02                 |
| 213.510 US\$                    | 18.025.632 INR      | 16.01.2025       | UBS AG                         | 1         | 3.175                          | 0,00                 |
| 216.727 US\$                    | 4.425.340 MXN       | 16.01.2025       | UBS AG                         | 1         | 4.396                          | 0,01                 |
| 318.317 US\$                    | 120.578.576 HUF     | 16.01.2025       | UBS AG                         | 2         | 14.991                         | 0,02                 |
| 277.725 US\$                    | 9.000.000 THB       | 16.01.2025       | UBS AG                         | 1         | 13.565                         | 0,02                 |
| 103.351 US\$                    | 145.107.204 KRW     | 16.01.2025       | UBS AG                         | 1         | 5.116                          | 0,01                 |
| 2.781.566 US\$                  | 19.481.947 CNY      | 16.01.2025       | UBS AG                         | 1         | 84.160                         | 0,12                 |
| 102.867 US\$                    | 176.672 NZD         | 16.01.2025       | UBS AG                         | 1         | 3.879                          | 0,01                 |
| 22.549 US\$                     | 396.916 ZAR         | 16.01.2025       | UBS AG                         | 1         | 1.541                          | 0,00                 |
| 2.427.173 US\$                  | 38.078.028.223 IDR  | 16.01.2025       | UBS AG                         | 2         | 73.924                         | 0,11                 |
| 633.320 US\$                    | 93.945.534 ¥        | 16.01.2025       | UBS AG                         | 2         | 34.609                         | 0,05                 |
| 364.927 US\$                    | 3.968.399 SEK       | 16.01.2025       | UBS AG                         | 1         | 5.523                          | 0,01                 |
| 1.134.871 US\$                  | 6.683.281 BRL       | 16.01.2025       | UBS AG                         | 4         | 55.801                         | 0,08                 |
| 1.266.882 US\$                  | 1.192.884 €         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 5         | 30.994                         | 0,05                 |
| 423.890 US\$                    | 587.848 CAD         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 1         | 14.951                         | 0,02                 |
| 57.080 US\$                     | 42.589 £            | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 1         | 3.747                          | 0,01                 |
| 102.107 US\$                    | 89.759 CHF          | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 1         | 2.914                          | 0,00                 |
| 55 US\$                         | 385 CNY             | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 1         | 2                              | 0,00                 |
| 2.273.995 US\$                  | 3.403.931 AUD       | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 6         | 166.411                        | 0,25                 |
| 1.727.548 US\$                  | 2.904.236 NZD       | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 6         | 100.328                        | 0,15                 |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 97 US\$                         | 89 €                | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | 5                              | 0,00                 |
| 181 US\$                        | 164 €               | 16.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 11                             | 0,00                 |

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 9,25 % (31. Dezember 2023: 7,14 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR (Fortsetzung)</i>                                   |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 117 US\$  | 113 €               | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 0                              | 0,00                 |
| 103 US\$  | 94 €                | 16.01.2025       | UBS AG                         | 1         | 6                              | 0,00                 |
| 93 US\$   | 86 €                | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 1         | 4                              | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>   |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 185 US\$  | 143 £               | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | 6                              | 0,00                 |
| 192 US\$  | 147 £               | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 8                              | 0,00                 |
| 458 US\$  | 351 £               | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 2         | 18                             | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                                |           | <b>6.280.307</b>               | <b>9,25</b>          |

### Futures-Kontrakte 0,23 % (31. Dezember 2023: 1,28 %)

| Anzahl Kontrakte  | Beschreibung   | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |             |
|---|--|--------------------------------|----------------------|-------------|
| (9)   | Australian Government Bond 10-Year Future March 2025 | 4.260                          | 0,01                 |             |
| 10  | Canadian 10-Year Bond Future March 2025              | 15.366                         | 0,02                 |             |
| 19  | Canadian 5-Year Bond Future March 2025               | 19.949                         | 0,03                 |             |
| (1)   | Euro-BOBL Future March 2025                          | 1.201                          | 0,00                 |             |
| (11)  | Euro-BTP Future March 2025                           | 29.481                         | 0,04                 |             |
| (5)   | Euro-Bund Future March 2025                          | 15.532                         | 0,02                 |             |
| (3)   | Euro-Buxl 30-Year Bond Future March 2025             | 27.027                         | 0,04                 |             |
| (2)   | Euro-OAT Future March 2025                           | 5.136                          | 0,01                 |             |
| (6)   | Euro-Schatz Future March 2025                        | 2.827                          | 0,01                 |             |
| (32)  | US Treasury 2-Year Note (CBT) Future March 2025      | 2.675                          | 0,00                 |             |
| (23)  | US Treasury Ultra 10-Year Future March 2025          | 35.758                         | 0,05                 |             |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten *</b> |  |                                | <b>159.212</b>       | <b>0,23</b> |

### Zinsswap-Kontrakte 0,15 % (31. Dezember 2023: 0,00 %)

| Nominalwert  | Fälligkeit | Gegenpartei                   | Erhalt/(Zahlung) <sup>#</sup> | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|------------|-------------------------------|-------------------------------|-----------------|--------------------|--------------------------------|----------------------|
| NZD 1.311.000  | 27.02.2034 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 4,75 %          | 3M BKBM            | 50.067                         | 0,07                 |
| KRW 942.826.000  | 16.02.2029 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 3,36 %          | 3M KWDCD           | 15.993                         | 0,02                 |
| NZD 3.025.000  | 14.08.2026 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 3,99 %          | 3M BKBM            | 14.255                         | 0,02                 |
| USD 3.000.000  | 14.08.2026 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | Erhalt                        | 3,85 %          | 1D SOFR            | 12.416                         | 0,02                 |
| USD 5.090.000  | 08.02.2026 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 4,29 %          | 1D SOFR            | 6.462                          | 0,01                 |
| CNY 16.892.000   | 17.08.2026 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 2,05 %          | 7D CNRR            | 3.211                          | 0,01                 |
| KRW 1.267.973.000  | 11.08.2032 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 2,88 %          | 3M KWDCD           | 5                              | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Zinsswapkontrakten <sup>∞</sup></b> |            |                               |                               |                 |                    | <b>102.409</b>                 | <b>0,15</b>          |

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Credit-Default-Swap-Kontrakten 0,24 % (31. Dezember 2023: 0,30 %)

|  | Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei                 | Referenzverbindlichkeit                   | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|-------------|------------|-----------------------------|---|------------------|------------------------------|
| USD  | 6.687.000   | 20.06.2029 | ICE Clear U.S. <sup>1</sup> | Buying default protection on CDX.EM.41.V1 | 160.073          | 0,24                         |
| <b>Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt ±</b> |             |            |                             |   | <b>160.073</b>   | <b>0,24</b>                  |

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

|  | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|-------------------|------------------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> | <b>65.520.812</b> | <b>96,51</b>                 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (4,57 %) (31. Dezember 2023: (10,06 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                        | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettövermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|------------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 3.181.647 AUD      | 2.096.740 US\$      | 16.01.2025       | BNP Paribas                        | 6         | (126.786)                       | (0,19)               |
| 2.384.121 AUD      | 1.605.250 US\$      | 16.01.2025       | Canadian Imperial Bank of Commerce | 2         | (129.094)                       | (0,19)               |
| 64.425 AUD         | 42.746 US\$         | 16.01.2025       | Citibank NA                        | 1         | (2.857)                         | (0,00)               |
| 67.724 AUD         | 45.803 US\$         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 1         | (3.870)                         | (0,01)               |
| 703.506 AUD        | 473.242 US\$        | 16.01.2025       | Royal Bank of Canada               | 2         | (37.659)                        | (0,06)               |
| 1.775.253 AUD      | 1.155.427 US\$      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co     | 4         | (56.259)                        | (0,08)               |
| 1.525.472 AUD      | 988.594 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                             | 2         | (44.080)                        | (0,06)               |
| 799.288 AUD        | 525.216 US\$        | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp               | 2         | (30.328)                        | (0,04)               |
| 3.670.120 BRL      | 623.297 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 2         | (30.726)                        | (0,05)               |
| 3.709.099 BRL      | 650.747 US\$        | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co     | 2         | (51.883)                        | (0,08)               |
| 2.454.603 BRL      | 439.000 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                             | 1         | (42.685)                        | (0,06)               |
| 876.142 CAD        | 634.394 US\$        | 16.01.2025       | BNP Paribas                        | 2         | (24.902)                        | (0,04)               |
| 408.475 CAD        | 300.181 US\$        | 16.01.2025       | Canadian Imperial Bank of Commerce | 1         | (16.024)                        | (0,02)               |
| 2.767.933 CAD      | 1.999.192 US\$      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 5         | (73.667)                        | (0,11)               |
| 1.176.746 CAD      | 853.255 US\$        | 16.01.2025       | Royal Bank of Canada               | 3         | (34.647)                        | (0,05)               |
| 100.000 CAD        | 72.825 US\$         | 16.01.2025       | Standard Chartered Bank            | 1         | (3.260)                         | (0,00)               |
| 1.186.747 CAD      | 844.228 US\$        | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co     | 4         | (18.663)                        | (0,03)               |
| 1.143.750 CAD      | 838.689 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                             | 2         | (43.034)                        | (0,06)               |
| 949.952 CAD        | 683.166 US\$        | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp               | 2         | (22.328)                        | (0,03)               |
| 1.002.300 CHF      | 1.153.416 US\$      | 16.01.2025       | BNP Paribas                        | 4         | (45.774)                        | (0,07)               |
| 542.172 CHF        | 629.043 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 1         | (29.888)                        | (0,04)               |
| 2.149.901 CHF      | 2.475.345 US\$      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co     | 13        | (99.488)                        | (0,15)               |
| 184.836 CHF        | 209.372 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                             | 1         | (5.110)                         | (0,01)               |
| 87.087 CHF         | 98.749 US\$         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp               | 1         | (2.509)                         | (0,00)               |
| 1.041.637 CLP      | 1.114 US\$          | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 1         | (67)                            | (0,00)               |
| 3.714.539 CNY      | 519.240 US\$        | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co     | 2         | (13.295)                        | (0,02)               |
| 327.840 CNY        | 46.780 US\$         | 16.01.2025       | Citibank NA                        | 1         | (1.388)                         | (0,00)               |

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (4,57 %) (31. Dezember 2023: (10,06 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                        | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|------------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 7.985.613 CNY      | 1.139.662 US\$      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 1         | (34.000)                        | (0,05)               |
| 598.948 COP        | 139 US\$            | 16.01.2025       | Royal Bank of Canada               | 1         | (4)                             | (0,00)               |
| 732.587 CZK        | 31.900 US\$         | 16.01.2025       | Royal Bank of Canada               | 1         | (1.761)                         | (0,00)               |
| 2.442.747 CZK      | 102.639 US\$        | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co     | 1         | (2.142)                         | (0,00)               |
| 3.086.606 €        | 3.302.237 US\$      | 16.01.2025       | BNP Paribas                        | 13        | (104.359)                       | (0,15)               |
| 102.022 €          | 110.108 US\$        | 16.01.2025       | Canadian Imperial Bank of Commerce | 2         | (4.408)                         | (0,01)               |
| 100.000 €          | 110.065 US\$        | 16.01.2025       | Citibank NA                        | 1         | (6.460)                         | (0,01)               |
| 54.334 €           | 59.234 US\$         | 16.01.2025       | Deutsche Bank AG                   | 1         | (2.941)                         | (0,00)               |
| 1.152.858 €        | 1.240.941 US\$      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 4         | (46.523)                        | (0,07)               |
| 797.183 €          | 849.593 US\$        | 16.01.2025       | Royal Bank of Canada               | 5         | (23.671)                        | (0,03)               |
| 133.265 €          | 138.952 US\$        | 16.01.2025       | Standard Chartered Bank            | 1         | (883)                           | (0,00)               |
| 2.199.069 €        | 2.355.424 US\$      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co     | 11        | (77.079)                        | (0,11)               |
| 4.819.391 €        | 5.343.812 US\$      | 16.01.2025       | UBS AG                             | 6         | (350.680)                       | (0,52)               |
| 196.251 €          | 210.422 US\$        | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp               | 2         | (7.096)                         | (0,01)               |
| 1.064.450 £        | 1.360.496 US\$      | 16.01.2025       | BNP Paribas                        | 4         | (27.532)                        | (0,04)               |
| 515.134 £          | 669.452 US\$        | 16.01.2025       | Canadian Imperial Bank of Commerce | 3         | (24.371)                        | (0,04)               |
| 608.313 £          | 784.669 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 3         | (22.904)                        | (0,03)               |
| 50.000 £           | 65.460 US\$         | 16.01.2025       | JPMorgan Chase Bank                | 1         | (2.847)                         | (0,00)               |
| 608.552 £          | 766.256 US\$        | 16.01.2025       | Royal Bank of Canada               | 4         | (4.192)                         | (0,01)               |
| 747.331 £          | 950.482 US\$        | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co     | 6         | (14.633)                        | (0,02)               |
| 659.151 £          | 837.471 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                             | 1         | (12.045)                        | (0,02)               |
| 155.543.389 HUF    | 422.311 US\$        | 16.01.2025       | BNP Paribas                        | 1         | (31.028)                        | (0,05)               |
| 16.482.901 HUF     | 43.965 US\$         | 16.01.2025       | Canadian Imperial Bank of Commerce | 2         | (2.501)                         | (0,00)               |
| 156.542.863 HUF    | 417.639 US\$        | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co     | 1         | (23.841)                        | (0,04)               |
| 100.641.846 HUF    | 261.404 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                             | 1         | (8.231)                         | (0,01)               |
| 5.645.869.435 IDR  | 361.629 US\$        | 16.01.2025       | BNP Paribas                        | 2         | (12.710)                        | (0,02)               |
| 3.328.961.392 IDR  | 209.895 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 2         | (4.163)                         | (0,01)               |
| 44.560.220 INR     | 528.203 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 1         | (8.245)                         | (0,01)               |
| 17.748.585 INR     | 210.424 US\$        | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co     | 2         | (3.322)                         | (0,00)               |
| 288.107.411 ¥      | 1.887.019 US\$      | 16.01.2025       | BNP Paribas                        | 5         | (50.920)                        | (0,08)               |
| 15.861.166 ¥       | 104.606 US\$        | 16.01.2025       | Canadian Imperial Bank of Commerce | 1         | (3.523)                         | (0,01)               |
| 2.225.240 ¥        | 15.666 US\$         | 16.01.2025       | Deutsche Bank AG                   | 1         | (1.484)                         | (0,00)               |
| 294.175.184 ¥      | 1.928.560 US\$      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 5         | (53.791)                        | (0,08)               |
| 62.454.426 ¥       | 424.877 US\$        | 16.01.2025       | Royal Bank of Canada               | 1         | (26.857)                        | (0,04)               |
| 198.286.443 ¥      | 1.326.750 US\$      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co     | 5         | (63.077)                        | (0,09)               |
| 188.827.067 ¥      | 1.253.054 US\$      | 16.01.2025       | UBS AG                             | 5         | (49.665)                        | (0,07)               |
| 142.848.069 KRW    | 106.289 US\$        | 16.01.2025       | Royal Bank of Canada               | 1         | (9.584)                         | (0,01)               |
| 1.459.650.594 KRW  | 1.084.136 US\$      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co     | 3         | (95.988)                        | (0,14)               |
| 147.206.503 KRW    | 106.690 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                             | 1         | (7.034)                         | (0,01)               |
| 6.391.357 MXN      | 320.173 US\$        | 16.01.2025       | Citibank NA                        | 1         | (13.512)                        | (0,02)               |

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (4,57 %) (31. Dezember 2023: (10,06 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag              | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                        | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|------------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 7.450.487 MXN                   | 362.646 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 3         | (5.167)                         | (0,01)               |
| 17.695.634 MXN                  | 866.070 US\$        | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co     | 7         | (17.022)                        | (0,03)               |
| 10.791.667 MXN                  | 528.278 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                             | 1         | (10.487)                        | (0,02)               |
| 20.558.315 NOK                  | 1.867.930 US\$      | 16.01.2025       | BNP Paribas                        | 10        | (57.838)                        | (0,09)               |
| 8.013.083 NOK                   | 724.403 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 4         | (18.878)                        | (0,03)               |
| 13.584.024 NOK                  | 1.246.980 US\$      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co     | 5         | (50.952)                        | (0,08)               |
| 3.359.621 NOK                   | 303.912 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                             | 1         | (8.109)                         | (0,01)               |
| 969.839 NZD                     | 574.796 US\$        | 16.01.2025       | BNP Paribas                        | 2         | (31.404)                        | (0,05)               |
| 280.229 NZD                     | 176.980 US\$        | 16.01.2025       | Canadian Imperial Bank of Commerce | 1         | (19.970)                        | (0,03)               |
| 885.080 NZD                     | 529.743 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 1         | (33.840)                        | (0,05)               |
| 77.251 NZD                      | 46.531 US\$         | 16.01.2025       | Royal Bank of Canada               | 1         | (3.247)                         | (0,00)               |
| 2.298.377 NZD                   | 1.367.625 US\$      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co     | 6         | (79.864)                        | (0,12)               |
| 354.267 NZD                     | 209.193 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                             | 1         | (10.700)                        | (0,02)               |
| 3.589.241 NZD                   | 2.166.083 US\$      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp               | 6         | (155.061)                       | (0,23)               |
| 435.438 PLN                     | 106.308 US\$        | 16.01.2025       | Canadian Imperial Bank of Commerce | 3         | (934)                           | (0,00)               |
| 1.164.480 PLN                   | 287.489 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 2         | (5.693)                         | (0,01)               |
| 5.464.943 PLN                   | 1.355.089 US\$      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co     | 6         | (32.614)                        | (0,05)               |
| 859.766 PLN                     | 212.888 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                             | 1         | (4.831)                         | (0,01)               |
| 19.290.877 SEK                  | 1.781.847 US\$      | 16.01.2025       | BNP Paribas                        | 8         | (34.740)                        | (0,05)               |
| 7.815.456 SEK                   | 722.724 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 6         | (14.906)                        | (0,02)               |
| 2.297.321 SEK                   | 209.298 US\$        | 16.01.2025       | Royal Bank of Canada               | 1         | (1.238)                         | (0,00)               |
| 36.143.372 SEK                  | 3.407.039 US\$      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co     | 15        | (133.659)                       | (0,20)               |
| 2.267.324 SEK                   | 207.629 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                             | 1         | (2.285)                         | (0,00)               |
| 81 SGD                          | 62 US\$             | 16.01.2025       | Royal Bank of Canada               | 1         | (3)                             | (0,00)               |
| 202.667 US\$                    | 4.250.049 MXN       | 16.01.2025       | Canadian Imperial Bank of Commerce | 1         | (1.253)                         | (0,00)               |
| 110.773 US\$                    | 4.093.194 TRY       | 16.01.2025       | Citibank NA                        | 1         | (3.500)                         | (0,01)               |
| 220.174 US\$                    | 8.040.748 TRY       | 16.01.2025       | Goldman Sachs International        | 1         | (4.307)                         | (0,01)               |
| 639.995 US\$                    | 2.368.286 ILS       | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co     | 2         | (10.165)                        | (0,01)               |
| 85.595 US\$                     | 82.659 €            | 16.01.2025       | UBS AG                             | 1         | (44)                            | (0,00)               |
| 518.173 US\$                    | 18.816.930 TRY      | 16.01.2025       | UBS AG                             | 1         | (7.156)                         | (0,01)               |
| 689.284 US\$                    | 2.591.020 ILS       | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp               | 1         | (22.022)                        | (0,03)               |
| 3.755.486 ZAR                   | 214.115 US\$        | 16.01.2025       | BNP Paribas                        | 1         | (15.342)                        | (0,02)               |
| 3.749.019 ZAR                   | 214.353 US\$        | 16.01.2025       | Canadian Imperial Bank of Commerce | 1         | (15.922)                        | (0,02)               |
| 829.437 ZAR                     | 47.583 US\$         | 16.01.2025       | Citibank NA                        | 1         | (3.682)                         | (0,01)               |
| 16.958.938 ZAR                  | 953.910 US\$        | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co     | 2         | (56.295)                        | (0,08)               |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> |                     |                  |                                    |           |                                 |                      |
| 96 €                            | 106 US\$            | 16.01.2025       | UBS AG                             | 1         | (7)                             | (0,00)               |
| 15.454 €                        | 17.031 US\$         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp               | 2         | (1.020)                         | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> |                     |                  |                                    |           |                                 |                      |
| 183 £                           | 233 US\$            | 16.01.2025       | UBS AG                             | 1         | (4)                             | (0,00)               |
| 23.849 £                        | 31.251 US\$         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp               | 2         | (1.386)                         | (0,00)               |

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (4,57 %) (31. Dezember 2023: (10,06 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen GBP (Fortsetzung)</i>                                    |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 218 US\$   | 174 £               | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (0)                             | (0,00)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>(3.105.825)</b>              | <b>(4,57)</b>        |

### Futures-Kontrakte (0,46 %) (31. Dezember 2023: (0,54 %))

| Anzahl Kontrakte  | Beschreibung  | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens           |
|---|---|---------------------------------|--------------------------------|
| 57  | 10-Year Mini Japanese Government Bond Future March 2025 | (10.715)                        | (0,02)                         |
| 9   | Australian Government Bond 3-Year Future March 2025     | (552)                           | (0,00)                         |
| 28  | Euro-BOBL Future March 2025                             | (46.680)                        | (0,07)                         |
| 16  | Euro-Bund Future March 2025                             | (57.253)                        | (0,08)                         |
| 5   | Euro-Schatz Future March 2025                           | (1.553)                         | (0,00)                         |
| 11  | United Kingdom Long Gilt Future March 2025              | (29.344)                        | (0,04)                         |
| 10  | US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2025        | (13.281)                        | (0,02)                         |
| 111   | US Treasury 5-Year Note (CBT) Future March 2025         | (99.002)                        | (0,15)                         |
| 6   | US Treasury Long Bond (CBT) Future March 2025           | (27.652)                        | (0,04)                         |
| 4   | US Treasury Ultra Bond (CBT) Future March 2025          | (27.211)                        | (0,04)                         |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten <sup>*</sup></b> |   |                                 | <b>(313.243)</b> <b>(0,46)</b> |

### Credit-Default-Swap-Kontrakte (1,27 %) (31. Dezember 2023: (1,26 %))

| Nominalwert   | Fälligkeit | Gegenpartei                 | Referenzverbindlichkeit                                     | Zeitwert US\$    | % des Nettovermögens |
|---|------------|-----------------------------|---|------------------|----------------------|
| EUR 9.282.000   | 20.06.2029 | ICE Clear U.S. <sup>1</sup> | Buying default protection on iTRAXX Europe Crossover S41.V1 | (858.585)        | (1,27)               |
| <b>Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt <sup>*</sup></b> |            |                             |   | <b>(858.585)</b> | <b>(1,27)</b>        |

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

### Zinsswap-Kontrakte (0,04 %) (31. Dezember 2023: (0,00 %))

| Nominalwert   | Fälligkeit | Gegenpartei                   | Erhalt/(Zahlung) <sup>#</sup> | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|------------|-------------------------------|-------------------------------|-----------------|--------------------|---------------------------------|----------------------|
| USD 3.000.000   | 14.08.2026 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 3,83 %          | 1D SOFR            | (13.324)                        | (0,02)               |
| NZD 3.025.000   | 14.08.2026 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | Erhalt                        | 4,02 %          | 3M BKBM            | (14.984)                        | (0,02)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Zinsswapkontrakten <sup>∞</sup></b> |            |                               |                               |                 |                    | <b>(28.308)</b>                 | <b>(0,04)</b>        |

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

## Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

|   | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|---|--------------------|------------------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(4.305.961)</b> | <b>(6,34)</b>                |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>61.214.851</b>  | <b>90,17</b>                 |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>6.673.971</b>   | <b>9,83</b>                  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>67.888.822</b>  | <b>100,00</b>                |

| <b>Portfolioanalyse</b>   | US\$              | % des<br>Gesamtver-<br>mögens |
|---|-------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 37.386.560        | 50,59                         |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden            | 21.430.052        | 29,00                         |
| μ Investmentfonds   | 2.199             | 0,00                          |
| ± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden                          | (154.031)         | (0,21)                        |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap                            | 2.550.071         | 3,45                          |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>61.214.851</b> | <b>82,83</b>                  |

## Global Real Estate Securities - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte 0,00 % (31. Dezember 2023: 2,07 %)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens        |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|-----------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 52.762 US\$  | 49.621 €            | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 3         | 1.352                          | 0,00                        |
| 106.612 US\$   | 99.493 €            | 16.01.2025       | UBS AG                      | 8         | 3.530                          | 0,00                        |
| 50.251 US\$  | 46.409 €            | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 5         | 2.169                          | 0,00                        |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 1.585 US\$   | 1.220 £             | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 3         | 58                             | 0,00                        |
| 837 US\$   | 655 £               | 16.01.2025       | UBS AG                      | 2         | 16                             | 0,00                        |
| 35.256 US\$  | 27.600 £            | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 9         | 695                            | 0,00                        |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>                        |                     |                  |                             |           | <b>7.820</b>                   | <b>0,00</b>                 |
|  |                     |                  |                             |           | <b>Zeitwert US\$</b>           | <b>% des Nettovermögens</b> |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |                     |                  |                             |           | <b>7.820</b>                   | <b>0,00</b>                 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,00 %) (31. Dezember 2023: (1,23 %))

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens         |
|---|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|------------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                              |
| 12.348 €  | 13.830 US\$         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (1.036)                         | (0,00)                       |
| 59.846 €  | 64.617 US\$         | 16.01.2025       | UBS AG                      | 7         | (2.613)                         | (0,00)                       |
| 907.240 €   | 999.968 US\$        | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 9         | (60.021)                        | (0,00)                       |
| 2.212 US\$  | 2.136 €             | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | (1)                             | (0,00)                       |
| 809.959 US\$  | 781.807 €           | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | (32)                            | (0,00)                       |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                              |
| 391 £   | 498 US\$            | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 2         | (9)                             | (0,00)                       |
| 29.084 £  | 38.089 US\$         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 9         | (1.667)                         | (0,00)                       |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>                          |                     |                  |                             |           | <b>(65.379)</b>                 | <b>(0,00)</b>                |
|   |                     |                  |                             |           | <b>Zeitwert US\$</b>            | <b>% des Nettovermögens</b>  |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> |                     |                  |                             |           | <b>(65.379)</b>                 | <b>(0,00)</b>                |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              |                     |                  |                             |           | <b>(57.559)</b>                 | <b>(0,00)</b>                |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  |                     |                  |                             |           | <b>57.559</b>                   | <b>(0,00)</b>                |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   |                     |                  |                             |           | <b>0,00</b>                     | <b>0,00</b>                  |
| <b>Portfolioanalyse</b>   |                     |                  |                             |           | <b>US\$</b>                     | <b>% des Gesamtvermögens</b> |
| <sup>∞</sup> OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente  |                     |                  |                             |           | (57.559)                        | (0,39)                       |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  |                     |                  |                             |           | <b>(57.559)</b>                 | <b>(0,39)</b>                |

## Global Sustainable Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der Anteile                                 | Wertpapierbezeichnung     | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---------------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Aktien 99,44 % (31. Dezember 2023: 99,37 %)</b> |                           |                   |                              |
| <b>Dänische Krone</b>                              |                           |                   |                              |
| 25.780   | Novo Nordisk A/S Class B  | 2.223.604         | 1,58                         |
| <b>Dänische Krone insgesamt</b>                    |                           | <b>2.223.604</b>  | <b>1,58</b>                  |
| <b>Euro</b>  |                           |                   |                              |
| 1.959  | Adyen NV                  | 2.915.018         | 2,08                         |
| 5.012  | ASML Holding NV           | 3.522.403         | 2,51                         |
| 42.148   | Dassault Systemes SE      | 1.462.082         | 1,04                         |
| 7.781  | L'Oreal SA                | 2.754.363         | 1,96                         |
| 12.068   | Schneider Electric SE     | 3.010.386         | 2,14                         |
| <b>Euro insgesamt</b>                              |                           | <b>13.664.252</b> | <b>9,73</b>                  |
| <b>Japanischer Yen</b>                             |                           |                   |                              |
| 42.100   | Recruit Holdings Co Ltd   | 2.929.728         | 2,09                         |
| <b>Japanischer Yen insgesamt</b>                   |                           | <b>2.929.728</b>  | <b>2,09</b>                  |
| <b>Norwegische Krone</b>                           |                           |                   |                              |
| 58.014   | Bakkafrost P/F            | 3.241.682         | 2,31                         |
| <b>Norwegische Krone insgesamt</b>                 |                           | <b>3.241.682</b>  | <b>2,31</b>                  |
| <b>Britisches Pfund</b>                            |                           |                   |                              |
| 91.132   | 3i Group Plc              | 4.067.726         | 2,90                         |
| 63.455   | Compass Group Plc         | 2.115.519         | 1,50                         |
| <b>Britisches Pfund insgesamt</b>                  |                           | <b>6.183.245</b>  | <b>4,40</b>                  |
| <b>Schwedische Krone</b>                           |                           |                   |                              |
| 84.392   | Assa Abloy AB Class B     | 2.495.922         | 1,78                         |
| 103.634  | Atlas Copco AB Class A    | 1.583.716         | 1,13                         |
| <b>Schwedische Krone insgesamt</b>                 |                           | <b>4.079.638</b>  | <b>2,91</b>                  |
| <b>Schweizer Franken</b>                           |                           |                   |                              |
| 39.964   | Nestle SA                 | 3.283.478         | 2,34                         |
| 2.079  | Partners Group Holding AG | 2.827.943         | 2,01                         |
| 15.494   | Straumann Holding AG      | 1.954.447         | 1,39                         |
| <b>Schweizer Franken insgesamt</b>                 |                           | <b>8.065.868</b>  | <b>5,74</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>                                   |                           |                   |                              |
| 21.058   | Abbott Laboratories       | 2.381.870         | 1,70                         |
| 6.348  | Adobe Inc                 | 2.822.829         | 2,01                         |
| 45.012   | Alphabet Inc Class A      | 8.520.772         | 6,07                         |

## Global Sustainable Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile  | Wertpapierbezeichnung                         | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Nettover-<br>mögens           |
|---|---|--------------------|--|
| <b>Aktien 99,44 % (31. Dezember 2023: 99,37 %) (Fortsetzung)</b>  |   |                    |  |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>  |   |                    |  |
| 38.071  | Amazon.com Inc                                | 8.352.397          | 5,95                                   |
| 12.053  | Applied Materials Inc                         | 1.960.179          | 1,40                                   |
| 13.278  | Broadcom Inc                                  | 3.078.371          | 2,19                                   |
| 33.331  | Brown & Brown Inc                             | 3.400.429          | 2,42                                   |
| 25.744  | CoStar Group Inc                              | 1.843.013          | 1,31                                   |
| 7.072   | Danaher Corp                                  | 1.623.378          | 1,16                                   |
| 2.743   | Eli Lilly & Co                                | 2.117.596          | 1,51                                   |
| 3.140   | Kinsale Capital Group Inc                     | 1.460.508          | 1,04                                   |
| 5.149   | Mastercard Inc Class A                        | 2.711.309          | 1,93                                   |
| 29.320  | Microsoft Corp                                | 12.358.380         | 8,80                                   |
| 4.833   | Moody's Corp                                  | 2.287.797          | 1,63                                   |
| 5.453   | MSCI Inc Class A                              | 3.271.855          | 2,33                                   |
| 48.781  | Nasdaq Inc                                    | 3.771.259          | 2,68                                   |
| 4.833   | Netflix Inc                                   | 4.307.750          | 3,07                                   |
| 38.948  | NIKE Inc Class B                              | 2.947.195          | 2,10                                   |
| 5.522   | Nordson Corp                                  | 1.155.423          | 0,82                                   |
| 63.325  | NVIDIA Corp                                   | 8.503.914          | 6,06                                   |
| 4.385   | Spotify Technology SA                         | 1.961.761          | 1,40                                   |
| 24.448  | Starbucks Corp                                | 2.230.880          | 1,59                                   |
| 15.601  | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR | 3.081.041          | 2,19                                   |
| 5.485   | Thermo Fisher Scientific Inc                  | 2.853.462          | 2,03                                   |
| 39.933  | Uber Technologies Inc                         | 2.408.759          | 1,71                                   |
| 6.048   | UniteHealth Group Inc                         | 3.059.441          | 2,18                                   |
| 8.085   | Visa Inc Class A                              | 2.555.183          | 1,82                                   |
| 13.632  | Zoetis Inc Class A                            | 2.221.062          | 1,58                                   |
|   | <b>US-Dollar insgesamt</b>                    | <b>99.247.813</b>  | <b>70,68</b>                           |
|   | <b>Aktien insgesamt *</b>                     | <b>139.635.830</b> | <b>99,44</b>                           |
|   | <b>Anlagen insgesamt</b>                      | <b>139.635.830</b> | <b>99,44</b>                           |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>  |   | <b>139.635.830</b> | <b>99,44</b>                           |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>            |   | <b>139.635.830</b> | <b>99,44</b>                           |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  |   | <b>788.865</b>     | <b>0,56</b>                            |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                 |   | <b>140.424.695</b> | <b>100,00</b>                          |
| <b>Portfolioanalyse</b>   |   | <b>US\$</b>        | <b>% des<br/>Gesamtver-<br/>mögens</b> |
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind |   | 139.635.830        | 99,13                                  |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  |   | <b>139.635.830</b> | <b>99,13</b>                           |

## Global Value - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der Anteile                                 | Wertpapierbezeichnung                           | Zeitwert US\$    | % des Nettovermögens |
|--|---|------------------|----------------------|
| <b>Aktien 98,34 % (31. Dezember 2023: 97,01 %)</b> |   |                  |                      |
| <b>Australischer Dollar</b>                        |   |                  |                      |
| 9.239  | BHP Group Ltd*                                  | 226.239          | 0,49                 |
| 22.629   | Brambles Ltd*                                   | 269.567          | 0,58                 |
| 7.295  | Computershare Ltd*                              | 153.342          | 0,33                 |
| 222  | CSL Ltd*  | 38.703           | 0,08                 |
| 8.845  | Northern Star Resources Ltd*                    | 84.555           | 0,18                 |
| 17.732   | Telstra Group Ltd*                              | 44.025           | 0,09                 |
| 1.956  | Wesfarmers Ltd*                                 | 86.627           | 0,19                 |
| <b>Australischer Dollar insgesamt</b>              |   | <b>903.058</b>   | <b>1,94</b>          |
| <b>Brasilianischer Real</b>                        |   |                  |                      |
| 36.986   | Ambev SA*                                       | 70.328           | 0,15                 |
| 24.255   | B3 SA - Brasil Bolsa Balcao*                    | 40.304           | 0,08                 |
| 10.435   | Banco do Brasil SA*                             | 40.464           | 0,09                 |
| 21.311   | BB Seguridade Participacoes SA*                 | 124.942          | 0,27                 |
| 5.583  | Itausa SA*                                      | 7.976            | 0,02                 |
| 17.584   | WEG SA*   | 150.041          | 0,32                 |
| <b>Brasilianischer Real insgesamt</b>              |   | <b>434.055</b>   | <b>0,93</b>          |
| <b>Kanadischer Dollar</b>                          |   |                  |                      |
| 885  | Canadian Imperial Bank of Commerce*             | 55.954           | 0,12                 |
| 856  | CCL Industries Inc Class B**                    | 44.014           | 0,09                 |
| 1.250  | CGI Inc*  | 136.699          | 0,29                 |
| 1.633  | Empire Co Ltd Class A*                          | 49.835           | 0,10                 |
| 1.531  | George Weston Ltd**                             | 237.964          | 0,51                 |
| 3.263  | Gildan Activewear Inc Class A*                  | 153.485          | 0,33                 |
| 1.493  | IGM Financial Inc**                             | 47.659           | 0,10                 |
| 10.561   | Kinross Gold Corp*                              | 98.032           | 0,21                 |
| 3.004  | Loblaw Cos Ltd**                                | 395.123          | 0,85                 |
| 20.150   | Manulife Financial Corp*                        | 618.707          | 1,33                 |
| 3.810  | Metro Inc**                                     | 238.820          | 0,51                 |
| <b>Kanadischer Dollar insgesamt</b>                |   | <b>2.076.292</b> | <b>4,44</b>          |
| <b>Euro</b>  |   |                  |                      |
| 908  | ACS Actividades de Construccion y Servicios SA* | 45.545           | 0,10                 |
| 8.581  | AIB Group Plc*                                  | 47.360           | 0,10                 |
| 484  | Allianz SE*                                     | 148.300          | 0,32                 |
| 1.288  | AXA SA*   | 45.773           | 0,10                 |
| 25.584   | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA*             | 250.405          | 0,54                 |
| 1.102  | Cie de Saint-Gobain SA*                         | 97.794           | 0,21                 |
| 11.231   | Cie Generale des Etablissements Michelin SCA*   | 369.825          | 0,79                 |

## Global Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile   | Wertpapierbezeichnung                                 | Zeitwert US\$    | % des Nettovermögens |
|--|---|------------------|----------------------|
| <b>Aktien 98,34 % (31. Dezember 2023: 97,01 %) (Fortsetzung)</b> |   |                  |                      |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |   |                  |                      |
| 5.455  | Deutsche Telekom AG*                                  | 163.190          | 0,35                 |
| 566  | Eiffage SA*   | 49.654           | 0,11                 |
| 6.842  | Enel SpA*   | 48.809           | 0,10                 |
| 5.431  | Engie SA*   | 86.100           | 0,18                 |
| 29.273   | Iberdrola SA*   | 403.152          | 0,86                 |
| 1.976  | Industria de Diseno Textil SA*                        | 101.571          | 0,22                 |
| 140.892  | Intesa Sanpaolo SpA*                                  | 564.902          | 1,21                 |
| 7.317  | Nordea Bank Abp*                                      | 79.807           | 0,17                 |
| 2.120  | OMV AG*   | 81.971           | 0,18                 |
| 172  | SAP SE*   | 42.086           | 0,09                 |
| 9.874  | TotalEnergies SE*                                     | 545.683          | 1,17                 |
| 3.478  | UniCredit SpA*  | 139.241          | 0,30                 |
| 214  | Wolters Kluwer NV*                                    | 35.544           | 0,08                 |
| <b>Euro insgesamt</b>  |   | <b>3.346.712</b> | <b>7,18</b>          |
| <b>Hongkong-Dollar</b>   |   |                  |                      |
| 178.000  | Agricultural Bank of China Ltd - H Shares*            | 101.512          | 0,22                 |
| 40.900   | Alibaba Group Holding Ltd*                            | 433.855          | 0,93                 |
| 373.000  | Bank of China Ltd - H Shares*                         | 190.631          | 0,41                 |
| 57.500   | BOC Hong Kong Holdings Ltd*                           | 184.685          | 0,40                 |
| 500  | BYD Co Ltd - H Shares*                                | 17.160           | 0,04                 |
| 370.000  | China Construction Bank Corp - H Shares*              | 308.653          | 0,66                 |
| 17.000   | China Life Insurance Co Ltd - H Shares*               | 32.127           | 0,07                 |
| 4.500  | China Overseas Land & Investment Ltd*                 | 7.183            | 0,02                 |
| 13.000   | CITIC Ltd*  | 15.414           | 0,03                 |
| 8.500  | CK Hutchison Holdings Ltd*                            | 45.411           | 0,10                 |
| 78.000   | CSPC Pharmaceutical Group Ltd*                        | 47.997           | 0,10                 |
| 30.000   | Geely Automobile Holdings Ltd*                        | 57.235           | 0,12                 |
| 7.000  | Great Wall Motor Co Ltd - H Shares*                   | 12.310           | 0,03                 |
| 233.000  | Industrial & Commercial Bank of China Ltd - H Shares* | 156.274          | 0,33                 |
| 5.500  | JD.com Inc Class A*                                   | 96.293           | 0,21                 |
| 22.500   | Longfor Group Holdings Ltd*                           | 28.965           | 0,06                 |
| 3.600  | NetEase Inc*  | 64.140           | 0,14                 |
| 19.000   | Ping An Insurance Group Co of China Ltd - H Shares*   | 112.636          | 0,24                 |
| 2.800  | Sinopharm Group Co Ltd - H Shares*                    | 7.678            | 0,02                 |
| 5.000  | Swire Pacific Ltd Class A*                            | 45.347           | 0,09                 |
| 2.600  | Tencent Holdings Ltd*                                 | 139.574          | 0,30                 |
| <b>Hongkong-Dollar insgesamt</b>                                 |   | <b>2.105.080</b> | <b>4,52</b>          |
| <b>Japanischer Yen</b>   |   |                  |                      |
| 6.400  | Asahi Kasei Corp*                                     | 44.149           | 0,09                 |

## Global Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile   | Wertpapierbezeichnung                       | Zeitwert US\$    | % des Nettovermögens |
|--|---|------------------|----------------------|
| <b>Aktien 98,34 % (31. Dezember 2023: 97,01 %) (Fortsetzung)</b> |   |                  |                      |
| <b>Japanischer Yen (Fortsetzung)</b>                             |   |                  |                      |
| 9.200  | Canon Inc*                                  | 299.183          | 0,64                 |
| 2.600  | Dai Nippon Printing Co Ltd*                 | 36.426           | 0,08                 |
| 9.600  | Isuzu Motors Ltd*                           | 130.746          | 0,28                 |
| 1.700  | ITOCHU Corp*                                | 83.695           | 0,18                 |
| 12.700   | KDDI Corp*                                  | 404.979          | 0,87                 |
| 4.000  | MS&AD Insurance Group Holdings Inc*         | 86.492           | 0,18                 |
| 6.400  | Nitto Denko Corp*                           | 107.126          | 0,23                 |
| 8.000  | ORIX Corp*                                  | 172.074          | 0,37                 |
| 3.200  | Sekisui Chemical Co Ltd*                    | 54.856           | 0,12                 |
| 2.900  | Shionogi & Co Ltd*                          | 40.721           | 0,09                 |
| 11.100   | Sompo Holdings Inc*                         | 287.942          | 0,62                 |
| 3.200  | Sumitomo Electric Industries Ltd*           | 57.275           | 0,12                 |
| 10.200   | Sumitomo Mitsui Financial Group Inc*        | 245.091          | 0,53                 |
| 1.900  | TIS Inc*                                    | 44.931           | 0,10                 |
| 2.600  | Tokio Marine Holdings Inc*                  | 93.419           | 0,20                 |
| <b>Japanischer Yen insgesamt</b>                                 |   | <b>2.189.105</b> | <b>4,70</b>          |
| <b>Mexikanischer Peso</b>  |   |                  |                      |
| 58.019   | America Movil SAB de CV*                    | 41.716           | 0,09                 |
| 1.645  | Grupo Financiero Banorte SAB de CV Class O* | 10.630           | 0,02                 |
| 15.408   | Grupo Mexico SAB de CV*                     | 73.569           | 0,16                 |
| <b>Mexikanischer Peso insgesamt</b>                              |   | <b>125.915</b>   | <b>0,27</b>          |
| <b>Neuer taiwanesischer Dollar</b>                               |   |                  |                      |
| 28.000   | ASE Technology Holding Co Ltd*              | 138.358          | 0,29                 |
| 15.492   | Chunghwa Telecom Co Ltd*                    | 58.359           | 0,13                 |
| 5.000  | Delta Electronics Inc*                      | 65.656           | 0,14                 |
| 11.650   | Fubon Financial Holding Co Ltd*             | 32.088           | 0,07                 |
| 30.000   | Hon Hai Precision Industry Co Ltd*          | 168.372          | 0,36                 |
| 4.624  | MediaTek Inc*                               | 199.575          | 0,43                 |
| 3.000  | Taiwan Mobile Co Ltd*                       | 10.386           | 0,02                 |
| 4.559  | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd*  | 149.489          | 0,32                 |
| 34.000   | Uni-President Enterprises Corp*             | 83.899           | 0,18                 |
| 32.000   | United Microelectronics Corp*               | 42.020           | 0,09                 |
| <b>Neuer taiwanesischer Dollar insgesamt</b>                     |   | <b>948.202</b>   | <b>2,03</b>          |
| <b>Norwegische Krone</b>   |   |                  |                      |
| 14.438   | Equinor ASA*                                | 343.241          | 0,74                 |
| <b>Norwegische Krone insgesamt</b>                               |   | <b>343.241</b>   | <b>0,74</b>          |

## Global Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile   | Wertpapierbezeichnung                   | Zeitwert US\$    | % des Nettovermögens |
|--|---|------------------|----------------------|
| <b>Aktien 98,34 % (31. Dezember 2023: 97,01 %) (Fortsetzung)</b> |   |                  |                      |
| <b>Britisches Pfund</b>  |   |                  |                      |
| 84.316   | BP Plc*                                 | 414.997          | 0,89                 |
| 2.575  | Coca-Cola HBC AG*                       | 88.105           | 0,19                 |
| 2.513  | GSK Plc*                                | 42.378           | 0,09                 |
| 25.581   | Kingfisher Plc*                         | 79.678           | 0,17                 |
| 1.834  | Next Plc*                               | 218.160          | 0,47                 |
| 1.821  | RELX Plc*                               | 82.764           | 0,18                 |
| 23.666   | Shell Plc*                              | 733.869          | 1,57                 |
| <b>Britisches Pfund insgesamt</b>                                |   | <b>1.659.951</b> | <b>3,56</b>          |
| <b>Singapur-Dollar</b>   |   |                  |                      |
| 26.200   | Oversea-Chinese Banking Corp Ltd*       | 320.538          | 0,69                 |
| <b>Singapur-Dollar insgesamt</b>                                 |   | <b>320.538</b>   | <b>0,69</b>          |
| <b>Südafrikanischer Rand</b>                                     |   |                  |                      |
| 3.019  | Absa Group Ltd*                         | 30.358           | 0,07                 |
| 2.519  | Gold Fields Ltd*                        | 32.986           | 0,07                 |
| 337  | Naspers Ltd Class N*                    | 74.529           | 0,16                 |
| 12.444   | Standard Bank Group Ltd*                | 146.242          | 0,31                 |
| <b>Südafrikanischer Rand insgesamt</b>                           |   | <b>284.115</b>   | <b>0,61</b>          |
| <b>Südkoreanischer Won</b>                                       |   |                  |                      |
| 38   | Hyundai Mobis Co Ltd*                   | 6.043            | 0,01                 |
| 1.530  | Kia Corp*                               | 103.534          | 0,22                 |
| 375  | Samsung C&T Corp*                       | 28.976           | 0,06                 |
| 109  | Samsung Fire & Marine Insurance Co Ltd* | 26.389           | 0,06                 |
| <b>Südkoreanischer Won insgesamt</b>                             |   | <b>164.942</b>   | <b>0,35</b>          |
| <b>Schwedische Krone</b>   |   |                  |                      |
| 4.841  | Investor AB Class B*                    | 128.393          | 0,27                 |
| 8.725  | Nordea Bank Abp*                        | 95.168           | 0,20                 |
| 4.365  | Svenska Handelsbanken AB Class A*       | 45.128           | 0,10                 |
| <b>Schwedische Krone insgesamt</b>                               |   | <b>268.689</b>   | <b>0,57</b>          |
| <b>Schweizer Franken</b>   |   |                  |                      |
| 1.861  | ABB Ltd*                                | 100.635          | 0,22                 |
| 5.780  | Novartis AG*                            | 563.533          | 1,21                 |
| 288  | Roche Holding AG*                       | 80.642           | 0,17                 |
| 496  | Zurich Insurance Group AG*              | 295.427          | 0,63                 |
| <b>Schweizer Franken insgesamt</b>                               |   | <b>1.040.237</b> | <b>2,23</b>          |

## Global Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile   | Wertpapierbezeichnung               | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|-------------------------------------|---------------|----------------------|
| <b>Aktien 98,34 % (31. Dezember 2023: 97,01 %) (Fortsetzung)</b> |                                     |               |                      |
| <b>US-Dollar</b>   |                                     |               |                      |
| 4.213  | AbbVie Inc*                         | 748.650       | 1,60                 |
| 1.627  | Accenture Plc Class A*              | 572.362       | 1,23                 |
| 1.047  | Aflac Inc*                          | 108.302       | 0,23                 |
| 355  | Agilent Technologies Inc*           | 47.691        | 0,10                 |
| 235  | Allstate Corp*                      | 45.306        | 0,10                 |
| 4.381  | Alphabet Inc Class A*               | 829.323       | 1,78                 |
| 2.710  | Alphabet Inc Class C*               | 516.093       | 1,11                 |
| 2.011  | American Express Co*                | 596.845       | 1,28                 |
| 1.251  | American International Group Inc*   | 91.073        | 0,20                 |
| 1.120  | Ameriprise Financial Inc*           | 596.321       | 1,28                 |
| 6.377  | Apple Inc*                          | 1.596.928     | 3,42                 |
| 3.153  | Applied Materials Inc*              | 512.772       | 1,10                 |
| 18.583   | AT&T Inc*                           | 423.135       | 0,91                 |
| 207  | Avery Dennison Corp*                | 38.736        | 0,08                 |
| 5.078  | Baker Hughes Co Class A*            | 208.299       | 0,45                 |
| 7.939  | Bank of America Corp*               | 348.919       | 0,75                 |
| 144  | Booking Holdings Inc*               | 715.452       | 1,54                 |
| 3.986  | Bristol-Myers Squibb Co*            | 225.448       | 0,48                 |
| 280  | Cardinal Health Inc*                | 33.115        | 0,07                 |
| 2.258  | Caterpillar Inc*                    | 819.112       | 1,76                 |
| 229  | Cboe Global Markets Inc*            | 44.747        | 0,10                 |
| 394  | Cencora Inc*                        | 88.524        | 0,19                 |
| 775  | Chipotle Mexican Grill Inc Class A* | 46.732        | 0,10                 |
| 1.301  | Chubb Ltd*                          | 359.466       | 0,77                 |
| 1.661  | Cigna Corp*                         | 458.669       | 0,98                 |
| 301  | Cincinnati Financial Corp*          | 43.254        | 0,09                 |
| 238  | Cintas Corp*                        | 43.482        | 0,09                 |
| 3.091  | Cisco Systems Inc*                  | 182.987       | 0,39                 |
| 4.738  | Citigroup Inc*                      | 333.508       | 0,72                 |
| 504  | Colgate-Palmolive Co*               | 45.819        | 0,10                 |
| 13.888   | Comcast Corp Class A*               | 521.217       | 1,12                 |
| 5.831  | Conagra Brands Inc*                 | 161.810       | 0,35                 |
| 4.040  | CRH Plc*                            | 373.781       | 0,80                 |
| 7.746  | CSX Corp*                           | 249.964       | 0,54                 |
| 1.028  | Cummins Inc*                        | 358.361       | 0,77                 |
| 308  | Deckers Outdoor Corp*               | 62.552        | 0,13                 |
| 484  | Dover Corp*                         | 90.798        | 0,19                 |
| 1.046  | DR Horton Inc*                      | 146.252       | 0,31                 |
| 5.205  | eBay Inc*                           | 322.450       | 0,69                 |
| 182  | Ecolab Inc*                         | 42.646        | 0,09                 |
| 6.272  | Edison International*               | 500.756       | 1,07                 |

## Global Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile   | Wertpapierbezeichnung                  | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|--|---------------|----------------------|
| <b>Aktien 98,34 % (31. Dezember 2023: 97,01 %) (Fortsetzung)</b> |  |               |                      |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>                                   |  |               |                      |
| 2.418  | Electronic Arts Inc*                   | 353.753       | 0,76                 |
| 312  | EMCOR Group Inc*                       | 141.617       | 0,30                 |
| 429  | F5 Inc*                                | 107.881       | 0,23                 |
| 2.084  | Fifth Third Bancorp*                   | 88.111        | 0,19                 |
| 262  | Fiserv Inc*                            | 53.820        | 0,12                 |
| 1.149  | Fox Corp Class A*                      | 55.818        | 0,12                 |
| 6.558  | Fox Corp Class B*                      | 299.963       | 0,64                 |
| 10.662   | Gen Digital Inc*                       | 291.925       | 0,63                 |
| 7.814  | General Mills Inc*                     | 498.299       | 1,07                 |
| 5.058  | General Motors Co*                     | 269.439       | 0,58                 |
| 5.508  | Gilead Sciences Inc*                   | 508.774       | 1,09                 |
| 8.591  | Halliburton Co*                        | 233.589       | 0,50                 |
| 5.235  | Hartford Financial Services Group Inc* | 572.709       | 1,23                 |
| 1.303  | HCA Healthcare Inc*                    | 391.095       | 0,84                 |
| 333  | Home Depot Inc*                        | 129.533       | 0,28                 |
| 829  | Honeywell International Inc*           | 187.263       | 0,40                 |
| 1.269  | HP Inc*                                | 41.408        | 0,09                 |
| 1.922  | International Business Machines Corp*  | 422.513       | 0,91                 |
| 140  | Intuit Inc*                            | 87.990        | 0,19                 |
| 1.301  | Jacobs Solutions Inc*                  | 173.840       | 0,37                 |
| 4.550  | Johnson & Johnson*                     | 658.021       | 1,41                 |
| 1.466  | JPMorgan Chase & Co*                   | 351.415       | 0,75                 |
| 541  | KE Holdings Inc ADR*                   | 9.965         | 0,02                 |
| 1.728  | Kimberly-Clark Corp*                   | 226.437       | 0,49                 |
| 262  | KLA Corp*                              | 165.092       | 0,36                 |
| 418  | Kroger Co*                             | 25.561        | 0,06                 |
| 3.377  | Lam Research Corp*                     | 243.921       | 0,52                 |
| 1.240  | Leidos Holdings Inc*                   | 178.634       | 0,38                 |
| 798  | Lennar Corp Class A*                   | 108.823       | 0,23                 |
| 298  | Linde Plc*                             | 124.764       | 0,27                 |
| 875  | Lockheed Martin Corp*                  | 425.198       | 0,91                 |
| 851  | Lowe's Cos Inc*                        | 210.027       | 0,45                 |
| 3.933  | Masco Corp*                            | 285.418       | 0,61                 |
| 641  | Mastercard Inc Class A*                | 337.531       | 0,72                 |
| 157  | McKesson Corp*                         | 89.476        | 0,19                 |
| 6.806  | Medtronic Plc*                         | 543.663       | 1,16                 |
| 440  | Meta Platforms Inc Class A*            | 257.624       | 0,55                 |
| 1.010  | Microsoft Corp*                        | 425.715       | 0,91                 |
| 1.310  | Morgan Stanley*                        | 164.693       | 0,35                 |
| 336  | Motorola Solutions Inc*                | 155.309       | 0,33                 |
| 1.635  | NetApp Inc*                            | 189.791       | 0,41                 |

## Global Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile   | Wertpapierbezeichnung             | Zeitwert US\$     | % des Nettovermögens |
|--|-----------------------------------|-------------------|----------------------|
| <b>Aktien 98,34 % (31. Dezember 2023: 97,01 %) (Fortsetzung)</b> |                                   |                   |                      |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>                                   |                                   |                   |                      |
| 1.187  | NextEra Energy Inc*               | 85.096            | 0,18                 |
| 10   | NVR Inc*                          | 81.789            | 0,18                 |
| 1.549  | NXP Semiconductors NV*            | 321.960           | 0,69                 |
| 9.053  | Occidental Petroleum Corp*        | 447.309           | 0,96                 |
| 1.543  | Owens Corning*                    | 262.804           | 0,57                 |
| 444  | PDD Holdings Inc ADR*             | 43.064            | 0,09                 |
| 2.098  | PNC Financial Services Group Inc* | 404.599           | 0,86                 |
| 125  | PPG Industries Inc*               | 14.931            | 0,03                 |
| 2.038  | Procter & Gamble Co*              | 341.671           | 0,73                 |
| 2.689  | PulteGroup Inc*                   | 292.832           | 0,63                 |
| 4.212  | QUALCOMM Inc*                     | 647.047           | 1,39                 |
| 3.665  | Regions Financial Corp*           | 86.201            | 0,18                 |
| 307  | Reliance Inc*                     | 82.663            | 0,18                 |
| 383  | ResMed Inc*                       | 87.588            | 0,19                 |
| 1.510  | RPM International Inc*            | 185.821           | 0,40                 |
| 191  | S&P Global Inc*                   | 95.124            | 0,20                 |
| 2.364  | Schlumberger NV*                  | 90.636            | 0,19                 |
| 1.176  | SEI Investments Co*               | 96.997            | 0,21                 |
| 125  | Sherwin-Williams Co*              | 42.491            | 0,09                 |
| 127  | Snap-on Inc*                      | 43.114            | 0,09                 |
| 112  | Southern Copper Corp*             | 10.207            | 0,02                 |
| 668  | SS&C Technologies Holdings Inc*   | 50.621            | 0,11                 |
| 1.008  | Steel Dynamics Inc*               | 114.982           | 0,25                 |
| 2.457  | Synchrony Financial*              | 159.705           | 0,34                 |
| 483  | Sysco Corp*                       | 36.930            | 0,08                 |
| 699  | TE Connectivity Plc*              | 99.936            | 0,21                 |
| 54   | Thermo Fisher Scientific Inc*     | 28.092            | 0,06                 |
| 1.710  | Tractor Supply Co*                | 90.733            | 0,19                 |
| 461  | Travelers Cos Inc*                | 111.050           | 0,24                 |
| 375  | Union Pacific Corp*               | 85.515            | 0,18                 |
| 405  | United Rentals Inc*               | 285.298           | 0,61                 |
| 260  | UnitedHealth Group Inc*           | 131.524           | 0,28                 |
| 971  | US Bancorp*                       | 46.443            | 0,10                 |
| 5.800  | Verizon Communications Inc*       | 231.942           | 0,50                 |
| 246  | Visa Inc Class A*                 | 77.746            | 0,17                 |
| 5.053  | Wells Fargo & Co*                 | 354.923           | 0,76                 |
| 4.404  | Williams Cos Inc*                 | 238.344           | 0,50                 |
| 75   | WW Grainger Inc*                  | 79.054            | 0,17                 |
| 249  | Zoetis Inc Class A*               | 40.570            | 0,09                 |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>                                       |                                   | <b>29.665.427</b> | <b>63,58</b>         |
| <b>Aktien insgesamt</b>  |                                   | <b>45.875.559</b> | <b>98,34</b>         |

## Global Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile   | Wertpapierbezeichnung    | Zeitwert US\$     | % des Nettovermögens |
|--|--------------------------|-------------------|----------------------|
| <b>Immobilienaktiengesellschaften 1,70 % (31. Dezember 2023: 2,02 %)</b> |                          |                   |                      |
| <b>Euro</b>  |                          |                   |                      |
| 3.510  | Klepierre SA             | 101.042           | 0,22                 |
| <b>Euro insgesamt</b>  |                          | <b>101.042</b>    | <b>0,22</b>          |
| <b>US-Dollar</b>   |                          |                   |                      |
| 3.173  | Equity Residential       | 227.695           | 0,49                 |
| 2.686  | Simon Property Group Inc | 462.556           | 0,99                 |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |                          | <b>690.251</b>    | <b>1,48</b>          |
| <b>Immobilienaktiengesellschaften insgesamt *</b>                        |                          | <b>791.293</b>    | <b>1,70</b>          |
| <b>Anlagen insgesamt</b>   |                          | <b>46.666.852</b> | <b>100,04</b>        |

Devisenterminkontrakte 0,17 % (31. Dezember 2023: 0,12 %)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens        |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|-----------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 12.600 US\$  | 11.835 €            | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 3         | 339                            | 0,00                        |
| 34.457 US\$  | 32.487 €            | 16.01.2025       | UBS AG                      | 7         | 798                            | 0,00                        |
| 1.288.939 US\$   | 1.170.531 €         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 9         | 76.210                         | 0,17                        |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>                        |                     |                  |                             |           | <b>77.347</b>                  | <b>0,17</b>                 |
|  |                     |                  |                             |           | <b>Zeitwert US\$</b>           | <b>% des Nettovermögens</b> |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |                     |                  |                             |           | <b>46.744.199</b>              | <b>100,21</b>               |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,23 %) (31. Dezember 2023: (0,08 %))

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens        |
|---|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|-----------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                             |
| 18.186 €  | 19.740 US\$         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 4         | (898)                           | (0,00)                      |
| 11.677 €  | 12.653 US\$         | 16.01.2025       | UBS AG                      | 3         | (555)                           | (0,00)                      |
| 1.590.033 €   | 1.752.116 US\$      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 13        | (104.763)                       | (0,23)                      |
| 3.263 US\$  | 3.151 €             | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | (1)                             | (0,00)                      |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>                          |                     |                  |                             |           | <b>(106.217)</b>                | <b>(0,23)</b>               |
|   |                     |                  |                             |           | <b>Zeitwert US\$</b>            | <b>% des Nettovermögens</b> |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> |                     |                  |                             |           | <b>(106.217)</b>                | <b>(0,23)</b>               |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              |                     |                  |                             |           | <b>46.637.982</b>               | <b>99,98</b>                |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  |                     |                  |                             |           | <b>7.794</b>                    | <b>0,02</b>                 |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   |                     |                  |                             |           | <b>46.645.776</b>               | <b>100,00</b>               |

## Global Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

| Portfolioanalyse  | US\$              | % des<br>Gesamtver-<br>mögens |
|---|-------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 45.703.272        | 95,39                         |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden            | 963.580           | 2,01                          |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente   | (28.870)          | (0,06)                        |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>46.637.982</b> | <b>97,34</b>                  |

## High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag  | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 1,55 % (31. Dezember 2023: 0,49 %)</b> |   |         |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar</b>  |   |         |                       |                   |                              |
| 2.000.000   | 1988 CLO 5 Ltd Series 2024-5X Class D1                            | 7,60 %  | 15.07.2037            | 2.041.850         | 0,11                         |
| 1.000.000   | AB BSL CLO 3 Ltd Series 2021-3X Class E                           | 11,50 % | 20.10.2034            | 1.010.479         | 0,05                         |
| 3.000.000   | Ballyrock CLO 28 Ltd Series 2024-28X Class D                      | 9,33 %  | 20.01.2038            | 3.058.820         | 0,16                         |
| 1.000.000   | GoldenTree Loan Management US CLO 19 Ltd Series 2024-19X Class E  | 10,29 % | 20.04.2037            | 1.023.039         | 0,05                         |
| 2.000.000   | GoldenTree Loan Management US CLO 23 Ltd Series 2024-23X Class D  | 6,93 %  | 20.01.2039            | 2.007.880         | 0,11                         |
| 3.000.000   | GoldenTree Loan Management US CLO 23 Ltd Series 2024-23X Class E  | 9,33 %  | 20.01.2039            | 3.015.600         | 0,16                         |
| 1.000.000   | Hartwick Park CLO Ltd Series 2023-1X Class ER                     | 9,14 %  | 20.01.2037            | 1.005.200         | 0,05                         |
| 2.000.000   | Invesco US CLO 2024-2 Ltd Series 2024-2X Class E                  | 10,95 % | 15.07.2037            | 2.077.595         | 0,11                         |
| 1.500.000   | Invesco US CLO 2024-4 Ltd Series 2024-4X Class E                  | 9,42 %  | 15.01.2038            | 1.507.800         | 0,08                         |
| 1.000.000   | Midocean Credit CLO XV Ltd Series 2024-15X Class D                | 7,64 %  | 21.07.2037            | 1.024.557         | 0,05                         |
| 1.500.000   | Oaktree CLO 2024-25 Ltd Series 2024-25X Class E                   | 10,88 % | 20.04.2037            | 1.553.069         | 0,08                         |
| 3.000.000   | OCP CLO 2024-38 Ltd Series 2024-38X Class E                       | 9,50 %  | 21.01.2038            | 3.015.594         | 0,16                         |
| 1.500.000   | Symphony CLO 39 Ltd Series 2023-39X Class ER                      | 10,05 % | 25.01.2038            | 1.539.569         | 0,08                         |
| 1.500.000   | Trinitas CLO XXIX Ltd Series 2024-29X Class D1                    | 7,69 %  | 23.07.2037            | 1.525.227         | 0,08                         |
| 2.000.000   | Trinitas CLO XXXI Ltd Series 2024-31X Class D1                    | 7,38 %  | 22.01.2038            | 2.051.543         | 0,11                         |
| 2.000.000   | Voya CLO 2024-7 Ltd Series 2024-7X Class E                        | 9,54 %  | 20.01.2038            | 2.010.402         | 0,11                         |
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) insgesamt **</b>                       |   |         |                       | <b>29.468.224</b> | <b>1,55</b>                  |
| <b>Unternehmensanleihen 92,33 % (31. Dezember 2023: 88,78 %)</b>                          |   |         |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar</b>  |   |         |                       |                   |                              |
| 7.055.000   | 1011778 BC ULC/New Red Finance Inc**                              | 4,00 %  | 15.10.2030            | 6.315.938         | 0,33                         |
| 1.055.000   | 1011778 BC ULC/New Red Finance Inc**                              | 4,38 %  | 15.01.2028            | 1.008.663         | 0,05                         |
| 2.195.000   | Acadia Healthcare Co Inc**  | 5,50 %  | 01.07.2028            | 2.105.984         | 0,11                         |
| 5.805.000   | Acrisure LLC/Acrisure Finance Inc**                               | 7,50 %  | 06.11.2030            | 5.983.591         | 0,31                         |
| 3.250.000   | Acrisure LLC/Acrisure Finance Inc**                               | 8,25 %  | 01.02.2029            | 3.368.677         | 0,18                         |
| 770.000   | Acrisure LLC/Acrisure Finance Inc**                               | 8,50 %  | 15.06.2029            | 806.120           | 0,04                         |
| 700.000   | AdaptHealth LLC**   | 4,63 %  | 01.08.2029            | 630.330           | 0,03                         |
| 1.070.000   | AdaptHealth LLC**   | 6,13 %  | 01.08.2028            | 1.048.776         | 0,06                         |
| 1.500.000   | Adient Global Holdings Ltd**                                      | 4,88 %  | 15.08.2026            | 1.479.019         | 0,08                         |
| 4.625.000   | Adient Global Holdings Ltd**                                      | 8,25 %  | 15.04.2031            | 4.731.671         | 0,25                         |
| 2.530.000   | Advanced Drainage Systems Inc**                                   | 6,38 %  | 15.06.2030            | 2.541.823         | 0,13                         |
| 6.015.000   | Ahead DB Holdings LLC**   | 6,63 %  | 01.05.2028            | 5.902.240         | 0,31                         |
| 4.910.000   | Ahlstrom Holding 3 Oy*  | 4,88 %  | 04.02.2028            | 4.681.532         | 0,25                         |
| 2.200.000   | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC** | 3,50 %  | 15.03.2029            | 2.004.432         | 0,11                         |
| 2.080.000   | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC** | 4,88 %  | 15.02.2030            | 1.983.770         | 0,10                         |
| 1.540.000   | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC** | 6,50 %  | 15.02.2028            | 1.561.641         | 0,08                         |
| 1.615.000   | Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**    | 6,50 %  | 01.10.2031            | 1.601.068         | 0,08                         |
| 8.223.000   | Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**    | 6,75 %  | 15.10.2027            | 8.163.301         | 0,43                         |
| 3.305.000   | Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**    | 6,75 %  | 15.04.2028            | 3.323.941         | 0,17                         |

## High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 92,33 % (31. Dezember 2023: 88,78 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 1.895.000  | Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**              | 7,00 %  | 15.01.2031            | 1.904.477        | 0,10                         |
| 755.000  | Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**              | 7,38 %  | 01.10.2032            | 762.891          | 0,04                         |
| 6.310.000  | Allied Universal Holdco LLC**   | 7,88 %  | 15.02.2031            | 6.457.214        | 0,34                         |
| 6.815.000  | Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp**                 | 6,00 %  | 01.06.2029            | 6.216.859        | 0,33                         |
| 4.950.000  | Allwyn Entertainment Financing UK Plc**                                     | 7,88 %  | 30.04.2029            | 5.106.395        | 0,27                         |
| 2.025.000  | Ally Financial Inc*   | 6,70 %  | 14.02.2033            | 2.042.369        | 0,11                         |
| 7.200.000  | Alpha Generation LLC**  | 6,75 %  | 15.10.2032            | 7.130.158        | 0,38                         |
| 1.360.000  | Altice Financing SA**   | 5,00 %  | 15.01.2028            | 1.065.877        | 0,06                         |
| 2.335.000  | Altice Financing SA**   | 5,75 %  | 15.08.2029            | 1.711.829        | 0,09                         |
| 5.775.000  | Altice France SA**  | 5,50 %  | 15.01.2028            | 4.279.969        | 0,23                         |
| 4.085.000  | Altice France SA**  | 5,50 %  | 15.10.2029            | 3.080.139        | 0,16                         |
| 2.220.000  | Altice France SA**  | 8,13 %  | 01.02.2027            | 1.802.166        | 0,09                         |
| 2.500.000  | Amentum Holdings Inc**  | 7,25 %  | 01.08.2032            | 2.521.795        | 0,13                         |
| 855.000  | American Airlines Inc**   | 7,25 %  | 15.02.2028            | 877.147          | 0,05                         |
| 6.275.000  | American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd**                           | 5,75 %  | 20.04.2029            | 6.227.795        | 0,33                         |
| 1.301.000  | Amsted Industries Inc**   | 5,63 %  | 01.07.2027            | 1.294.903        | 0,07                         |
| 1.380.000  | Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp**                | 5,38 %  | 15.06.2029            | 1.344.884        | 0,07                         |
| 1.480.000  | Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp**                | 5,75 %  | 15.01.2028            | 1.469.359        | 0,08                         |
| 3.705.000  | Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp**                | 6,63 %  | 01.02.2032            | 3.734.540        | 0,20                         |
| 3.075.000  | Archrock Partners LP/Archrock Partners Finance Corp**                       | 6,25 %  | 01.04.2028            | 3.060.530        | 0,16                         |
| 3.995.000  | Archrock Partners LP/Archrock Partners Finance Corp**                       | 6,63 %  | 01.09.2032            | 3.993.805        | 0,21                         |
| 2.125.000  | Archrock Partners LP/Archrock Partners Finance Corp**                       | 6,88 %  | 01.04.2027            | 2.138.027        | 0,11                         |
| 3.425.000  | Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc** | 4,00 %  | 01.09.2029            | 2.945.990        | 0,15                         |
| 2.000.000  | Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc** | 6,00 %  | 15.06.2027            | 1.986.172        | 0,10                         |
| 1.785.000  | Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc**                      | 4,13 %  | 15.08.2026            | 1.608.428        | 0,08                         |
| 1.455.000  | Arsenal AIC Parent LLC**  | 8,00 %  | 01.10.2030            | 1.507.448        | 0,08                         |
| 1.290.000  | Arsenal AIC Parent LLC**  | 11,50 % | 01.10.2031            | 1.444.840        | 0,08                         |
| 5.065.000  | Artera Services LLC**   | 8,50 %  | 15.02.2031            | 4.887.279        | 0,26                         |
| 2.525.000  | Asbury Automotive Group Inc**   | 4,63 %  | 15.11.2029            | 2.353.347        | 0,12                         |
| 3.795.000  | Asbury Automotive Group Inc**   | 5,00 %  | 15.02.2032            | 3.466.030        | 0,18                         |
| 4.395.000  | Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**                      | 5,88 %  | 30.06.2029            | 4.284.490        | 0,23                         |
| 2.740.000  | Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**                      | 6,63 %  | 15.10.2032            | 2.726.188        | 0,14                         |
| 1.865.000  | Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**                      | 8,25 %  | 31.12.2028            | 1.905.331        | 0,10                         |
| 7.074.000  | ASGN Inc**  | 4,63 %  | 15.05.2028            | 6.724.683        | 0,35                         |
| 2.267.000  | Ashland Inc**   | 3,38 %  | 01.09.2031            | 1.941.315        | 0,10                         |
| 1.920.000  | Ashland Inc*  | 6,88 %  | 15.05.2043            | 2.012.047        | 0,11                         |
| 8.980.000  | AthenaHealth Group Inc**  | 6,50 %  | 15.02.2030            | 8.542.998        | 0,45                         |
| 2.120.000  | ATI Inc*  | 5,88 %  | 01.12.2027            | 2.103.125        | 0,11                         |
| 2.535.000  | ATI Inc*  | 7,25 %  | 15.08.2030            | 2.611.124        | 0,14                         |

## High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 92,33 % (31. Dezember 2023: 88,78 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 1.740.000  | Avient Corp**   | 6,25 %  | 01.11.2031            | 1.718.213        | 0,09                         |
| 5.505.000  | Avient Corp**   | 7,13 %  | 01.08.2030            | 5.646.913        | 0,30                         |
| 2.910.000  | Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV**                                     | 7,25 %  | 15.02.2031            | 3.015.007        | 0,16                         |
| 3.575.000  | Azorra Finance Ltd**  | 7,75 %  | 15.04.2030            | 3.557.795        | 0,19                         |
| 5.115.000  | Baldwin Insurance Group Holdings LLC/Baldwin Insurance Group Holdings Finance** | 7,13 %  | 15.05.2031            | 5.226.082        | 0,27                         |
| 4.580.000  | Bath & Body Works Inc**   | 6,63 %  | 01.10.2030            | 4.632.322        | 0,24                         |
| 1.365.000  | Bath & Body Works Inc*  | 6,95 %  | 01.03.2033            | 1.388.154        | 0,07                         |
| 7.825.000  | Bausch & Lomb Corp**  | 8,38 %  | 01.10.2028            | 8.108.656        | 0,43                         |
| 430.000  | Bausch Health Americas Inc**  | 8,50 %  | 31.01.2027            | 355.341          | 0,02                         |
| 520.000  | Bausch Health Americas Inc**  | 9,25 %  | 01.04.2026            | 498.852          | 0,03                         |
| 6.250.000  | Bausch Health Cos Inc**   | 4,88 %  | 01.06.2028            | 5.006.969        | 0,26                         |
| 3.495.000  | Bausch Health Cos Inc**   | 5,00 %  | 30.01.2028            | 2.387.504        | 0,13                         |
| 1.310.000  | Bausch Health Cos Inc**   | 5,25 %  | 15.02.2031            | 702.094          | 0,04                         |
| 2.140.000  | Bausch Health Cos Inc**   | 5,75 %  | 15.08.2027            | 1.864.229        | 0,10                         |
| 2.235.000  | Bausch Health Cos Inc**   | 6,13 %  | 01.02.2027            | 2.030.755        | 0,11                         |
| 4.590.000  | BCPE Empire Holdings Inc**  | 7,63 %  | 01.05.2027            | 4.579.001        | 0,24                         |
| 2.255.000  | Beacon Roofing Supply Inc**   | 4,13 %  | 15.05.2029            | 2.141.263        | 0,11                         |
| 3.210.000  | Beazer Homes USA Inc*   | 5,88 %  | 15.10.2027            | 3.171.026        | 0,17                         |
| 6.420.000  | Beazer Homes USA Inc**  | 7,50 %  | 15.03.2031            | 6.528.023        | 0,34                         |
| 985.000  | Benteler International AG**   | 10,50 % | 15.05.2028            | 1.036.476        | 0,05                         |
| 5.370.000  | Berry Global Inc**  | 5,63 %  | 15.07.2027            | 5.366.513        | 0,28                         |
| 1.785.000  | Blackstone Mortgage Trust Inc**   | 3,75 %  | 15.01.2027            | 1.701.725        | 0,09                         |
| 2.025.000  | Blackstone Mortgage Trust Inc**   | 7,75 %  | 01.12.2029            | 2.083.863        | 0,11                         |
| 8.190.000  | Block Inc**   | 6,50 %  | 15.05.2032            | 8.279.298        | 0,44                         |
| 2.400.000  | Bombardier Inc**  | 6,00 %  | 15.02.2028            | 2.392.316        | 0,13                         |
| 920.000  | Bombardier Inc**  | 7,00 %  | 01.06.2032            | 937.030          | 0,05                         |
| 3.315.000  | Bombardier Inc**  | 7,25 %  | 01.07.2031            | 3.422.824        | 0,18                         |
| 2.020.000  | Bombardier Inc**  | 8,75 %  | 15.11.2030            | 2.173.893        | 0,11                         |
| 7.670.000  | Boost Newco Borrower LLC**  | 7,50 %  | 15.01.2031            | 8.047.016        | 0,42                         |
| 834.146  | Borr IHC Ltd/Borr Finance LLC**   | 10,00 % | 15.11.2028            | 833.284          | 0,04                         |
| 704.078  | Borr IHC Ltd/Borr Finance LLC**   | 10,38 % | 15.11.2030            | 703.013          | 0,04                         |
| 4.205.000  | BroadStreet Partners Inc**  | 5,88 %  | 15.04.2029            | 4.089.749        | 0,22                         |
| 1.410.000  | Builders FirstSource Inc**  | 5,00 %  | 01.03.2030            | 1.345.114        | 0,07                         |
| 2.210.000  | Builders FirstSource Inc**  | 6,38 %  | 01.03.2034            | 2.183.891        | 0,11                         |
| 2.575.000  | Cable One Inc**   | 4,00 %  | 15.11.2030            | 2.154.433        | 0,11                         |
| 2.365.000  | Cablevision Lightpath LLC**   | 3,88 %  | 15.09.2027            | 2.250.227        | 0,12                         |
| 2.515.000  | Cablevision Lightpath LLC**   | 5,63 %  | 15.09.2028            | 2.348.158        | 0,12                         |
| 1.065.000  | Caesars Entertainment Inc**   | 4,63 %  | 15.10.2029            | 997.972          | 0,05                         |
| 1.900.000  | Caesars Entertainment Inc**   | 6,50 %  | 15.02.2032            | 1.910.124        | 0,10                         |
| 2.355.000  | Calderys Financing II LLC**   | 11,75 % | 01.06.2028            | 2.397.576        | 0,13                         |

## High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 92,33 % (31. Dezember 2023: 88,78 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 3.366.000  | Calderys Financing LLC**  | 11,25 % | 01.06.2028            | 3.607.147        | 0,19                         |
| 2.404.000  | Calpine Corp**  | 4,63 %  | 01.02.2029            | 2.271.394        | 0,12                         |
| 6.812.000  | Calpine Corp**  | 5,00 %  | 01.02.2031            | 6.410.735        | 0,34                         |
| 85.000   | Calpine Corp**  | 5,13 %  | 15.03.2028            | 82.502           | 0,00                         |
| 4.390.000  | Camelot Return Merger Sub Inc**   | 8,75 %  | 01.08.2028            | 4.211.495        | 0,22                         |
| 4.630.000  | Canpack SA/Canpack US LLC**   | 3,88 %  | 15.11.2029            | 4.173.572        | 0,22                         |
| 1.165.000  | Carnival Corp**   | 5,75 %  | 01.03.2027            | 1.163.287        | 0,06                         |
| 680.000  | Carnival Corp**   | 6,00 %  | 01.05.2029            | 678.911          | 0,04                         |
| 7.320.000  | Carnival Holdings Bermuda Ltd**   | 10,38 % | 01.05.2028            | 7.803.974        | 0,41                         |
| 28.000   | Carpenter Technology Corp*  | 6,38 %  | 15.07.2028            | 28.060           | 0,00                         |
| 5.125.000  | Carpenter Technology Corp*  | 7,63 %  | 15.03.2030            | 5.256.528        | 0,28                         |
| 3.090.050  | Carvana Co**  | 9,00 %  | 01.12.2028            | 3.302.365        | 0,17                         |
| 2.745.000  | Carvana Co**  | 13,00 % | 01.06.2030            | 3.016.679        | 0,16                         |
| 2.974.600  | Carvana Co**  | 14,00 % | 01.06.2031            | 3.569.468        | 0,19                         |
| 7.615.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                | 4,25 %  | 01.02.2031            | 6.645.956        | 0,35                         |
| 590.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                | 4,25 %  | 15.01.2034            | 479.343          | 0,03                         |
| 4.430.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                | 4,50 %  | 01.05.2032            | 3.815.638        | 0,20                         |
| 5.220.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                | 4,75 %  | 01.03.2030            | 4.772.757        | 0,25                         |
| 1.030.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                | 4,75 %  | 01.02.2032            | 905.162          | 0,05                         |
| 6.505.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                | 5,00 %  | 01.02.2028            | 6.275.625        | 0,33                         |
| 7.495.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                | 5,13 %  | 01.05.2027            | 7.371.071        | 0,39                         |
| 8.170.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                | 6,38 %  | 01.09.2029            | 8.109.228        | 0,43                         |
| 2.215.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                | 7,38 %  | 01.03.2031            | 2.259.540        | 0,12                         |
| 2.200.000  | Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co/Magnum Management Corp/Millennium Op** | 5,25 %  | 15.07.2029            | 2.116.324        | 0,11                         |
| 5.460.000  | Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co/Magnum Management Corp/Millennium Op** | 6,50 %  | 01.10.2028            | 5.494.234        | 0,29                         |
| 2.030.000  | Celanese US Holdings LLC*   | 6,60 %  | 15.11.2028            | 2.080.378        | 0,11                         |
| 2.015.000  | Celanese US Holdings LLC*   | 6,80 %  | 15.11.2030            | 2.086.784        | 0,11                         |
| 1.960.000  | Central Parent LLC/CDK Global II LLC/CDK Financing Co Inc**                 | 8,00 %  | 15.06.2029            | 1.998.014        | 0,11                         |
| 3.110.000  | Champions Financing Inc**   | 8,75 %  | 15.02.2029            | 3.035.856        | 0,16                         |
| 5.540.000  | Chart Industries Inc**  | 7,50 %  | 01.01.2030            | 5.766.738        | 0,30                         |
| 4.440.000  | Churchill Downs Inc**   | 5,50 %  | 01.04.2027            | 4.395.898        | 0,23                         |
| 7.310.000  | Churchill Downs Inc**   | 6,75 %  | 01.05.2031            | 7.398.202        | 0,39                         |
| 3.770.000  | Civitas Resources Inc**   | 8,38 %  | 01.07.2028            | 3.920.116        | 0,21                         |
| 1.430.000  | Civitas Resources Inc**   | 8,63 %  | 01.11.2030            | 1.498.863        | 0,08                         |
| 1.310.000  | Civitas Resources Inc**   | 8,75 %  | 01.07.2031            | 1.367.356        | 0,07                         |
| 2.155.000  | Clear Channel Outdoor Holdings Inc**  | 5,13 %  | 15.08.2027            | 2.076.791        | 0,11                         |
| 2.815.000  | Clear Channel Outdoor Holdings Inc**  | 7,88 %  | 01.04.2030            | 2.900.542        | 0,15                         |
| 1.915.000  | Clear Channel Outdoor Holdings Inc**  | 9,00 %  | 15.09.2028            | 2.013.691        | 0,11                         |
| 3.390.000  | Cleveland-Cliffs Inc**  | 6,88 %  | 01.11.2029            | 3.357.525        | 0,18                         |
| 5.930.000  | Cleveland-Cliffs Inc**  | 7,00 %  | 15.03.2032            | 5.831.329        | 0,31                         |

## High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung  | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 92,33 % (31. Dezember 2023: 88,78 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 4.545.000  | Cleveland-Cliffs Inc**   | 7,38 %  | 01.05.2033            | 4.469.494        | 0,24                         |
| 8.715.000  | Cloud Software Group Inc**   | 6,50 %  | 31.03.2029            | 8.564.997        | 0,45                         |
| 1.570.000  | Cloud Software Group Inc**   | 8,25 %  | 30.06.2032            | 1.620.233        | 0,09                         |
| 4.750.000  | Cloud Software Group Inc**   | 9,00 %  | 30.09.2029            | 4.828.583        | 0,25                         |
| 2.845.000  | Clydesdale Acquisition Holdings Inc**                                  | 6,88 %  | 15.01.2030            | 2.867.808        | 0,15                         |
| 2.050.000  | Clydesdale Acquisition Holdings Inc**                                  | 8,75 %  | 15.04.2030            | 2.081.886        | 0,11                         |
| 1.890.000  | CommScope LLC**  | 6,00 %  | 01.03.2026            | 1.882.912        | 0,10                         |
| 1.515.000  | CommScope LLC**  | 8,25 %  | 01.03.2027            | 1.450.683        | 0,08                         |
| 5.956.000  | CommScope LLC**  | 9,50 %  | 15.12.2031            | 6.181.375        | 0,33                         |
| 1.330.000  | CommScope Technologies LLC**   | 5,00 %  | 15.03.2027            | 1.190.529        | 0,06                         |
| 2.575.000  | Community Health Systems Inc**   | 4,75 %  | 15.02.2031            | 2.000.649        | 0,11                         |
| 320.000  | Community Health Systems Inc**   | 5,25 %  | 15.05.2030            | 263.126          | 0,01                         |
| 1.415.000  | Community Health Systems Inc**   | 5,63 %  | 15.03.2027            | 1.359.578        | 0,07                         |
| 1.555.000  | Community Health Systems Inc**   | 6,00 %  | 15.01.2029            | 1.394.044        | 0,07                         |
| 270.000  | Community Health Systems Inc**   | 6,13 %  | 01.04.2030            | 185.526          | 0,01                         |
| 270.000  | Community Health Systems Inc**   | 6,88 %  | 15.04.2029            | 204.251          | 0,01                         |
| 1.525.000  | Community Health Systems Inc**   | 10,88 % | 15.01.2032            | 1.575.292        | 0,08                         |
| 6.590.000  | Comstock Resources Inc**   | 5,88 %  | 15.01.2030            | 6.152.159        | 0,32                         |
| 2.599.000  | Comstock Resources Inc**   | 6,75 %  | 01.03.2029            | 2.536.189        | 0,13                         |
| 1.580.000  | Consolidated Communications Inc**                                      | 5,00 %  | 01.10.2028            | 1.472.143        | 0,08                         |
| 5.950.000  | Consolidated Communications Inc**                                      | 6,50 %  | 01.10.2028            | 5.739.479        | 0,30                         |
| 1.375.000  | Consolidated Energy Finance SA**                                       | 12,00 % | 15.02.2031            | 1.321.576        | 0,07                         |
| 4.475.000  | Constellium SE**   | 5,63 %  | 15.06.2028            | 4.398.105        | 0,23                         |
| 1.680.000  | Constellium SE**   | 6,38 %  | 15.08.2032            | 1.627.988        | 0,09                         |
| 1.575.000  | Cornerstone Building Brands Inc**                                      | 6,13 %  | 15.01.2029            | 1.258.330        | 0,07                         |
| 1.365.000  | Cornerstone Building Brands Inc**                                      | 9,50 %  | 15.08.2029            | 1.330.204        | 0,07                         |
| 3.680.000  | Coty Inc/HFC Prestige Products Inc/HFC Prestige International US LLC** | 6,63 %  | 15.07.2030            | 3.743.465        | 0,20                         |
| 6.435.000  | Cougar JV Subsidiary LLC**   | 8,00 %  | 15.05.2032            | 6.685.970        | 0,35                         |
| 5.270.000  | CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC**                               | 5,50 %  | 15.06.2031            | 5.037.634        | 0,27                         |
| 3.235.000  | CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC**                               | 7,50 %  | 15.12.2033            | 3.404.305        | 0,18                         |
| 2.590.000  | Crescent Energy Finance LLC**  | 7,38 %  | 15.01.2033            | 2.517.749        | 0,13                         |
| 1.710.000  | Crescent Energy Finance LLC**  | 7,63 %  | 01.04.2032            | 1.702.783        | 0,09                         |
| 1.890.000  | CSC Holdings LLC**   | 4,13 %  | 01.12.2030            | 1.364.710        | 0,07                         |
| 2.210.000  | CSC Holdings LLC**   | 4,63 %  | 01.12.2030            | 1.157.217        | 0,06                         |
| 2.405.000  | CSC Holdings LLC**   | 5,00 %  | 15.11.2031            | 1.255.138        | 0,07                         |
| 2.525.000  | CSC Holdings LLC**   | 5,38 %  | 01.02.2028            | 2.181.088        | 0,11                         |
| 3.410.000  | CSC Holdings LLC**   | 5,50 %  | 15.04.2027            | 3.055.768        | 0,16                         |
| 4.805.000  | CSC Holdings LLC**   | 5,75 %  | 15.01.2030            | 2.738.933        | 0,14                         |
| 2.310.000  | CSC Holdings LLC**   | 6,50 %  | 01.02.2029            | 1.948.035        | 0,10                         |
| 2.395.000  | CSC Holdings LLC**   | 7,50 %  | 01.04.2028            | 1.651.455        | 0,09                         |

## High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                    | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 92,33 % (31. Dezember 2023: 88,78 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 3.030.000  | CSC Holdings LLC**                                       | 11,25 % | 15.05.2028            | 2.993.906        | 0,16                         |
| 6.380.000  | CSC Holdings LLC**                                       | 11,75 % | 31.01.2029            | 6.304.723        | 0,33                         |
| 3.105.000  | Cushman & Wakefield US Borrower LLC**                    | 6,75 %  | 15.05.2028            | 3.110.724        | 0,16                         |
| 4.365.000  | Dealer Tire LLC/DT Issuer LLC**                          | 8,00 %  | 01.02.2028            | 4.292.511        | 0,23                         |
| 2.310.000  | DISH DBS Corp**  | 5,13 %  | 01.06.2029            | 1.489.117        | 0,08                         |
| 3.885.000  | DISH DBS Corp**  | 5,25 %  | 01.12.2026            | 3.538.559        | 0,19                         |
| 3.600.000  | DISH DBS Corp**  | 5,75 %  | 01.12.2028            | 3.084.730        | 0,16                         |
| 1.865.000  | DISH DBS Corp**  | 7,75 %  | 01.07.2026            | 1.570.886        | 0,08                         |
| 7.025.000  | DISH Network Corp**                                      | 11,75 % | 15.11.2027            | 7.449.289        | 0,39                         |
| 2.830.000  | Dornoch Debt Merger Sub Inc**                            | 6,63 %  | 15.10.2029            | 2.295.367        | 0,12                         |
| 985.378  | EchoStar Corp**  | 6,75 %  | 30.11.2030            | 895.087          | 0,05                         |
| 4.430.000  | EchoStar Corp**  | 10,75 % | 30.11.2029            | 4.768.277        | 0,25                         |
| 4.680.000  | Electricite de France SA**                               | 9,13 %  | 31.12.2149            | 5.290.525        | 0,28                         |
| 3.525.000  | Ellucian Holdings Inc**                                  | 6,50 %  | 01.12.2029            | 3.535.307        | 0,19                         |
| 4.110.000  | EMRLD Borrower LP/Emerald Co-Issuer Inc**                | 6,63 %  | 15.12.2030            | 4.120.618        | 0,22                         |
| 2.290.000  | EMRLD Borrower LP/Emerald Co-Issuer Inc**                | 6,75 %  | 15.07.2031            | 2.309.541        | 0,12                         |
| 2.265.000  | Encompass Health Corp*                                   | 4,63 %  | 01.04.2031            | 2.093.415        | 0,11                         |
| 4.330.000  | EnerSys**  | 6,63 %  | 15.01.2032            | 4.357.270        | 0,23                         |
| 960.000  | EQM Midstream Partners LP**                              | 6,38 %  | 01.04.2029            | 963.864          | 0,05                         |
| 1.630.000  | EQM Midstream Partners LP**                              | 7,50 %  | 01.06.2027            | 1.663.344        | 0,09                         |
| 2.165.000  | EQM Midstream Partners LP**                              | 7,50 %  | 01.06.2030            | 2.311.672        | 0,12                         |
| 2.823.000  | EquipmentShare.com Inc**                                 | 9,00 %  | 15.05.2028            | 2.931.934        | 0,15                         |
| 2.930.000  | FMG Resources August 2006 Pty Ltd**                      | 4,38 %  | 01.04.2031            | 2.640.043        | 0,14                         |
| 1.735.000  | FMG Resources August 2006 Pty Ltd**                      | 4,50 %  | 15.09.2027            | 1.680.308        | 0,09                         |
| 1.010.000  | FMG Resources August 2006 Pty Ltd**                      | 5,88 %  | 15.04.2030            | 993.513          | 0,05                         |
| 3.660.000  | FMG Resources August 2006 Pty Ltd**                      | 6,13 %  | 15.04.2032            | 3.618.564        | 0,19                         |
| 4.430.000  | Focus Financial Partners LLC**                           | 6,75 %  | 15.09.2031            | 4.417.270        | 0,23                         |
| 6.765.000  | Fortrea Holdings Inc**                                   | 7,50 %  | 01.07.2030            | 6.784.678        | 0,36                         |
| 4.705.000  | Fortress Intermediate 3 Inc**                            | 7,50 %  | 01.06.2031            | 4.803.433        | 0,25                         |
| 5.705.000  | Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC** | 7,00 %  | 01.05.2031            | 5.826.904        | 0,31                         |
| 2.510.000  | Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC** | 7,00 %  | 15.06.2032            | 2.562.535        | 0,13                         |
| 1.210.000  | Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC** | 7,88 %  | 01.12.2030            | 1.274.967        | 0,07                         |
| 2.310.000  | Foundation Building Materials Inc**                      | 6,00 %  | 01.03.2029            | 2.039.231        | 0,11                         |
| 1.685.000  | Freedom Mortgage Corp**                                  | 6,63 %  | 15.01.2027            | 1.687.054        | 0,09                         |
| 1.595.000  | Freedom Mortgage Holdings LLC**                          | 9,13 %  | 15.05.2031            | 1.646.551        | 0,09                         |
| 1.620.000  | Freedom Mortgage Holdings LLC**                          | 9,25 %  | 01.02.2029            | 1.673.391        | 0,09                         |
| 5.080.000  | Frontier Communications Holdings LLC**                   | 5,88 %  | 15.10.2027            | 5.067.808        | 0,27                         |
| 7.950.000  | Frontier Communications Holdings LLC**                   | 5,88 %  | 01.11.2029            | 7.912.784        | 0,42                         |
| 2.890.000  | Gap Inc**  | 3,63 %  | 01.10.2029            | 2.597.976        | 0,14                         |
| 1.260.000  | Gap Inc**  | 3,88 %  | 01.10.2031            | 1.090.769        | 0,06                         |

## High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 92,33 % (31. Dezember 2023: 88,78 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 1.075.000  | Garda World Security Corp**                          | 6,00 %  | 01.06.2029            | 1.020.309        | 0,05                         |
| 1.090.000  | Garda World Security Corp**                          | 7,75 %  | 15.02.2028            | 1.125.727        | 0,06                         |
| 3.485.000  | Garda World Security Corp**                          | 8,25 %  | 01.08.2032            | 3.545.879        | 0,19                         |
| 1.990.000  | Garda World Security Corp**                          | 8,38 %  | 15.11.2032            | 2.027.989        | 0,11                         |
| 2.425.000  | Gates Corp**   | 6,88 %  | 01.07.2029            | 2.469.785        | 0,13                         |
| 1.705.000  | Gen Digital Inc**                                    | 6,75 %  | 30.09.2027            | 1.732.176        | 0,09                         |
| 3.700.000  | Gen Digital Inc**                                    | 7,13 %  | 30.09.2030            | 3.811.869        | 0,20                         |
| 1.455.000  | Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp*       | 7,75 %  | 01.02.2028            | 1.458.128        | 0,08                         |
| 2.881.000  | Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp*       | 7,88 %  | 15.05.2032            | 2.824.152        | 0,15                         |
| 706.000  | Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp*       | 8,00 %  | 15.01.2027            | 718.972          | 0,04                         |
| 4.755.000  | Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp*       | 8,25 %  | 15.01.2029            | 4.806.639        | 0,25                         |
| 2.080.000  | GGAM Finance Ltd**                                   | 6,88 %  | 15.04.2029            | 2.111.396        | 0,11                         |
| 4.955.000  | Global Aircraft Leasing Co Ltd**                     | 8,75 %  | 01.09.2027            | 5.059.754        | 0,27                         |
| 1.440.000  | Global Infrastructure Solutions Inc**                | 5,63 %  | 01.06.2029            | 1.391.388        | 0,07                         |
| 2.925.000  | Go Daddy Operating Co LLC/GD Finance Co Inc**        | 5,25 %  | 01.12.2027            | 2.875.725        | 0,15                         |
| 5.300.000  | Goat Holdco LLC**                                    | 6,75 %  | 01.02.2032            | 5.254.075        | 0,28                         |
| 2.790.000  | goeasy Ltd**   | 6,88 %  | 15.05.2030            | 2.816.156        | 0,15                         |
| 1.495.000  | Goodyear Tire & Rubber Co**                          | 5,00 %  | 31.05.2026            | 1.472.606        | 0,08                         |
| 3.255.000  | Goodyear Tire & Rubber Co**                          | 5,00 %  | 15.07.2029            | 2.992.465        | 0,16                         |
| 5.405.000  | Goodyear Tire & Rubber Co**                          | 5,25 %  | 15.07.2031            | 4.846.749        | 0,25                         |
| 1.120.000  | Goodyear Tire & Rubber Co**                          | 5,63 %  | 30.04.2033            | 984.826          | 0,05                         |
| 1.390.000  | Graham Packaging Co Inc**                            | 7,13 %  | 15.08.2028            | 1.376.624        | 0,07                         |
| 2.915.000  | Greystar Real Estate Partners LLC**                  | 7,75 %  | 01.09.2030            | 3.082.489        | 0,16                         |
| 2.485.000  | Grifols SA**   | 4,75 %  | 15.10.2028            | 2.286.308        | 0,12                         |
| 4.285.000  | Group 1 Automotive Inc**                             | 6,38 %  | 15.01.2030            | 4.304.272        | 0,23                         |
| 2.965.000  | Gulfport Energy Operating Corp**                     | 6,75 %  | 01.09.2029            | 2.989.376        | 0,16                         |
| 6.080.000  | GYP Holdings III Corp**                              | 4,63 %  | 01.05.2029            | 5.739.864        | 0,30                         |
| 3.155.000  | HAH Group Holding Co LLC**                           | 9,75 %  | 01.10.2031            | 3.161.517        | 0,17                         |
| 6.350.000  | Harvest Midstream I LP**                             | 7,50 %  | 01.09.2028            | 6.412.014        | 0,34                         |
| 2.425.000  | Heartland Dental LLC/Heartland Dental Finance Corp** | 10,50 % | 30.04.2028            | 2.574.033        | 0,14                         |
| 2.375.000  | Herc Holdings Inc**                                  | 5,50 %  | 15.07.2027            | 2.353.986        | 0,12                         |
| 1.293.000  | Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co**             | 5,75 %  | 01.02.2029            | 1.234.826        | 0,06                         |
| 4.690.000  | Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co**             | 6,00 %  | 15.04.2030            | 4.431.111        | 0,23                         |
| 2.040.000  | Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co**             | 6,00 %  | 01.02.2031            | 1.894.237        | 0,10                         |
| 2.045.000  | Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co**             | 6,25 %  | 01.11.2028            | 1.982.217        | 0,10                         |
| 3.695.000  | Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co**             | 7,25 %  | 15.02.2035            | 3.477.052        | 0,18                         |
| 745.000  | Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co**             | 8,38 %  | 01.11.2033            | 761.206          | 0,04                         |
| 2.670.000  | Hillenbrand Inc*                                     | 3,75 %  | 01.03.2031            | 2.335.971        | 0,12                         |
| 1.590.000  | Hillenbrand Inc*                                     | 6,25 %  | 15.02.2029            | 1.590.954        | 0,08                         |
| 6.315.000  | Howard Midstream Energy Partners LLC**               | 7,38 %  | 15.07.2032            | 6.421.800        | 0,34                         |

## High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 92,33 % (31. Dezember 2023: 88,78 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 1.595.000  | Howden UK Refinance Plc/Howden UK Refinance 2 Plc/Howden US Refinance LLC**   | 7,25 %  | 15.02.2031            | 1.622.648        | 0,09                         |
| 1.735.000  | Howden UK Refinance Plc/Howden UK Refinance 2 Plc/Howden US Refinance LLC**   | 8,13 %  | 15.02.2032            | 1.773.800        | 0,09                         |
| 1.435.000  | HUB International Ltd**   | 5,63 %  | 01.12.2029            | 1.393.072        | 0,07                         |
| 7.305.000  | HUB International Ltd**   | 7,25 %  | 15.06.2030            | 7.493.617        | 0,39                         |
| 3.395.000  | HUB International Ltd**   | 7,38 %  | 31.01.2032            | 3.450.263        | 0,18                         |
| 1.974.000  | Hudbay Minerals Inc**   | 6,13 %  | 01.04.2029            | 1.983.568        | 0,10                         |
| 2.430.000  | IHO Verwaltungs GmbH**  | 6,38 %  | 15.05.2029            | 2.349.171        | 0,12                         |
| 965.000  | IHO Verwaltungs GmbH**  | 7,75 %  | 15.11.2030            | 964.538          | 0,05                         |
| 1.330.000  | IHO Verwaltungs GmbH**  | 8,00 %  | 15.11.2032            | 1.340.660        | 0,07                         |
| 5.735.000  | Iliad Holding SASU**  | 7,00 %  | 15.10.2028            | 5.816.526        | 0,31                         |
| 1.620.000  | Iliad Holding SASU**  | 7,00 %  | 15.04.2032            | 1.630.221        | 0,09                         |
| 4.624.000  | Illuminate Buyer LLC/Illuminate Holdings IV Inc**                             | 9,00 %  | 01.07.2028            | 4.686.407        | 0,25                         |
| 5.510.000  | Imola Merger Corp**   | 4,75 %  | 15.05.2029            | 5.229.654        | 0,28                         |
| 5.015.000  | INEOS Finance Plc*  | 6,75 %  | 15.05.2028            | 5.069.251        | 0,27                         |
| 2.905.000  | INEOS Finance Plc**   | 7,50 %  | 15.04.2029            | 2.977.253        | 0,16                         |
| 5.475.000  | Intelligent Packaging Ltd Finco Inc/Intelligent Packaging Ltd Co-Issuer LLC** | 6,00 %  | 15.09.2028            | 5.402.599        | 0,28                         |
| 1.755.000  | Iron Mountain Inc**   | 4,88 %  | 15.09.2029            | 1.669.262        | 0,09                         |
| 2.456.000  | Iron Mountain Inc**   | 5,25 %  | 15.03.2028            | 2.404.237        | 0,13                         |
| 2.050.000  | Iron Mountain Inc**   | 5,25 %  | 15.07.2030            | 1.958.436        | 0,10                         |
| 15.000   | Iron Mountain Inc**   | 5,63 %  | 15.07.2032            | 14.340           | 0,00                         |
| 3.720.000  | ITT Holdings LLC**  | 6,50 %  | 01.08.2029            | 3.409.132        | 0,18                         |
| 4.175.000  | Jane Street Group/JSG Finance Inc**   | 6,13 %  | 01.11.2032            | 4.139.100        | 0,22                         |
| 3.720.000  | Jane Street Group/JSG Finance Inc**   | 7,13 %  | 30.04.2031            | 3.826.008        | 0,20                         |
| 5.360.000  | JELD-WEN Inc**  | 4,88 %  | 15.12.2027            | 5.098.648        | 0,27                         |
| 2.880.000  | JELD-WEN Inc**  | 7,00 %  | 01.09.2032            | 2.676.528        | 0,14                         |
| 2.295.000  | Jones Deslauriers Insurance Management Inc**                                  | 10,50 % | 15.12.2030            | 2.485.152        | 0,13                         |
| 1.265.000  | Kaiser Aluminum Corp**  | 4,50 %  | 01.06.2031            | 1.116.604        | 0,06                         |
| 4.090.000  | Kaiser Aluminum Corp**  | 4,63 %  | 01.03.2028            | 3.850.139        | 0,20                         |
| 5.615.000  | KB Home**   | 7,25 %  | 15.07.2030            | 5.763.736        | 0,30                         |
| 5.970.000  | Kinetik Holdings LP**   | 5,88 %  | 15.06.2030            | 5.880.743        | 0,31                         |
| 2.035.000  | Kinetik Holdings LP**   | 6,63 %  | 15.12.2028            | 2.083.289        | 0,11                         |
| 4.485.000  | Knife River Corp**  | 7,75 %  | 01.05.2031            | 4.676.367        | 0,25                         |
| 3.975.000  | Ladder Capital Finance Holdings LLLP/Ladder Capital Finance Corp**            | 4,75 %  | 15.06.2029            | 3.752.096        | 0,20                         |
| 865.000  | Latam Airlines Group SA**   | 13,38 % | 15.10.2029            | 991.419          | 0,05                         |
| 2.850.000  | LCM Investments Holdings II LLC**   | 4,88 %  | 01.05.2029            | 2.665.001        | 0,14                         |
| 3.055.000  | LCM Investments Holdings II LLC**   | 8,25 %  | 01.08.2031            | 3.172.602        | 0,17                         |
| 2.550.000  | Leeward Renewable Energy Operations LLC**                                     | 4,25 %  | 01.07.2029            | 2.336.896        | 0,12                         |
| 1.510.000  | Level 3 Financing Inc**   | 3,75 %  | 15.07.2029            | 1.196.675        | 0,06                         |
| 1.975.000  | Level 3 Financing Inc**   | 4,50 %  | 01.04.2030            | 1.647.453        | 0,09                         |
| 2.870.000  | Level 3 Financing Inc**   | 4,88 %  | 15.06.2029            | 2.511.250        | 0,13                         |

## High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                     | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 92,33 % (31. Dezember 2023: 88,78 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 3.369.000  | Level 3 Financing Inc**                                   | 10,50 % | 15.05.2030            | 3.685.686        | 0,19                         |
| 2.620.000  | Level 3 Financing Inc**                                   | 10,75 % | 15.12.2030            | 2.936.107        | 0,15                         |
| 2.524.823  | Level 3 Financing Inc**                                   | 11,00 % | 15.11.2029            | 2.843.378        | 0,15                         |
| 719.000  | LGI Homes Inc**   | 4,00 %  | 15.07.2029            | 647.491          | 0,03                         |
| 6.386.000  | LGI Homes Inc**   | 7,00 %  | 15.11.2032            | 6.330.378        | 0,33                         |
| 5.045.000  | LifePoint Health Inc**                                    | 9,88 %  | 15.08.2030            | 5.449.644        | 0,29                         |
| 4.450.000  | LifePoint Health Inc**                                    | 10,00 % | 01.06.2032            | 4.530.087        | 0,24                         |
| 3.855.000  | Light & Wonder International Inc**                        | 7,25 %  | 15.11.2029            | 3.938.680        | 0,21                         |
| 7.644.000  | Lightning Power LLC**                                     | 7,25 %  | 15.08.2032            | 7.881.866        | 0,41                         |
| 3.830.000  | Lindblad Expeditions Holdings Inc**                       | 9,00 %  | 15.05.2028            | 4.011.282        | 0,21                         |
| 100.000  | Lindblad Expeditions LLC**                                | 6,75 %  | 15.02.2027            | 100.577          | 0,01                         |
| 1.725.000  | Live Nation Entertainment Inc**                           | 4,75 %  | 15.10.2027            | 1.669.205        | 0,09                         |
| 3.738.951  | Lumen Technologies Inc**                                  | 4,13 %  | 15.04.2029            | 3.391.873        | 0,18                         |
| 1.520.000  | Lumen Technologies Inc**                                  | 4,50 %  | 15.01.2029            | 1.294.941        | 0,07                         |
| 1.530.000  | Macy's Retail Holdings LLC*                               | 4,50 %  | 15.12.2034            | 1.276.118        | 0,07                         |
| 1.465.000  | Macy's Retail Holdings LLC*                               | 5,13 %  | 15.01.2042            | 1.100.714        | 0,06                         |
| 1.000.000  | Macy's Retail Holdings LLC**                              | 5,88 %  | 01.04.2029            | 980.714          | 0,05                         |
| 7.755.000  | Madison IAQ LLC**   | 5,88 %  | 30.06.2029            | 7.331.069        | 0,39                         |
| 1.495.000  | Magnera Corp**  | 7,25 %  | 15.11.2031            | 1.461.340        | 0,08                         |
| 5.415.000  | Manitowoc Co Inc**  | 9,25 %  | 01.10.2031            | 5.557.269        | 0,29                         |
| 4.005.000  | Masterbrand Inc**   | 7,00 %  | 15.07.2032            | 4.037.607        | 0,21                         |
| 2.385.000  | Mattamy Group Corp**                                      | 5,25 %  | 15.12.2027            | 2.333.861        | 0,12                         |
| 1.020.000  | Mauser Packaging Solutions Holding Co**                   | 7,88 %  | 15.04.2027            | 1.041.889        | 0,05                         |
| 8.195.000  | Mauser Packaging Solutions Holding Co**                   | 9,25 %  | 15.04.2027            | 8.327.480        | 0,44                         |
| 3.720.000  | McAfee Corp**   | 7,38 %  | 15.02.2030            | 3.617.668        | 0,19                         |
| 1.959.000  | McGraw-Hill Education Inc**                               | 5,75 %  | 01.08.2028            | 1.914.890        | 0,10                         |
| 3.425.000  | McGraw-Hill Education Inc**                               | 7,38 %  | 01.09.2031            | 3.509.542        | 0,18                         |
| 5.440.000  | McGraw-Hill Education Inc**                               | 8,00 %  | 01.08.2029            | 5.446.805        | 0,29                         |
| 17.545.000   | Medline Borrower LP**                                     | 5,25 %  | 01.10.2029            | 16.948.715       | 0,89                         |
| 825.000  | Mercer International Inc**                                | 12,88 % | 01.10.2028            | 889.106          | 0,05                         |
| 810.000  | Merlin Entertainments Ltd**                               | 5,75 %  | 15.06.2026            | 803.927          | 0,04                         |
| 4.245.000  | MGM Resorts International*                                | 6,13 %  | 15.09.2029            | 4.242.936        | 0,22                         |
| 5.420.000  | Midcontinent Communications**                             | 8,00 %  | 15.08.2032            | 5.573.813        | 0,29                         |
| 6.761.000  | Midwest Gaming Borrower LLC/Midwest Gaming Finance Corp** | 4,88 %  | 01.05.2029            | 6.378.671        | 0,34                         |
| 1.420.000  | Miter Brands Acquisition Holdco Inc/MIWD Borrower LLC**   | 6,75 %  | 01.04.2032            | 1.427.542        | 0,07                         |
| 3.525.000  | MIWD Holdco II LLC/MIWD Finance Corp**                    | 5,50 %  | 01.02.2030            | 3.338.437        | 0,18                         |
| 3.475.000  | Molina Healthcare Inc**                                   | 4,38 %  | 15.06.2028            | 3.296.172        | 0,17                         |
| 3.185.000  | Molina Healthcare Inc**                                   | 6,25 %  | 15.01.2033            | 3.150.767        | 0,17                         |
| 1.510.000  | MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp*            | 5,00 %  | 15.10.2027            | 1.274.510        | 0,07                         |
| 1.160.000  | MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp*            | 5,25 %  | 01.08.2026            | 1.069.083        | 0,06                         |

## High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 92,33 % (31. Dezember 2023: 88,78 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 1.355.000  | Nationstar Mortgage Holdings Inc**                                | 5,13 %  | 15.12.2030            | 1.265.572        | 0,07                         |
| 2.865.000  | Nationstar Mortgage Holdings Inc**                                | 5,50 %  | 15.08.2028            | 2.784.240        | 0,15                         |
| 6.220.000  | Nationstar Mortgage Holdings Inc**                                | 5,75 %  | 15.11.2031            | 5.951.746        | 0,31                         |
| 1.055.000  | Nationstar Mortgage Holdings Inc**                                | 6,00 %  | 15.01.2027            | 1.050.268        | 0,06                         |
| 1.585.000  | Nationstar Mortgage Holdings Inc**                                | 6,50 %  | 01.08.2029            | 1.583.955        | 0,08                         |
| 540.000  | Nationstar Mortgage Holdings Inc**                                | 7,13 %  | 01.02.2032            | 547.503          | 0,03                         |
| 3.225.000  | Navient Corp**  | 5,00 %  | 15.03.2027            | 3.163.348        | 0,17                         |
| 4.850.000  | Navient Corp**  | 5,50 %  | 15.03.2029            | 4.583.562        | 0,24                         |
| 4.264.000  | NCL Corp Ltd**  | 5,88 %  | 15.02.2027            | 4.253.778        | 0,22                         |
| 4.455.000  | Necessity Retail REIT Inc/American Finance Operating Partner LP** | 4,50 %  | 30.09.2028            | 4.096.788        | 0,22                         |
| 1.910.000  | Neptune Bidco US Inc**  | 9,29 %  | 15.04.2029            | 1.778.647        | 0,09                         |
| 3.940.000  | New Fortress Energy Inc**   | 6,50 %  | 30.09.2026            | 3.795.228        | 0,20                         |
| 1.690.000  | Newell Brands Inc**   | 6,38 %  | 15.05.2030            | 1.697.008        | 0,09                         |
| 1.030.000  | Newell Brands Inc**   | 6,63 %  | 15.09.2029            | 1.049.350        | 0,06                         |
| 1.140.000  | Newell Brands Inc**   | 6,63 %  | 15.05.2032            | 1.149.219        | 0,06                         |
| 1.790.000  | Newell Brands Inc**   | 6,88 %  | 01.04.2036            | 1.814.027        | 0,10                         |
| 1.120.000  | Newell Brands Inc**   | 7,00 %  | 01.04.2046            | 1.070.527        | 0,06                         |
| 6.090.000  | NGL Energy Operating LLC/NGL Energy Finance Corp**                | 8,13 %  | 15.02.2029            | 6.175.932        | 0,32                         |
| 3.250.000  | Noble Finance II LLC**  | 8,00 %  | 15.04.2030            | 3.285.689        | 0,17                         |
| 2.975.000  | Nordstrom Inc*  | 5,00 %  | 15.01.2044            | 2.227.864        | 0,12                         |
| 2.080.000  | Northern Oil & Gas Inc**  | 8,13 %  | 01.03.2028            | 2.113.822        | 0,11                         |
| 2.060.000  | Northriver Midstream Finance LP**                                 | 6,75 %  | 15.07.2032            | 2.074.175        | 0,11                         |
| 2.730.000  | NOVA Chemicals Corp**   | 5,25 %  | 01.06.2027            | 2.655.606        | 0,14                         |
| 2.430.000  | NOVA Chemicals Corp**   | 8,50 %  | 15.11.2028            | 2.577.039        | 0,14                         |
| 635.000  | Novelis Corp**  | 3,88 %  | 15.08.2031            | 547.439          | 0,03                         |
| 4.195.000  | Novelis Corp**  | 4,75 %  | 30.01.2030            | 3.876.711        | 0,20                         |
| 2.080.000  | NRG Energy Inc**  | 5,25 %  | 15.06.2029            | 2.021.825        | 0,11                         |
| 1.130.000  | NRG Energy Inc*   | 5,75 %  | 15.01.2028            | 1.126.885        | 0,06                         |
| 3.510.000  | NRG Energy Inc**  | 5,75 %  | 15.07.2029            | 3.429.690        | 0,18                         |
| 3.195.000  | NRG Energy Inc**  | 6,00 %  | 01.02.2033            | 3.105.605        | 0,16                         |
| 5.280.000  | NRG Energy Inc**  | 10,25 % | 31.12.2149            | 5.837.220        | 0,31                         |
| 4.785.000  | Olympus Water US Holding Corp**                                   | 6,25 %  | 01.10.2029            | 4.576.055        | 0,24                         |
| 2.520.000  | Olympus Water US Holding Corp**                                   | 7,13 %  | 01.10.2027            | 2.567.184        | 0,13                         |
| 1.235.000  | Olympus Water US Holding Corp**                                   | 7,25 %  | 15.06.2031            | 1.259.805        | 0,07                         |
| 4.065.000  | Olympus Water US Holding Corp**                                   | 9,75 %  | 15.11.2028            | 4.318.112        | 0,23                         |
| 1.710.000  | OneMain Finance Corp*   | 3,88 %  | 15.09.2028            | 1.577.228        | 0,08                         |
| 1.145.000  | OneMain Finance Corp*   | 5,38 %  | 15.11.2029            | 1.101.749        | 0,06                         |
| 6.210.000  | OneMain Finance Corp*   | 6,63 %  | 15.01.2028            | 6.291.724        | 0,33                         |
| 2.315.000  | OneMain Finance Corp*   | 6,63 %  | 15.05.2029            | 2.346.715        | 0,12                         |
| 5.095.000  | OneMain Finance Corp*   | 7,13 %  | 15.11.2031            | 5.196.558        | 0,27                         |

## High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung  | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 92,33 % (31. Dezember 2023: 88,78 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 1.260.000  | Open Text Holdings Inc**   | 4,13 %  | 15.02.2030            | 1.143.803        | 0,06                         |
| 5.155.000  | Open Text Holdings Inc**   | 4,13 %  | 01.12.2031            | 4.575.910        | 0,24                         |
| 1.250.000  | Optics Bidco SpA**   | 6,00 %  | 30.09.2034            | 1.206.299        | 0,06                         |
| 2.383.000  | Optics Bidco SpA**   | 6,38 %  | 15.11.2033            | 2.399.800        | 0,13                         |
| 1.148.000  | Optics Bidco SpA**   | 7,20 %  | 18.07.2036            | 1.177.528        | 0,06                         |
| 717.000  | Optics Bidco SpA**   | 7,72 %  | 04.06.2038            | 754.919          | 0,04                         |
| 3.025.000  | Oscar AcquisitionCo LLC/Oscar Finance Inc**                                    | 9,50 %  | 15.04.2030            | 2.854.172        | 0,15                         |
| 2.505.000  | Panther Escrow Issuer LLC**  | 7,13 %  | 01.06.2031            | 2.532.766        | 0,13                         |
| 1.025.000  | Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/PK Finance Co-Issuer** | 4,88 %  | 15.05.2029            | 965.589          | 0,05                         |
| 4.165.000  | Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/PK Finance Co-Issuer** | 5,88 %  | 01.10.2028            | 4.073.436        | 0,21                         |
| 3.025.000  | Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/PK Finance Co-Issuer** | 7,00 %  | 01.02.2030            | 3.072.367        | 0,16                         |
| 2.780.000  | Patrick Industries Inc**   | 6,38 %  | 01.11.2032            | 2.693.134        | 0,14                         |
| 3.770.000  | Pebblebrook Hotel LP/PEB Finance Corp**  | 6,38 %  | 15.10.2029            | 3.735.332        | 0,20                         |
| 5.615.000  | Penn Entertainment Inc**   | 4,13 %  | 01.07.2029            | 5.040.701        | 0,27                         |
| 1.380.000  | Penn Entertainment Inc**   | 5,63 %  | 15.01.2027            | 1.359.621        | 0,07                         |
| 3.720.000  | PennyMac Financial Services Inc**  | 5,75 %  | 15.09.2031            | 3.547.020        | 0,19                         |
| 2.510.000  | PennyMac Financial Services Inc**  | 7,13 %  | 15.11.2030            | 2.544.307        | 0,13                         |
| 1.360.000  | Performance Food Group Inc**   | 4,25 %  | 01.08.2029            | 1.263.376        | 0,07                         |
| 5.336.000  | Performance Food Group Inc**   | 5,50 %  | 15.10.2027            | 5.296.419        | 0,28                         |
| 2.045.000  | Performance Food Group Inc**   | 6,13 %  | 15.09.2032            | 2.047.463        | 0,11                         |
| 4.865.000  | Permian Resources Operating LLC**  | 5,88 %  | 01.07.2029            | 4.777.076        | 0,25                         |
| 1.495.000  | Permian Resources Operating LLC**  | 6,25 %  | 01.02.2033            | 1.476.925        | 0,08                         |
| 4.050.000  | Perrigo Finance Unlimited Co*  | 6,13 %  | 30.09.2032            | 3.965.317        | 0,21                         |
| 1.055.000  | PetSmart Inc/PetSmart Finance Corp**   | 7,75 %  | 15.02.2029            | 1.021.109        | 0,05                         |
| 2.945.000  | Post Holdings Inc**  | 6,25 %  | 15.10.2034            | 2.876.207        | 0,15                         |
| 3.810.000  | Post Holdings Inc**  | 6,38 %  | 01.03.2033            | 3.738.991        | 0,20                         |
| 4.255.000  | Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**                       | 5,75 %  | 15.04.2026            | 4.256.445        | 0,22                         |
| 8.761.000  | Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**                       | 6,25 %  | 15.01.2028            | 8.723.053        | 0,46                         |
| 4.380.000  | Provident Funding Associates LP/PFG Finance Corp**                             | 9,75 %  | 15.09.2029            | 4.504.681        | 0,24                         |
| 4.884.775  | Rackspace Finance LLC**  | 3,50 %  | 15.05.2028            | 2.949.183        | 0,16                         |
| 4.130.000  | Rakuten Group Inc**  | 9,75 %  | 15.04.2029            | 4.483.838        | 0,24                         |
| 4.915.000  | Rakuten Group Inc**  | 11,25 % | 15.02.2027            | 5.371.041        | 0,28                         |
| 1.435.000  | Resideo Funding Inc**  | 4,00 %  | 01.09.2029            | 1.301.114        | 0,07                         |
| 5.390.000  | Resideo Funding Inc**  | 6,50 %  | 15.07.2032            | 5.403.459        | 0,28                         |
| 5.820.000  | RHP Hotel Properties LP/RHP Finance Corp**                                     | 7,25 %  | 15.07.2028            | 6.005.297        | 0,32                         |
| 5.730.000  | Ritchie Bros Holdings Inc**  | 7,75 %  | 15.03.2031            | 5.999.258        | 0,32                         |
| 6.310.000  | RLJ Lodging Trust LP**   | 4,00 %  | 15.09.2029            | 5.723.259        | 0,30                         |
| 740.000  | Rocket Mortgage LLC/Rocket Mortgage Co-Issuer Inc**                            | 3,88 %  | 01.03.2031            | 645.222          | 0,03                         |
| 500.000  | Rocket Mortgage LLC/Rocket Mortgage Co-Issuer Inc**                            | 4,00 %  | 15.10.2033            | 416.895          | 0,02                         |
| 3.185.000  | Rockies Express Pipeline LLC**   | 6,88 %  | 15.04.2040            | 3.030.732        | 0,16                         |

## High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung  | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 92,33 % (31. Dezember 2023: 88,78 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 1.875.000  | Rockies Express Pipeline LLC**                               | 7,50 %  | 15.07.2038            | 1.874.347        | 0,10                         |
| 4.430.000  | Royal Caribbean Cruises Ltd**                                | 5,63 %  | 30.09.2031            | 4.360.489        | 0,23                         |
| 4.285.000  | Royal Caribbean Cruises Ltd**                                | 6,00 %  | 01.02.2033            | 4.277.909        | 0,23                         |
| 7.155.000  | Scientific Games Holdings LP/Scientific Games US FinCo Inc** | 6,63 %  | 01.03.2030            | 6.853.011        | 0,36                         |
| 3.275.000  | SCIH Salt Holdings Inc**                                     | 4,88 %  | 01.05.2028            | 3.084.504        | 0,16                         |
| 2.185.000  | SCIH Salt Holdings Inc**                                     | 6,63 %  | 01.05.2029            | 2.076.863        | 0,11                         |
| 8.276.000  | SCIL IV LLC/SCIL USA Holdings LLC**                          | 5,38 %  | 01.11.2026            | 8.114.930        | 0,43                         |
| 1.935.000  | Sealed Air Corp/Sealed Air Corp US**                         | 7,25 %  | 15.02.2031            | 1.997.017        | 0,10                         |
| 5.660.000  | SeaWorld Parks & Entertainment Inc**                         | 5,25 %  | 15.08.2029            | 5.406.066        | 0,28                         |
| 4.980.000  | Select Medical Corp**  | 6,25 %  | 01.12.2032            | 4.800.003        | 0,25                         |
| 4.100.000  | Sensata Technologies BV**                                    | 4,00 %  | 15.04.2029            | 3.766.107        | 0,20                         |
| 2.955.000  | Sensata Technologies Inc**                                   | 6,63 %  | 15.07.2032            | 2.965.332        | 0,16                         |
| 2.855.000  | Service Properties Trust**                                   | 5,25 %  | 15.02.2026            | 2.778.733        | 0,15                         |
| 4.950.000  | Service Properties Trust**                                   | 8,63 %  | 15.11.2031            | 5.173.631        | 0,27                         |
| 2.953.000  | Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp**                      | 4,75 %  | 15.02.2028            | 2.831.569        | 0,15                         |
| 2.550.000  | Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp**                      | 4,75 %  | 01.04.2029            | 2.416.600        | 0,13                         |
| 3.155.000  | Shift4 Payments LLC/Shift4 Payments Finance Sub Inc**        | 6,75 %  | 15.08.2032            | 3.211.433        | 0,17                         |
| 2.440.000  | Sirius XM Radio LLC**  | 3,88 %  | 01.09.2031            | 2.044.791        | 0,11                         |
| 1.230.000  | Sirius XM Radio LLC**  | 4,00 %  | 15.07.2028            | 1.134.622        | 0,06                         |
| 2.615.000  | Sirius XM Radio LLC**  | 4,13 %  | 01.07.2030            | 2.285.347        | 0,12                         |
| 2.025.000  | Sirius XM Radio LLC**  | 5,50 %  | 01.07.2029            | 1.943.887        | 0,10                         |
| 4.005.000  | Six Flags Entertainment Corp**                               | 7,25 %  | 15.05.2031            | 4.094.724        | 0,22                         |
| 1.925.000  | Six Flags Entertainment Corp/Six Flags Theme Parks Inc**     | 6,63 %  | 01.05.2032            | 1.952.575        | 0,10                         |
| 5.640.000  | SPX FLOW Inc**   | 8,75 %  | 01.04.2030            | 5.785.850        | 0,30                         |
| 4.100.000  | Standard Building Solutions Inc**                            | 6,50 %  | 15.08.2032            | 4.110.092        | 0,22                         |
| 1.730.000  | Standard Industries Inc**                                    | 4,38 %  | 15.07.2030            | 1.586.392        | 0,08                         |
| 7.230.000  | Star Holding LLC**   | 8,75 %  | 01.08.2031            | 7.172.668        | 0,38                         |
| 4.225.000  | Starwood Property Trust Inc**                                | 6,50 %  | 01.07.2030            | 4.233.110        | 0,22                         |
| 2.355.000  | Station Casinos LLC**  | 4,50 %  | 15.02.2028            | 2.236.292        | 0,12                         |
| 1.825.000  | Station Casinos LLC**  | 4,63 %  | 01.12.2031            | 1.636.371        | 0,09                         |
| 6.420.000  | Sunrise FinCo I BV**   | 4,88 %  | 15.07.2031            | 5.831.093        | 0,31                         |
| 635.000  | Sunrise HoldCo IV BV**                                       | 5,50 %  | 15.01.2028            | 622.310          | 0,03                         |
| 5.075.000  | Surgery Center Holdings Inc**                                | 7,25 %  | 15.04.2032            | 5.183.322        | 0,27                         |
| 2.890.000  | Talen Energy Supply LLC**                                    | 8,63 %  | 01.06.2030            | 3.082.013        | 0,16                         |
| 210.000  | Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp** | 6,00 %  | 31.12.2030            | 199.038          | 0,01                         |
| 805.000  | Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp** | 6,00 %  | 01.09.2031            | 760.583          | 0,04                         |
| 5.255.000  | Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp** | 7,38 %  | 15.02.2029            | 5.276.706        | 0,28                         |
| 3.485.000  | Taylor Morrison Communities Inc**                            | 5,13 %  | 01.08.2030            | 3.342.013        | 0,18                         |
| 3.835.550  | Team Health Holdings Inc**                                   | 13,50 % | 30.06.2028            | 4.243.077        | 0,22                         |
| 4.270.000  | Tenet Healthcare Corp**                                      | 6,13 %  | 15.06.2030            | 4.241.681        | 0,22                         |

## High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 92,33 % (31. Dezember 2023: 88,78 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 7.765.000  | Tenet Healthcare Corp**                                       | 6,75 %  | 15.05.2031            | 7.850.578        | 0,41                         |
| 4.410.000  | Terex Corp**  | 5,00 %  | 15.05.2029            | 4.203.279        | 0,22                         |
| 4.675.000  | Terex Corp**  | 6,25 %  | 15.10.2032            | 4.588.165        | 0,24                         |
| 6.560.000  | TGNR Intermediate Holdings LLC**                              | 5,50 %  | 15.10.2029            | 6.131.781        | 0,32                         |
| 5.945.000  | TK Elevator Holdco GmbH**                                     | 7,63 %  | 15.07.2028            | 5.952.607        | 0,31                         |
| 2.285.000  | TK Elevator US Newco Inc**                                    | 5,25 %  | 15.07.2027            | 2.238.695        | 0,12                         |
| 2.940.000  | TKC Holdings Inc**  | 6,88 %  | 15.05.2028            | 2.924.059        | 0,15                         |
| 2.035.000  | TKC Holdings Inc**  | 10,50 % | 15.05.2029            | 2.051.186        | 0,11                         |
| 3.398.000  | TMS International Corp**                                      | 6,25 %  | 15.04.2029            | 3.278.959        | 0,17                         |
| 4.425.000  | TransAlta Corp*   | 7,75 %  | 15.11.2029            | 4.618.141        | 0,24                         |
| 1.230.000  | TransDigm Inc*  | 5,50 %  | 15.11.2027            | 1.209.649        | 0,06                         |
| 410.000  | TransDigm Inc**   | 6,00 %  | 15.01.2033            | 402.149          | 0,02                         |
| 3.960.000  | TransDigm Inc**   | 6,38 %  | 01.03.2029            | 3.973.748        | 0,21                         |
| 4.050.000  | TransDigm Inc**   | 6,63 %  | 01.03.2032            | 4.091.617        | 0,22                         |
| 11.155.000   | TransDigm Inc**   | 6,75 %  | 15.08.2028            | 11.266.257       | 0,59                         |
| 5.390.000  | TransDigm Inc**   | 6,88 %  | 15.12.2030            | 5.474.002        | 0,29                         |
| 1.450.000  | Transocean Inc**  | 8,25 %  | 15.05.2029            | 1.421.819        | 0,07                         |
| 2.060.000  | Transocean Inc**  | 8,50 %  | 15.05.2031            | 2.021.738        | 0,11                         |
| 3.745.000  | Trident TPI Holdings Inc**                                    | 12,75 % | 31.12.2028            | 4.135.757        | 0,22                         |
| 3.855.000  | Trivium Packaging Finance BV*                                 | 5,50 %  | 15.08.2026            | 3.814.503        | 0,20                         |
| 4.610.000  | Tronox Inc**  | 4,63 %  | 15.03.2029            | 4.142.987        | 0,22                         |
| 3.110.000  | TTM Technologies Inc**  | 4,00 %  | 01.03.2029            | 2.888.801        | 0,15                         |
| 7.195.000  | UKG Inc**   | 6,88 %  | 01.02.2031            | 7.307.296        | 0,38                         |
| 8.015.000  | United Airlines Inc**   | 4,38 %  | 15.04.2026            | 7.886.991        | 0,42                         |
| 3.425.000  | United Airlines Inc**   | 4,63 %  | 15.04.2029            | 3.259.217        | 0,17                         |
| 5.990.000  | United Rentals North America Inc**                            | 6,13 %  | 15.03.2034            | 5.950.638        | 0,31                         |
| 3.275.000  | Uniti Group LP/Uniti Group Finance 2019 Inc/CSL Capital LLC** | 6,50 %  | 15.02.2029            | 2.975.202        | 0,16                         |
| 6.025.000  | Uniti Group LP/Uniti Group Finance 2019 Inc/CSL Capital LLC** | 10,50 % | 15.02.2028            | 6.430.575        | 0,34                         |
| 6.560.000  | US Acute Care Solutions LLC**                                 | 9,75 %  | 15.05.2029            | 6.693.557        | 0,35                         |
| 3.160.000  | US Foods Inc**  | 4,75 %  | 15.02.2029            | 3.029.443        | 0,16                         |
| 1.770.000  | US Foods Inc**  | 5,75 %  | 15.04.2033            | 1.724.503        | 0,09                         |
| 3.125.000  | US Foods Inc**  | 6,88 %  | 15.09.2028            | 3.201.484        | 0,17                         |
| 1.955.000  | US Foods Inc**  | 7,25 %  | 15.01.2032            | 2.025.701        | 0,11                         |
| 3.755.000  | USA Compression Partners LP/USA Compression Finance Corp**    | 6,88 %  | 01.09.2027            | 3.769.922        | 0,20                         |
| 4.825.000  | USA Compression Partners LP/USA Compression Finance Corp**    | 7,13 %  | 15.03.2029            | 4.914.757        | 0,26                         |
| 990.000  | USI Inc**   | 7,50 %  | 15.01.2032            | 1.025.102        | 0,05                         |
| 3.600.000  | UWM Holdings LLC**  | 6,63 %  | 01.02.2030            | 3.581.197        | 0,19                         |
| 3.695.000  | Venture Global Calcasieu Pass LLC**                           | 3,88 %  | 15.08.2029            | 3.397.452        | 0,18                         |
| 2.395.000  | Venture Global Calcasieu Pass LLC**                           | 4,13 %  | 15.08.2031            | 2.146.684        | 0,11                         |
| 2.100.000  | Venture Global LNG Inc**                                      | 7,00 %  | 15.01.2030            | 2.133.483        | 0,11                         |

## High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                     | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 92,33 % (31. Dezember 2023: 88,78 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 4.250.000  | Venture Global LNG Inc**                                  | 8,13 %  | 01.06.2028            | 4.424.475        | 0,23                         |
| 925.000  | Venture Global LNG Inc**                                  | 8,38 %  | 01.06.2031            | 965.664          | 0,05                         |
| 4.390.000  | Venture Global LNG Inc**                                  | 9,50 %  | 01.02.2029            | 4.854.861        | 0,26                         |
| 2.975.000  | Venture Global LNG Inc**                                  | 9,88 %  | 01.02.2032            | 3.266.266        | 0,17                         |
| 7.390.000  | Veritiv Operating Co**                                    | 10,50 % | 30.11.2030            | 7.968.122        | 0,42                         |
| 4.870.000  | VF Corp*  | 2,95 %  | 23.04.2030            | 4.163.335        | 0,22                         |
| 6.605.000  | Vibrant Technologies Inc**                                | 9,00 %  | 15.02.2030            | 6.071.884        | 0,32                         |
| 3.600.000  | Viking Cruises Ltd**                                      | 5,88 %  | 15.09.2027            | 3.584.735        | 0,19                         |
| 3.050.000  | Viking Cruises Ltd**                                      | 7,00 %  | 15.02.2029            | 3.069.815        | 0,16                         |
| 2.245.000  | Viking Cruises Ltd**                                      | 9,13 %  | 15.07.2031            | 2.416.416        | 0,13                         |
| 2.335.000  | Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd**                       | 5,63 %  | 15.02.2029            | 2.299.783        | 0,12                         |
| 4.560.000  | VistaJet Malta Finance Plc/Vista Management Holding Inc** | 6,38 %  | 01.02.2030            | 3.989.266        | 0,21                         |
| 545.000  | VistaJet Malta Finance Plc/Vista Management Holding Inc** | 9,50 %  | 01.06.2028            | 549.058          | 0,03                         |
| 3.555.000  | Vistra Corp**   | 7,00 %  | 31.12.2149            | 3.579.237        | 0,19                         |
| 1.515.000  | Vistra Operations Co LLC**                                | 4,38 %  | 01.05.2029            | 1.427.770        | 0,07                         |
| 2.350.000  | Vistra Operations Co LLC**                                | 5,00 %  | 31.07.2027            | 2.307.755        | 0,12                         |
| 5.860.000  | Vistra Operations Co LLC**                                | 6,88 %  | 15.04.2032            | 6.005.718        | 0,32                         |
| 3.970.000  | Vistra Operations Co LLC**                                | 7,75 %  | 15.10.2031            | 4.168.483        | 0,22                         |
| 7.611.000  | VM Consolidated Inc**                                     | 5,50 %  | 15.04.2029            | 7.413.127        | 0,39                         |
| 3.840.000  | Vmed O2 UK Financing I Plc**                              | 4,75 %  | 15.07.2031            | 3.306.501        | 0,17                         |
| 2.135.000  | Walgreens Boots Alliance Inc**                            | 3,45 %  | 01.06.2026            | 2.069.759        | 0,11                         |
| 675.000  | Walgreens Boots Alliance Inc**                            | 4,50 %  | 18.11.2034            | 516.607          | 0,03                         |
| 1.010.000  | Walgreens Boots Alliance Inc**                            | 4,80 %  | 18.11.2044            | 722.783          | 0,04                         |
| 355.000  | Walgreens Boots Alliance Inc**                            | 8,13 %  | 15.08.2029            | 351.828          | 0,02                         |
| 3.525.000  | Wand NewCo 3 Inc**  | 7,63 %  | 30.01.2032            | 3.624.208        | 0,19                         |
| 3.525.000  | WESCO Distribution Inc**                                  | 6,38 %  | 15.03.2029            | 3.576.519        | 0,19                         |
| 3.175.000  | WESCO Distribution Inc**                                  | 6,63 %  | 15.03.2032            | 3.230.956        | 0,17                         |
| 6.655.000  | White Cap Buyer LLC**                                     | 6,88 %  | 15.10.2028            | 6.615.159        | 0,35                         |
| 2.345.000  | William Carter Co**                                       | 5,63 %  | 15.03.2027            | 2.327.203        | 0,12                         |
| 230.000  | Williams Scotsman Inc**                                   | 4,63 %  | 15.08.2028            | 219.804          | 0,01                         |
| 2.535.000  | Williams Scotsman Inc**                                   | 6,63 %  | 15.06.2029            | 2.567.514        | 0,13                         |
| 4.365.000  | Williams Scotsman Inc**                                   | 7,38 %  | 01.10.2031            | 4.494.160        | 0,24                         |
| 6.595.000  | Windsor Holdings III LLC**                                | 8,50 %  | 15.06.2030            | 6.947.575        | 0,37                         |
| 4.270.000  | Windstream Services LLC/Windstream Escrow Finance Corp**  | 8,25 %  | 01.10.2031            | 4.415.149        | 0,23                         |
| 4.695.000  | WR Grace Holdings LLC**                                   | 5,63 %  | 15.08.2029            | 4.323.311        | 0,23                         |
| 3.835.000  | WR Grace Holdings LLC**                                   | 7,38 %  | 01.03.2031            | 3.934.185        | 0,21                         |
| 8.810.000  | XPO Inc**   | 7,13 %  | 01.02.2032            | 9.033.069        | 0,48                         |
| 10.980.000   | Zayo Group Holdings Inc**                                 | 4,00 %  | 01.03.2027            | 10.137.768       | 0,53                         |
| 1.525.000  | ZF North America Capital Inc**                            | 6,75 %  | 23.04.2030            | 1.468.162        | 0,08                         |
| 3.460.000  | ZF North America Capital Inc**                            | 6,88 %  | 14.04.2028            | 3.453.067        | 0,18                         |

## High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$     | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|----------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 92,33 % (31. Dezember 2023: 88,78 %) (Fortsetzung)</b>             |   |         |                       |                      |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                      |                              |
| 1.630.000  | Ziggo BV*   | 4,88 %  | 15.01.2030            | 1.500.642            | 0,08                         |
| 1.615.000  | ZipRecruiter Inc**  | 5,00 %  | 15.01.2030            | 1.456.598            | 0,08                         |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>  |   |         |                       | <b>1.753.492.450</b> | <b>92,33</b>                 |
| <b>Mittelfristige Schuldverschreibungen<sup>^</sup> 3,45 % (31. Dezember 2023: 1,91 %)</b> |   |         |                       |                      |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |   |         |                       |                      |                              |
| 3.503.803  | Aveanna Healthcare LLC  | 8,36 %  | 17.07.2028            | 3.480.380            | 0,18                         |
| 2.285.000  | Aveanna Healthcare LLC  | 11,66 % | 10.12.2029            | 2.210.738            | 0,12                         |
| 4.050.000  | Catawba Nation Gaming Authority   | 0,00 %  | 16.12.2031            | 4.067.739            | 0,21                         |
| 3.256.817  | Champions Holdco Inc  | 9,27 %  | 23.02.2029            | 3.092.967            | 0,16                         |
| 2.212.934  | Cloudera Inc  | 8,21 %  | 08.10.2028            | 2.211.208            | 0,12                         |
| 2.720.000  | Cornerstone Generation LLC  | 0,00 %  | 28.10.2031            | 2.747.200            | 0,14                         |
| 863.792  | Covia Holdings LLC  | 0,00 %  | 31.07.2026            | 863.144              | 0,04                         |
| 2.085.847  | Engineered Machinery Holdings Inc   | 10,59 % | 21.05.2029            | 2.096.276            | 0,11                         |
| 2.292.093  | Gainwell Acquisition Corp   | 8,43 %  | 01.10.2027            | 2.225.874            | 0,12                         |
| 2.513.571  | Galaxy US Opco Inc  | 9,34 %  | 29.04.2029            | 2.246.504            | 0,12                         |
| 2.325.000  | Glatfelter Corp   | 8,76 %  | 04.11.2031            | 2.333.230            | 0,12                         |
| 2.180.000  | Iris Holding Inc  | 0,00 %  | 28.06.2028            | 2.106.425            | 0,11                         |
| 750.000  | Level 3 Financing Inc   | 10,92 % | 15.04.2030            | 765.656              | 0,04                         |
| 2.751.382  | Lightstone Holdco LLC B Term Loan   | 10,34 % | 29.01.2027            | 2.787.494            | 0,15                         |
| 155.595  | Lightstone Holdco LLC C Term Loan   | 10,34 % | 29.01.2027            | 157.637              | 0,01                         |
| 2.019.669  | Medical Solutions Holdings Inc  | 8,19 %  | 01.11.2028            | 1.440.135            | 0,08                         |
| 2.200.000  | MH Sub I LLC  | 0,00 %  | 03.05.2028            | 2.203.630            | 0,12                         |
| 1.060.000  | MH Sub I LLC  | 10,61 % | 23.02.2029            | 1.052.273            | 0,05                         |
| 92.311   | National Mentor Holdings Inc  | 8,18 %  | 02.03.2028            | 91.661               | 0,00                         |
| 3.186.121  | National Mentor Holdings Inc  | 8,20 %  | 02.03.2028            | 3.163.706            | 0,17                         |
| 1.200.856  | Neptune BidCo US Inc  | 9,76 %  | 11.04.2029            | 1.080.987            | 0,06                         |
| 2.221.191  | New Fortress Energy Inc   | 9,59 %  | 30.10.2028            | 2.131.655            | 0,11                         |
| 5.261.836  | Parexel International Inc   | 7,36 %  | 15.11.2028            | 5.304.588            | 0,28                         |
| 2.455.480  | Rackspace Finance LLC   | 10,85 % | 15.05.2028            | 2.548.580            | 0,13                         |
| 6.724.685  | Star Parent Inc   | 8,33 %  | 27.09.2030            | 6.580.945            | 0,35                         |
| 4.259.325  | VS Buyer LLC  | 7,12 %  | 12.04.2031            | 4.296.594            | 0,23                         |
| 2.342.588  | Weber-Stephen Products LLC  | 7,72 %  | 30.10.2027            | 2.338.922            | 0,12                         |
| <b>Mittelfristige Schuldverschreibungen insgesamt <sup>†</sup></b>                         |   |         |                       | <b>65.626.148</b>    | <b>3,45</b>                  |
| <b>Pensionsgeschäfte 3,48 % (31. Dezember 2023: 0,00 %)</b>                                |   |         |                       |                      |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |   |         |                       |                      |                              |
| 66.000.000   | State Street Bank and Trust Co, repurchase value US\$ 66,016,243 <sup>^</sup> | 4,43 %  | 02.01.2025            | 66.000.000           | 3,48                         |
| <b>Pensionsgeschäfte insgesamt <sup>†</sup></b>  |   |         |                       | <b>66.000.000</b>    | <b>3,48</b>                  |

<sup>^</sup> Besichert über US-Schatz-/Staatsanleihen mit einem Wert von insgesamt USD 67.320.139.

## High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile  | Wertpapierbezeichnung             | Zeitwert US\$        | % des Nettovermögens |
|---|-----------------------------------|----------------------|----------------------|
| <b>Investmentfonds 0,02 % (31. Dezember 2023: 0,16 %)</b> |                                   |                      |                      |
| <b>Britisches Pfund</b>                                   |                                   |                      |                      |
| 520.942   | NB Global Monthly Income Fund Ltd | 375.146              | 0,02                 |
| <b>Investmentfonds insgesamt <sup>1)</sup></b>            |                                   | <b>375.146</b>       | <b>0,02</b>          |
| <b>Anlagen insgesamt</b>                                  |                                   | <b>1.914.961.968</b> | <b>100,83</b>        |

### Devisenterminkontrakte 1,07 % (31. Dezember 2023: 1,81 %)

| Geforderter Betrag              | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 459.193 US\$                    | 343.018 £           | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | 29.646                         | 0,00                 |
| 148 US\$                        | 200 CAD             | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | 10                             | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 2.246.218 US\$                  | 3.387.192 AUD       | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 5         | 148.999                        | 0,01                 |
| 10.685.117 US\$                 | 15.876.840 AUD      | 16.01.2025       | UBS AG                      | 2         | 854.786                        | 0,05                 |
| 4.468.781 US\$                  | 6.796.043 AUD       | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 68        | 260.929                        | 0,01                 |
| <i>Abgesicherte Klassen CAD</i> |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 80.858 US\$                     | 114.538 CAD         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 3         | 1.179                          | 0,00                 |
| 84.175 US\$                     | 115.566 CAD         | 16.01.2025       | UBS AG                      | 3         | 3.781                          | 0,00                 |
| 3.883.017 US\$                  | 5.288.802 CAD       | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 5         | 203.840                        | 0,01                 |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i> |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 74.032 US\$                     | 66.132 CHF          | 16.01.2025       | UBS AG                      | 2         | 950                            | 0,00                 |
| 3.997.497 US\$                  | 3.390.273 CHF       | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 9         | 250.905                        | 0,01                 |
| <i>Abgesicherte Klassen CNY</i> |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 8.796 US\$                      | 62.455 CNY          | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | 289                            | 0,00                 |
| 3.437.818 US\$                  | 24.077.454 CNY      | 16.01.2025       | UBS AG                      | 3         | 158.303                        | 0,01                 |
| 30.175 US\$                     | 216.718 CNY         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 3         | 656                            | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 2.579.259 US\$                  | 2.405.547 €         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 2         | 86.991                         | 0,00                 |
| 185.585.124 US\$                | 168.395.558 €       | 16.01.2025       | UBS AG                      | 3         | 11.118.838                     | 0,59                 |
| 15.166.439 US\$                 | 14.421.331 €        | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 42        | 225.212                        | 0,01                 |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 3 £                             | 4 US\$              | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | 0                              | 0,00                 |
| 4.752.795 US\$                  | 3.598.515 £         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 2         | 246.528                        | 0,01                 |
| 110.956.958 US\$                | 84.745.456 £        | 16.01.2025       | UBS AG                      | 2         | 4.833.850                      | 0,25                 |
| 51.597.944 US\$                 | 41.134.129 £        | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 41        | 87.432                         | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen HKD</i> |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 203.654 HKD                     | 26.210 US\$         | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | 9                              | 0,00                 |
| 2.358.392 US\$                  | 18.302.920 HKD      | 16.01.2025       | UBS AG                      | 2         | 1.995                          | 0,00                 |
| 51.187 US\$                     | 397.308 HKD         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 2         | 35                             | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen SEK</i> |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 233 SEK                         | 21 US\$             | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 2         | 0                              | 0,00                 |

## High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 1,07 % (31. Dezember 2023: 1,81 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens        |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|-----------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen SEK (Fortsetzung)</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 1.149.702 US\$   | 12.365.508 SEK      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 4         | 29.800                         | 0,00                        |
| 35.401.693 US\$  | 385.669.808 SEK     | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 49        | 472.917                        | 0,03                        |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 428 SGD  | 314 US\$            | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | 0                              | 0,00                        |
| 221.234 US\$   | 289.718 SGD         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 2         | 8.742                          | 0,00                        |
| 200.122 US\$   | 270.674 SGD         | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | 1.598                          | 0,00                        |
| 3.126.735 US\$   | 4.096.579 SGD       | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 21        | 122.123                        | 0,01                        |
| <i>Abgesicherte Klassen ZAR</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 14.567.421 US\$  | 258.067.381 ZAR     | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 4         | 908.245                        | 0,05                        |
| 765.083 US\$   | 14.026.331 ZAR      | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | 22.687                         | 0,00                        |
| 5.917.949 US\$   | 105.435.258 ZAR     | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 74        | 337.394                        | 0,02                        |
| 112 ZAR  | 6 US\$              | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | 0                              | 0,00                        |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>                        |                     |                  |                             |           | <b>20.418.669</b>              | <b>1,07</b>                 |
|  |                     |                  |                             |           | <b>Zeitwert US\$</b>           | <b>% des Nettovermögens</b> |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |                     |                  |                             |           | <b>1.935.380.637</b>           | <b>101,90</b>               |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Umgekehrte Pensionsgeschäfte (0,16 %) (31. Dezember 2023: (0,00 %))

| Kapitalbetrag US\$   | Beschreibung   | Zinsaufwand/ (Zinseinnahmen) | Fälligkeitsdatum*   | Zeitwert US\$      | Vertragliche Restlaufzeit der Vereinbarung* | % des Nettovermögens |
|--|--|------------------------------|---------------------|--------------------|---|----------------------|
| 1.221.758  | Umgekehrtes Pensionsgeschäft BofA Securities, besichert durch VistaJet Malta Finance Plc/Vista Management Holding Inc., 6,38 %, fällig am 01.02.2030 | 0,00 %                       | Offen/auf Verlangen | (1.221.758)        | Täglich und fortlaufend                     | (0,06)               |
| 1.842.006  | Umgekehrtes Pensionsgeschäft BofA Securities, besichert durch Grifols SA, 4,75 %, fällig am 15.10.2028   | 1,50 %                       | Offen/auf Verlangen | (1.842.006)        | Täglich und fortlaufend                     | (0,10)               |
| <b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte insgesamt <sup>∞</sup></b> |  |                              |                     | <b>(3.063.764)</b> |   | <b>(0,16)</b>        |

\* Offene umgekehrte Pensionsgeschäfte ohne ein bestimmtes Fälligkeitsdatum. Jede Partei kann die Vereinbarung auf Verlangen kündigen.

### Devisenterminkontrakte (3,22 %) (31. Dezember 2023: (0,69 %))

| Geforderter Betrag              | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 129.718 €                       | 145.591 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | (11.196)                        | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 707.148 AUD                     | 465.100 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (27.261)                        | (0,00)               |
| 128.194.311 AUD                 | 86.352.841 US\$     | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | (6.979.835)                     | (0,37)               |

## High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (3,22 %) (31. Dezember 2023: (0,69 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen AUD (Fortsetzung)</i>                                    |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 3.371.665 AUD  | 2.268.537 US\$      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 45        | (180.932)                       | (0,01)               |
| <i>Abgesicherte Klassen CAD</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 11.943.836 CAD   | 8.771.642 US\$      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 2         | (462.864)                       | (0,02)               |
| 87.350 CAD   | 63.771 US\$         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 5         | (3.006)                         | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 8.477.157 CHF  | 10.002.307 US\$     | 16.01.2025       | UBS AG                      | 2         | (634.195)                       | (0,03)               |
| 166.851 CHF  | 191.096 US\$        | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 6         | (6.707)                         | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen CNY</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 35.268.162 CNY   | 5.036.151 US\$      | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | (232.385)                       | (0,01)               |
| 72.024 CNY   | 10.002 US\$         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | (192)                           | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 1.914.640 €  | 2.144.368 US\$      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (160.704)                       | (0,01)               |
| 329.781.019 €  | 363.548.617 US\$    | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | (21.878.857)                    | (1,15)               |
| 19.955.089 €   | 21.806.232 US\$     | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 67        | (1.131.755)                     | (0,06)               |
| 340.670 US\$   | 328.829 €           | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | (13)                            | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 273.656.361 £  | 358.570.015 US\$    | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | (15.881.867)                    | (0,84)               |
| 7.675.554 £  | 10.046.092 US\$     | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 59        | (434.325)                       | (0,02)               |
| 175.679 US\$   | 140.398 £           | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 3         | (136)                           | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen HKD</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 49.614.696 HKD   | 6.392.818 US\$      | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | (5.206)                         | (0,00)               |
| 265.691 HKD  | 34.245 US\$         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 2         | (39)                            | (0,00)               |
| 22.630 US\$  | 176.019 HKD         | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | (32)                            | (0,00)               |
| 316.316 US\$   | 2.459.638 HKD       | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 7         | (347)                           | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen SEK</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 4.423.603 SEK  | 406.319 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (5.688)                         | (0,00)               |
| 6.283.550 SEK  | 623.495 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | (54.416)                        | (0,00)               |
| 669.146.171 SEK  | 64.945.343 US\$     | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 35        | (4.343.093)                     | (0,23)               |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 29.867.529 SGD   | 23.011.270 US\$     | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 39        | (1.105.116)                     | (0,06)               |
| <i>Abgesicherte Klassen ZAR</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 2.061.997.827 ZAR  | 116.521.955 US\$    | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 2         | (7.383.048)                     | (0,39)               |
| 80.882.551 ZAR   | 4.569.403 US\$      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 49        | (288.394)                       | (0,02)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>(61.211.609)</b>             | <b>(3,22)</b>        |

## High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

|   | Zeitwert<br>US\$     | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|---|----------------------|------------------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(64.275.373)</b>  | <b>(3,38)</b>                |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>1.871.105.264</b> | <b>98,52</b>                 |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>28.102.674</b>    | <b>1,48</b>                  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>1.899.207.938</b> | <b>100,00</b>                |

^ Schuldverschreibungen mit einem Zinssatz von 0,00 %, wurden zum 31. Dezember 2024 eventuell noch nicht abgerechnet und haben somit keinen gültigen Zinssatz. Die Zinssätze werden erst bei Abrechnung gültig.

| <b>Portfolioanalyse</b>   | US\$                 | % des<br>Gesamtver-<br>mögens |
|---|----------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 96.462.280           | 4,85                          |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden            | 1.686.498.394        | 84,76                         |
| † Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente  | 128.562.384          | 6,46                          |
| μ Investmentfonds   | 375.146              | 0,02                          |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente   | (40.792.940)         | (2,05)                        |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>1.871.105.264</b> | <b>94,04</b>                  |

## InnovAsia - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der<br>Anteile                               | Wertpapierbezeichnung                         | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|------------------|------------------------------|
| <b>Aktien 100,32 % (31. Dezember 2023: 94,76 %)</b> |   |                  |                              |
| <b>Australischer Dollar</b>                         |   |                  |                              |
| 41.692  | Nuix Ltd*                                     | 163.142          | 1,15                         |
| 11.271  | Technology One Ltd*                           | 218.495          | 1,54                         |
| 2.015   | WiseTech Global Ltd*                          | 151.033          | 1,07                         |
| 78.447  | Zip Co Ltd*                                   | 143.768          | 1,02                         |
| <b>Australischer Dollar insgesamt</b>               |   | <b>676.438</b>   | <b>4,78</b>                  |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi</b>                   |   |                  |                              |
| 4.011   | Beijing Kingsoft Office Software Inc Class A* | 156.468          | 1,11                         |
| 32.200  | Zhejiang Shuanghuan Driveline Co Ltd Class A* | 134.300          | 0,95                         |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt</b>         |   | <b>290.768</b>   | <b>2,06</b>                  |
| <b>Hongkong-Dollar</b>                              |   |                  |                              |
| 164.400   | Horizon Robotics Inc*                         | 76.190           | 0,54                         |
| 60.200  | Kingsoft Corp Ltd*                            | 260.781          | 1,84                         |
| 38.000  | Shanghai Conant Optical Co Ltd - H Shares*    | 121.808          | 0,86                         |
| <b>Hongkong-Dollar insgesamt</b>                    |   | <b>458.779</b>   | <b>3,24</b>                  |
| <b>Indische Rupie</b>                               |   |                  |                              |
| 2.019   | Amber Enterprises India Ltd*                  | 174.370          | 1,23                         |
| 26.595  | Bharti Airtel Ltd*                            | 494.973          | 3,50                         |
| 799   | Dixon Technologies India Ltd*                 | 167.371          | 1,18                         |
| 4.728   | Netweb Technologies India Ltd*                | 151.316          | 1,07                         |
| 2.310   | Persistent Systems Ltd*                       | 174.456          | 1,24                         |
| 96.707  | Zomato Ltd*                                   | 314.021          | 2,22                         |
| <b>Indische Rupie insgesamt</b>                     |   | <b>1.476.507</b> | <b>10,44</b>                 |
| <b>Japanischer Yen</b>                              |   |                  |                              |
| 13.700  | Anycolor Inc*                                 | 245.477          | 1,74                         |
| 3.800   | Appier Group Inc*                             | 35.302           | 0,25                         |
| 1.600   | Disco Corp*                                   | 435.022          | 3,08                         |
| 9.500   | Ebara Corp*                                   | 148.732          | 1,05                         |
| 8.600   | Fujikura Ltd*                                 | 358.315          | 2,53                         |
| 3.400   | IHI Corp*                                     | 201.434          | 1,43                         |
| 16.300  | Internet Initiative Japan Inc*                | 309.644          | 2,19                         |
| 34.400  | JVCKenwood Corp*                              | 382.283          | 2,70                         |
| 8.800   | Kawasaki Heavy Industries Ltd*                | 407.636          | 2,88                         |
| 3.500   | Kioxia Holdings Corp*                         | 36.523           | 0,26                         |
| 2.000   | Maruwa Co Ltd*                                | 615.296          | 4,35                         |
| 11.000  | Musashi Seimitsu Industry Co Ltd*             | 277.170          | 1,96                         |

## InnovAsia - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile  | Wertpapierbezeichnung                      | Zeitwert US\$    | % des Nettovermögens |
|---|--|------------------|----------------------|
| <b>Aktien 100,32 % (31. Dezember 2023: 94,76 %) (Fortsetzung)</b> |  |                  |                      |
| <b>Japanischer Yen (Fortsetzung)</b>                              |  |                  |                      |
| 10.000  | Nitto Boseki Co Ltd*                       | 408.501          | 2,89                 |
| 12.700  | Rigaku Holdings Corp*                      | 74.345           | 0,53                 |
| 8.800   | Shibaura Mechatronics Corp*                | 447.951          | 3,17                 |
| 6.600   | Tokuyama Corp*                             | 110.763          | 0,78                 |
| <b>Japanischer Yen insgesamt</b>                                  |  | <b>4.494.394</b> | <b>31,79</b>         |
| <b>Malaysischer Ringgit</b>                                       |  |                  |                      |
| 223.200   | Inari Amertron Bhd*                        | 152.743          | 1,08                 |
| 281.700   | Nationgate Holdings Bhd*                   | 159.388          | 1,13                 |
| <b>Malaysischer Ringgit insgesamt</b>                             |  | <b>312.131</b>   | <b>2,21</b>          |
| <b>Neuer taiwanesischer Dollar</b>                                |  |                  |                      |
| 19.000  | Accton Technology Corp*                    | 447.986          | 3,17                 |
| 16.000  | Acter Group Corp Ltd*                      | 181.305          | 1,28                 |
| 14.000  | Asustek Computer Inc*                      | 263.051          | 1,86                 |
| 10.000  | Bizlink Holding Inc*                       | 186.674          | 1,32                 |
| 5.000   | eMemory Technology Inc*                    | 511.675          | 3,62                 |
| 9.000   | Gigabyte Technology Co Ltd*                | 74.807           | 0,53                 |
| 5.000   | Global Unichip Corp*                       | 207.415          | 1,47                 |
| 52.000  | Gold Circuit Electronics Ltd*              | 383.047          | 2,71                 |
| 9.499   | Jentech Precision Industrial Co Ltd*       | 441.854          | 3,12                 |
| 5.000   | King Slide Works Co Ltd*                   | 236.392          | 1,67                 |
| 3.000   | MPI Corp*                                  | 84.735           | 0,60                 |
| 25.000  | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd* | 819.747          | 5,80                 |
| <b>Neuer taiwanesischer Dollar insgesamt</b>                      |  | <b>3.838.688</b> | <b>27,15</b>         |
| <b>Südkoreanischer Won</b>  |  |                  |                      |
| 1.853   | HD Hyundai Electric Co Ltd*                | 480.825          | 3,40                 |
| 2.534   | ISC Co Ltd*                                | 124.105          | 0,88                 |
| 1.131   | LEENO Industrial Inc*                      | 147.199          | 1,04                 |
| 2.526   | SK Hynix Inc*                              | 298.388          | 2,11                 |
| 10.545  | TechWing Inc*                              | 275.417          | 1,95                 |
| <b>Südkoreanischer Won insgesamt</b>                              |  | <b>1.325.934</b> | <b>9,38</b>          |
| <b>Thailändischer Baht</b>  |  |                  |                      |
| 296.600   | Cal-Comp Electronics Thailand PCL Class F* | 87.862           | 0,62                 |
| <b>Thailändischer Baht insgesamt</b>                              |  | <b>87.862</b>    | <b>0,62</b>          |
| <b>US-Dollar</b>  |  |                  |                      |
| 28.684  | DiDi Global Inc ADR**                      | 131.086          | 0,93                 |

## InnovAsia - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile  | Wertpapierbezeichnung                              | Zeitwert US\$     | % des Nettovermögens |
|---|--|-------------------|----------------------|
| <b>Aktien 100,32 % (31. Dezember 2023: 94,76 %) (Fortsetzung)</b> |  |                   |                      |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>                                    |  |                   |                      |
| 658   | Fabrinet*  | 144.681           | 1,02                 |
| 625   | MakeMyTrip Ltd*                                    | 70.175            | 0,50                 |
| 5.445   | New Oriental Education & Technology Group Inc ADR* | 349.460           | 2,47                 |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>  |  | <b>695.402</b>    | <b>4,92</b>          |
| <b>Vietnamesischer Dong</b>                                       |  |                   |                      |
| 88.134  | FPT Corp*  | 527.386           | 3,73                 |
| <b>Vietnamesischer Dong insgesamt</b>                             |  | <b>527.386</b>    | <b>3,73</b>          |
| <b>Aktien insgesamt</b>   |  | <b>14.184.289</b> | <b>100,32</b>        |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  |  | <b>14.184.289</b> | <b>100,32</b>        |

Devisenterminkontrakte 0,33 % (31. Dezember 2023: 1,26 %)

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i>   |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 33.249 US\$   | 29.327 CHF          | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 3         | 840                            | 0,01                 |
| 47.249 US\$   | 40.902 CHF          | 16.01.2025       | UBS AG                         | 7         | 2.047                          | 0,01                 |
| 85.085 US\$   | 74.702 CHF          | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 7         | 2.533                          | 0,02                 |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>   |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 42.562 US\$   | 40.244 €            | 16.01.2025       | Citibank NA                    | 1         | 867                            | 0,01                 |
| 292.487 US\$  | 274.982 €           | 16.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 3         | 7.592                          | 0,05                 |
| 199.858 US\$  | 190.221 €           | 16.01.2025       | Standard Chartered Bank        | 3         | 2.781                          | 0,02                 |
| 377.416 US\$  | 344.633 €           | 16.01.2025       | UBS AG                         | 6         | 20.359                         | 0,14                 |
| 218.031 US\$  | 205.216 €           | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 10        | 5.416                          | 0,04                 |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>   |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 6.645 US\$  | 8.631 SGD           | 16.01.2025       | Citibank NA                    | 1         | 315                            | 0,00                 |
| 54.488 US\$   | 72.918 SGD          | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 4         | 1.006                          | 0,01                 |
| 44.597 US\$   | 59.058 SGD          | 16.01.2025       | UBS AG                         | 4         | 1.281                          | 0,01                 |
| 56.792 US\$   | 74.883 SGD          | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 8         | 1.869                          | 0,01                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>o</sup></b> |                     |                  |                                |           | <b>46.906</b>                  | <b>0,33</b>          |

|  | Zeitwert US\$     | % des Nettovermögens |
|--|-------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> | <b>14.231.195</b> | <b>100,65</b>        |

## InnovAsia - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (3,20 %) (31. Dezember 2023: (0,25 %))

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens         |
|---|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|------------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i>   |                     |                  |                                |           |                                 |                              |
| 531.420 CHF   | 627.132 US\$        | 16.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (39.859)                        | (0,28)                       |
| 20.347 CHF  | 23.311 US\$         | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 3         | (825)                           | (0,01)                       |
| 36.173 CHF  | 41.051 US\$         | 16.01.2025       | UBS AG                         | 7         | (1.077)                         | (0,01)                       |
| 39.385 CHF  | 45.753 US\$         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 7         | (2.228)                         | (0,02)                       |
| 4.001 US\$  | 3.628 CHF           | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (8)                             | (0,00)                       |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>   |                     |                  |                                |           |                                 |                              |
| 4.995.678 €   | 5.507.377 US\$      | 16.01.2025       | Citibank NA                    | 2         | (331.603)                       | (2,34)                       |
| 74.811 €  | 81.010 US\$         | 16.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (3.502)                         | (0,02)                       |
| 564.101 €   | 606.174 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                         | 10        | (21.737)                        | (0,15)                       |
| 228.842 €   | 242.599 US\$        | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 5         | (5.507)                         | (0,04)                       |
| 38.394 US\$   | 37.084 €            | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 1         | (27)                            | (0,00)                       |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>   |                     |                  |                                |           |                                 |                              |
| 1.117.534 SGD   | 861.452 US\$        | 16.01.2025       | Citibank NA                    | 1         | (41.804)                        | (0,30)                       |
| 17.135 SGD  | 13.006 US\$         | 16.01.2025       | Standard Chartered Bank        | 1         | (438)                           | (0,00)                       |
| 26.839 SGD  | 20.046 US\$         | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 2         | (361)                           | (0,00)                       |
| 89.204 SGD  | 66.294 US\$         | 16.01.2025       | UBS AG                         | 6         | (868)                           | (0,01)                       |
| 78.850 SGD  | 60.519 US\$         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 8         | (2.687)                         | (0,02)                       |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>                          |                     |                  |                                |           | <b>(452.531)</b>                | <b>(3,20)</b>                |
|   |                     |                  |                                |           | <b>Zeitwert US\$</b>            | <b>% des Nettovermögens</b>  |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> |                     |                  |                                |           | <b>(452.531)</b>                | <b>(3,20)</b>                |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              |                     |                  |                                |           | <b>13.778.664</b>               | <b>97,45</b>                 |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  |                     |                  |                                |           | <b>360.374</b>                  | <b>2,55</b>                  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   |                     |                  |                                |           | <b>14.139.038</b>               | <b>100,00</b>                |
| <b>Portfolioanalyse</b>   |                     |                  |                                |           | <b>US\$</b>                     | <b>% des Gesamtvermögens</b> |
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind   |                     |                  |                                |           | 14.053.203                      | 95,23                        |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden              |                     |                  |                                |           | 131.086                         | 0,89                         |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente   |                     |                  |                                |           | (405.625)                       | (2,75)                       |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  |                     |                  |                                |           | <b>13.778.664</b>               | <b>93,37</b>                 |

## Japan Equity Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der Anteile                                 | Wertpapierbezeichnung            | Zeitwert JPY  | % des Nettovermögens |
|--|----------------------------------|---------------|----------------------|
| <b>Aktien 99,05 % (31. Dezember 2023: 98,67 %)</b> |                                  |               |                      |
| <b>Japanischer Yen</b>                             |                                  |               |                      |
| 90.000   | ABC-Mart Inc                     | 287.190.000   | 1,19                 |
| 320.000  | Amada Co Ltd                     | 491.840.000   | 2,03                 |
| 106.600  | As One Corp                      | 282.596.600   | 1,17                 |
| 50.000   | Asahi Intecc Co Ltd              | 128.800.000   | 0,53                 |
| 180.000  | Asics Corp                       | 559.800.000   | 2,31                 |
| 90.000   | baudroie inc                     | 444.150.000   | 1,83                 |
| 160.000  | Dai-Dan Co Ltd                   | 617.600.000   | 2,55                 |
| 250.000  | Daiei Kankyo Co Ltd              | 722.750.000   | 2,98                 |
| 280.000  | Daiwa Industries Ltd             | 429.520.000   | 1,77                 |
| 120.000  | eGuarantee Inc                   | 213.720.000   | 0,88                 |
| 200.000  | EUCALIA Inc                      | 186.000.000   | 0,77                 |
| 60.000   | eWeLL Co Ltd                     | 117.900.000   | 0,49                 |
| 90.000   | FP Partner Inc                   | 185.220.000   | 0,76                 |
| 140.000  | Hachijuni Bank Ltd               | 141.750.000   | 0,58                 |
| 24.000   | Inforich Inc                     | 100.080.000   | 0,41                 |
| 70.000   | Internet Initiative Japan Inc    | 208.985.000   | 0,86                 |
| 250.000  | Itoki Corp                       | 411.750.000   | 1,70                 |
| 268.000  | JSB Co Ltd                       | 737.000.000   | 3,04                 |
| 6.600  | Juroku Financial Group Inc       | 28.248.000    | 0,12                 |
| 30.000   | Justsystems Corp                 | 105.450.000   | 0,44                 |
| 180.000  | Keisei Electric Railway Co Ltd   | 255.330.000   | 1,05                 |
| 200.000  | Kinden Corp                      | 607.200.000   | 2,51                 |
| 850.000  | Kosaido Holdings Co Ltd          | 429.250.000   | 1,77                 |
| 40.000   | Life Corp                        | 140.600.000   | 0,58                 |
| 100.000  | Lifedrink Co Inc                 | 227.400.000   | 0,94                 |
| 220.000  | Lion Corp                        | 387.750.000   | 1,60                 |
| 13.500   | Mamezo Digital Holdings Co Ltd   | 16.983.000    | 0,07                 |
| 65.000   | Menicon Co Ltd                   | 91.000.000    | 0,38                 |
| 100.000  | Midac Holdings Co Ltd            | 156.000.000   | 0,64                 |
| 50.000   | MISUMI Group Inc                 | 122.750.000   | 0,51                 |
| 700.000  | Mitsubishi Logistics Corp        | 810.600.000   | 3,34                 |
| 100.000  | Mitsubishi Pencil Co Ltd         | 230.200.000   | 0,95                 |
| 180.000  | Musashi Seimitsu Industry Co Ltd | 712.800.000   | 2,94                 |
| 24.000   | Nifco Inc                        | 91.896.000    | 0,38                 |
| 160.000  | Niterra Co Ltd                   | 812.800.000   | 3,35                 |
| 290.000  | Okinawa Cellular Telephone Co    | 1.261.500.000 | 5,21                 |
| 140.000  | Open Up Group Inc                | 250.880.000   | 1,04                 |
| 150.000  | Osaka Soda Co Ltd                | 299.400.000   | 1,24                 |
| 50.000   | Pilot Corp                       | 243.100.000   | 1,00                 |

## Japan Equity Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile   | Wertpapierbezeichnung            | Zeitwert JPY          | % des Nettovermögens |
|--|----------------------------------|-----------------------|----------------------|
| <b>Aktien 99,05 % (31. Dezember 2023: 98,67 %) (Fortsetzung)</b> |                                  |                       |                      |
| <b>Japanischer Yen (Fortsetzung)</b>                             |                                  |                       |                      |
| 100.000  | Premium Group Co Ltd             | 258.400.000           | 1,07                 |
| 100.000  | Reiwa Accounting Holdings Co Ltd | 47.500.000            | 0,20                 |
| 270.000  | Resorttrust Inc                  | 848.340.000           | 3,50                 |
| 200.000  | Ricoh Co Ltd                     | 362.300.000           | 1,50                 |
| 35.000   | Ryohin Keikaku Co Ltd            | 125.930.000           | 0,52                 |
| 100.000  | San-A Co Ltd                     | 290.600.000           | 1,20                 |
| 155.000  | Sanwa Holdings Corp              | 682.310.000           | 2,82                 |
| 70.000   | SBI Sumishin Net Bank Ltd        | 265.300.000           | 1,09                 |
| 240.000  | Shimizu Corp                     | 300.600.000           | 1,24                 |
| 40.000   | Shoei Co Ltd                     | 90.120.000            | 0,37                 |
| 370.000  | Shofu Inc                        | 817.330.000           | 3,37                 |
| 120.000  | Sinfonia Technology Co Ltd       | 770.400.000           | 3,18                 |
| 90.000   | TBS Holdings Inc                 | 364.590.000           | 1,50                 |
| 120.000  | TKC Corp                         | 456.000.000           | 1,88                 |
| 70.000   | Tokyo Century Corp               | 112.210.000           | 0,46                 |
| 25.000   | Tokyo Seimitsu Co Ltd            | 183.925.000           | 0,76                 |
| 40.000   | Tokyotokeiba Co Ltd              | 181.600.000           | 0,75                 |
| 780.000  | Tokyu Fudosan Holdings Corp      | 754.728.000           | 3,11                 |
| 350.000  | Transaction Co Ltd               | 726.250.000           | 3,00                 |
| 200.000  | TRYT Inc                         | 81.800.000            | 0,34                 |
| 55.000   | Tsumura & Co                     | 258.940.000           | 1,07                 |
| 530.000  | USS Co Ltd                       | 729.810.000           | 3,01                 |
| 34.000   | WingArc1st Inc                   | 127.840.000           | 0,53                 |
| 460.000  | Yamanashi Chuo Bank Ltd          | 868.020.000           | 3,58                 |
| 80.000   | Yamazaki Baking Co Ltd           | 235.480.000           | 0,97                 |
| 90.000   | Yokogawa Electric Corp           | 305.820.000           | 1,26                 |
| 50.000   | Zuken Inc                        | 207.500.000           | 0,86                 |
|  | <b>Aktien insgesamt *</b>        | <b>24.001.431.600</b> | <b>99,05</b>         |
|  | <b>Anlagen insgesamt</b>         | <b>24.001.431.600</b> | <b>99,05</b>         |

## Devisenterminkontrakte 0,00 % (31. Dezember 2023: 0,79 %)

| Geforderter Betrag              | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn JPY | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|-------------------------------|----------------------|
| 1 £                             | 248 ¥               | 08.01.2025       | Brown Brothers Harriman        | 1         | 0                             | 0,00                 |
| 838.417 ¥                       | 4.231 £             | 07.01.2025       | Brown Brothers Harriman        | 7         | 6.828                         | 0,00                 |
| 630.750 ¥                       | 3.202 £             | 06.01.2025       | Brown Brothers Harriman        | 5         | 1.285                         | 0,00                 |
| 209.337 ¥                       | 1.064 £             | 08.01.2025       | Brown Brothers Harriman        | 5         | 215                           | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> |                     |                  |                                |           |                               |                      |
| 36.019 €                        | 5.811.658 ¥         | 16.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 59.481                        | 0,00                 |
| 3.519 €                         | 561.806 ¥           | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 10        | 11.790                        | 0,00                 |

## Japan Equity Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 0,00 % (31. Dezember 2023: 0,79 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn JPY | % des Nettovermögens        |
|--|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|-------------------------------|-----------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR (Fortsetzung)</i>  |                     |                  |                                |           |                               |                             |
| 894 €  | 143.525 ¥           | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 2         | 2.197                         | 0,00                        |
| 175.735 ¥  | 1.072 €             | 16.01.2025       | Standard Chartered Bank        | 2         | 999                           | 0,00                        |
| 49.866 ¥   | 303 €               | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 477                           | 0,00                        |
| 38.366 ¥   | 235 €               | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 1         | 61                            | 0,00                        |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>  |                     |                  |                                |           |                               |                             |
| 426 £  | 81.579 ¥            | 16.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 1.970                         | 0,00                        |
| 52 £   | 9.970 ¥             | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 11        | 238                           | 0,00                        |
| 10 £   | 1.915 ¥             | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 2         | 48                            | 0,00                        |
| 590 ¥  | 3 £                 | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 1                             | 0,00                        |
| <i>Abgesicherte Klassen USD</i>  |                     |                  |                                |           |                               |                             |
| 460 US\$   | 68.657 ¥            | 16.01.2025       | Citibank NA                    | 1         | 3.534                         | 0,00                        |
| 64.279 US\$  | 9.405.027 ¥         | 16.01.2025       | Standard Chartered Bank        | 1         | 682.702                       | 0,00                        |
| 10.001 US\$  | 1.500.712 ¥         | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 14        | 68.810                        | 0,00                        |
| 2.103 US\$   | 309.904 ¥           | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 3         | 20.134                        | 0,00                        |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>                        |                     |                  |                                |           | <b>860.770</b>                | <b>0,00</b>                 |
|  |                     |                  |                                |           | <b>Zeitwert JPY</b>           | <b>% des Nettovermögens</b> |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |                     |                  |                                |           | <b>24.002.292.370</b>         | <b>99,05</b>                |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (0,00 %) (31. Dezember 2023: (0,26 %))

| Geforderter Betrag              | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust JPY | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 6.805 £                         | 1.348.348 ¥         | 07.01.2025       | Brown Brothers Harriman        | 5         | (10.982)                       | (0,00)               |
| 68.468 £                        | 13.486.830 ¥        | 06.01.2025       | Brown Brothers Harriman        | 6         | (27.468)                       | (0,00)               |
| 2.602 £                         | 511.797 ¥           | 08.01.2025       | Brown Brothers Harriman        | 5         | (528)                          | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 649 €                           | 106.670 ¥           | 16.01.2025       | Citibank NA                    | 1         | (884)                          | (0,00)               |
| 1.609 €                         | 263.859 ¥           | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 4         | (1.592)                        | (0,00)               |
| 282 €                           | 46.739 ¥            | 16.01.2025       | UBS AG                         | 1         | (773)                          | (0,00)               |
| 146.478 ¥                       | 912 €               | 16.01.2025       | Standard Chartered Bank        | 2         | (2.177)                        | (0,00)               |
| 337.015 ¥                       | 2.111 €             | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 6         | (7.077)                        | (0,00)               |
| 82.191 ¥                        | 516 €               | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 2         | (1.917)                        | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 18 £                            | 3.547 ¥             | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 3         | (13)                           | (0,00)               |
| 3 £                             | 591 ¥               | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 1         | (2)                            | (0,00)               |
| 578 ¥                           | 3 £                 | 16.01.2025       | Standard Chartered Bank        | 1         | (11)                           | (0,00)               |
| 7.468 ¥                         | 39 £                | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 8         | (188)                          | (0,00)               |
| 2.716 ¥                         | 14 £                | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 4         | (33)                           | (0,00)               |

## Japan Equity Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Devisenterminkontrakte (0,00 %) (31. Dezember 2023: (0,26 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust JPY | % des Nettovermögens         |
|---|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|------------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen USD</i>   |                     |                  |                                |           |                                |                              |
| 52.102 ¥  | 352 US\$            | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | (3.140)                        | (0,00)                       |
| 518.888 ¥   | 3.517 US\$          | 16.01.2025       | Standard Chartered Bank        | 4         | (33.058)                       | (0,00)                       |
| 476.929 ¥   | 3.210 US\$          | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 4         | (26.837)                       | (0,00)                       |
| 313.891 ¥   | 2.102 US\$          | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 5         | (15.989)                       | (0,00)                       |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>                          |                     |                  |                                |           | <b>(132.669)</b>               | <b>(0,00)</b>                |
|   |                     |                  |                                |           | <b>Zeitwert JPY</b>            | <b>% des Nettovermögens</b>  |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> |                     |                  |                                |           | <b>(132.669)</b>               | <b>(0,00)</b>                |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              |                     |                  |                                |           | <b>24.002.159.701</b>          | <b>99,05</b>                 |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  |                     |                  |                                |           | <b>230.475.893</b>             | <b>0,95</b>                  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   |                     |                  |                                |           | <b>24.232.635.594</b>          | <b>100,00</b>                |
| <b>Portfolioanalyse</b>   |                     |                  |                                |           | <b>JPY</b>                     | <b>% des Gesamtvermögens</b> |
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind   |                     |                  |                                |           | 24.001.431.600                 | 98,93                        |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente   |                     |                  |                                |           | 728.101                        | 0,00                         |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  |                     |                  |                                |           | <b>24.002.159.701</b>          | <b>98,93</b>                 |

## Next Generation Connectivity - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der<br>Anteile                              | Wertpapierbezeichnung                     | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|-------------------|------------------------------|
| <b>Aktien 97,82 % (31. Dezember 2023: 94,92 %)</b> |   |                   |                              |
| <b>Euro</b>  |   |                   |                              |
| 8.887  | Adyen NV                                  | 13.223.976        | 1,24                         |
| 21.094   | ASM International NV                      | 12.205.777        | 1,15                         |
| 16.476   | ASML Holding NV                           | 11.579.231        | 1,09                         |
| 445.591  | Deutsche Telekom AG                       | 13.330.120        | 1,25                         |
| 418.466  | Infineon Technologies AG                  | 13.606.296        | 1,28                         |
| 45.802   | SAP SE                                    | 11.207.230        | 1,06                         |
| <b>Euro insgesamt</b>                              |   | <b>75.152.630</b> | <b>7,07</b>                  |
| <b>Japanischer Yen</b>                             |   |                   |                              |
| 187.400  | Advantest Corp                            | 10.667.890        | 1,00                         |
| 128.500  | Disco Corp                                | 34.128.274        | 3,21                         |
| 894.300  | Fujikura Ltd                              | 36.553.498        | 3,44                         |
| 650.500  | Mitsubishi Electric Corp                  | 10.997.112        | 1,04                         |
| <b>Japanischer Yen insgesamt</b>                   |   | <b>92.346.774</b> | <b>8,69</b>                  |
| <b>Neuer taiwanesischer Dollar</b>                 |   |                   |                              |
| 2.891.000  | Hon Hai Precision Industry Co Ltd         | 16.225.472        | 1,53                         |
| 66.000   | MediaTek Inc                              | 2.848.602         | 0,27                         |
| 3.257.000  | Quanta Computer Inc                       | 28.512.224        | 2,68                         |
| 1.486.000  | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd | 48.725.770        | 4,58                         |
| <b>Neuer taiwanesischer Dollar insgesamt</b>       |   | <b>96.312.068</b> | <b>9,06</b>                  |
| <b>Südkoreanischer Won</b>                         |   |                   |                              |
| 304.020  | SK Hynix Inc                              | 34.837.751        | 3,28                         |
| <b>Südkoreanischer Won insgesamt</b>               |   | <b>34.837.751</b> | <b>3,28</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>                                   |   |                   |                              |
| 110.851  | Advanced Micro Devices Inc                | 13.389.692        | 1,26                         |
| 270.986  | Amazon.com Inc                            | 59.451.618        | 5,59                         |
| 228.002  | Amphenol Corp Class A                     | 15.834.739        | 1,49                         |
| 51.835   | Analog Devices Inc                        | 11.012.864        | 1,04                         |
| 22.956   | AppLovin Corp Class A                     | 7.433.841         | 0,70                         |
| 339.714  | Arista Networks Inc                       | 37.548.588        | 3,53                         |
| 86.906   | ARM Holdings Plc ADR                      | 10.720.724        | 1,01                         |
| 216.509  | Broadcom Inc                              | 50.195.447        | 4,72                         |
| 27.104   | Cadence Design Systems Inc                | 8.143.668         | 0,77                         |
| 62.188   | Celestica Inc                             | 5.739.952         | 0,54                         |
| 85.622   | Coherent Corp                             | 8.110.972         | 0,76                         |
| 36.383   | Corpay Inc                                | 12.312.735        | 1,16                         |

## Next Generation Connectivity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile   | Wertpapierbezeichnung                | Zeitwert US\$        | % des Nettovermögens |
|--|--------------------------------------|----------------------|----------------------|
| <b>Aktien 97,82 % (31. Dezember 2023: 94,92 %) (Fortsetzung)</b> |                                      |                      |                      |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>                                   |                                      |                      |                      |
| 162.668  | Credo Technology Group Holding Ltd   | 10.932.916           | 1,03                 |
| 30.813   | Crowdstrike Holdings Inc Class A     | 10.542.976           | 0,99                 |
| 8.580  | CyberArk Software Ltd                | 2.858.427            | 0,27                 |
| 68.934   | Datadog Inc Class A                  | 9.849.979            | 0,93                 |
| 109.394  | Dell Technologies Inc Class C        | 12.606.565           | 1,19                 |
| 134.809  | Dexcom Inc                           | 10.484.096           | 0,99                 |
| 13.156   | Fiserv Inc                           | 2.702.505            | 0,25                 |
| 320.783  | Flex Ltd                             | 12.314.859           | 1,16                 |
| 99.083   | GoDaddy Inc Class A                  | 19.556.012           | 1,84                 |
| 77.168   | International Business Machines Corp | 16.963.841           | 1,59                 |
| 37.385   | Intuitive Surgical Inc               | 19.513.475           | 1,83                 |
| 78.860   | JD.com Inc ADR                       | 2.734.076            | 0,26                 |
| 110.120  | Lam Research Corp                    | 7.953.968            | 0,75                 |
| 145.515  | Marvell Technology Inc               | 16.072.132           | 1,51                 |
| 78.180   | Meta Platforms Inc Class A           | 45.775.172           | 4,30                 |
| 143.127  | Micron Technology Inc                | 12.045.568           | 1,13                 |
| 70.398   | Microsoft Corp                       | 29.672.757           | 2,79                 |
| 58.893   | Monday.com Ltd                       | 13.865.768           | 1,30                 |
| 20.854   | Netflix Inc                          | 18.587.587           | 1,75                 |
| 447.438  | NVIDIA Corp                          | 60.086.449           | 5,65                 |
| 49.720   | Onto Innovation Inc                  | 8.286.832            | 0,78                 |
| 97.908   | Palo Alto Networks Inc               | 17.815.340           | 1,68                 |
| 87.259   | QUALCOMM Inc                         | 13.404.728           | 1,26                 |
| 47.124   | Salesforce Inc                       | 15.754.967           | 1,48                 |
| 329.090  | SentinelOne Inc Class A              | 7.305.798            | 0,69                 |
| 16.448   | ServiceNow Inc                       | 17.436.854           | 1,64                 |
| 25.160   | Shopify Inc Class A                  | 2.675.263            | 0,25                 |
| 120.510  | Take-Two Interactive Software Inc    | 22.183.481           | 2,09                 |
| 142.610  | T-Mobile US Inc                      | 31.478.305           | 2,96                 |
| 187.625  | Western Digital Corp                 | 11.188.079           | 1,05                 |
| 6.971  | Zebra Technologies Corp Class A      | 2.692.340            | 0,25                 |
| 216.672  | Zillow Group Inc Class C             | 16.044.562           | 1,51                 |
|  | <b>US-Dollar insgesamt</b>           | <b>741.280.517</b>   | <b>69,72</b>         |
|  | <b>Aktien insgesamt *</b>            | <b>1.039.929.740</b> | <b>97,82</b>         |
|  | <b>Anlagen insgesamt</b>             | <b>1.039.929.740</b> | <b>97,82</b>         |

## Next Generation Connectivity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 0,25 % (31. Dezember 2023: 0,61 %)

| Geforderter Betrag              | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 201 AUD                         | 124 US\$            | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 1         | 0                              | 0,00                 |
| 3.352.320 US\$                  | 5.111.731 AUD       | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 9         | 187.332                        | 0,02                 |
| 217.759 US\$                    | 345.607 AUD         | 16.01.2025       | UBS AG                         | 1         | 3.772                          | 0,00                 |
| 7.809.957 US\$                  | 11.703.108 AUD      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 57        | 563.846                        | 0,05                 |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i> |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 1.737 US\$                      | 1.547 CHF           | 16.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 27                             | 0,00                 |
| 2.276 US\$                      | 2.002 CHF           | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 2         | 64                             | 0,00                 |
| 13.584 US\$                     | 11.851 CHF          | 16.01.2025       | UBS AG                         | 6         | 487                            | 0,00                 |
| 9.827 US\$                      | 8.482 CHF           | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 5         | 453                            | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen CNY</i> |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 34.207 US\$                     | 245.198 CNY         | 16.01.2025       | UBS AG                         | 6         | 810                            | 0,00                 |
| 68.765 US\$                     | 494.194 CNY         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 9         | 1.452                          | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 52.151 €                        | 54.029 US\$         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 2         | 2                              | 0,00                 |
| 721.108 US\$                    | 681.845 €           | 16.01.2025       | Citibank NA                    | 1         | 14.682                         | 0,00                 |
| 9.297.416 US\$                  | 8.582.036 €         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 4         | 405.993                        | 0,04                 |
| 1.894.359 US\$                  | 1.787.471 €         | 16.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | 42.449                         | 0,00                 |
| 979.512 US\$                    | 930.373 €           | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 15.599                         | 0,00                 |
| 9.634.466 US\$                  | 9.041.994 €         | 16.01.2025       | UBS AG                         | 6         | 266.503                        | 0,03                 |
| 10.699.370 US\$                 | 9.968.298 €         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 86        | 371.708                        | 0,04                 |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 79.954 £                        | 100.102 US\$        | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 20                             | 0,00                 |
| 12.203 £                        | 15.269 US\$         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 3         | 13                             | 0,00                 |
| 1.026.982 US\$                  | 794.312 £           | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 5         | 32.299                         | 0,00                 |
| 222.683 US\$                    | 171.052 £           | 16.01.2025       | Standard Chartered Bank        | 2         | 8.482                          | 0,00                 |
| 810.649 US\$                    | 630.146 £           | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 5         | 21.545                         | 0,00                 |
| 2.526.879 US\$                  | 1.971.721 £         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 31        | 57.776                         | 0,01                 |
| <i>Abgesicherte Klassen HKD</i> |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 992.408 HKD                     | 127.556 US\$        | 16.01.2025       | BNP Paribas                    | 1         | 211                            | 0,00                 |
| 2.133.861 HKD                   | 274.348 US\$        | 16.01.2025       | Citibank NA                    | 1         | 375                            | 0,00                 |
| 2.155.515 HKD                   | 277.117 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | 393                            | 0,00                 |
| 1.286.492 HKD                   | 165.537 US\$        | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 2         | 91                             | 0,00                 |
| 3.735.217 HKD                   | 480.852 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                         | 2         | 37                             | 0,00                 |
| 18.404.597 HKD                  | 2.367.350 US\$      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 34        | 2.137                          | 0,00                 |
| 185.772 US\$                    | 1.442.930 HKD       | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 3                              | 0,00                 |
| 945.541 US\$                    | 7.338.909 HKD       | 16.01.2025       | UBS AG                         | 4         | 697                            | 0,00                 |
| 4.118.073 US\$                  | 31.957.163 HKD      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 35        | 3.769                          | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i> |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 1.219.858 US\$                  | 1.606.178 SGD       | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 2         | 41.817                         | 0,00                 |
| 538.480 US\$                    | 721.011 SGD         | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 2         | 9.659                          | 0,00                 |

## Next Generation Connectivity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 0,25 % (31. Dezember 2023: 0,61 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens        |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|-----------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen SGD (Fortsetzung)</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 544.770 US\$   | 710.271 SGD         | 16.01.2025       | UBS AG                      | 2         | 23.826                         | 0,00                        |
| 7.484.632 US\$   | 9.978.567 SGD       | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 84        | 165.915                        | 0,02                        |
| <i>Abgesicherte Klassen ZAR</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 505.902 US\$   | 9.123.588 ZAR       | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 10        | 23.002                         | 0,00                        |
| 6.994.846 US\$   | 124.293.842 ZAR     | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 58        | 416.130                        | 0,04                        |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>                        |                     |                  |                             |           | <b>2.683.376</b>               | <b>0,25</b>                 |
|  |                     |                  |                             |           | <b>Zeitwert US\$</b>           | <b>% des Nettovermögens</b> |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |                     |                  |                             |           | <b>1.042.613.116</b>           | <b>98,07</b>                |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (1,22 %) (31. Dezember 2023: (0,10 %))

| Geforderter Betrag              | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 31.704.709 AUD                  | 21.384.868 US\$     | 16.01.2025       | Citibank NA                    | 1         | (1.754.526)                     | (0,17)               |
| 3.005.421 AUD                   | 2.012.661 US\$      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 9         | (151.820)                       | (0,02)               |
| 1.115.050 AUD                   | 727.210 US\$        | 16.01.2025       | Standard Chartered Bank        | 1         | (36.814)                        | (0,00)               |
| 1.217.322 AUD                   | 790.923 US\$        | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 5         | (37.204)                        | (0,00)               |
| 1.444.747 AUD                   | 942.115 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                         | 3         | (47.583)                        | (0,01)               |
| 5.393.341 AUD                   | 3.480.673 US\$      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 66        | (141.326)                       | (0,01)               |
| 221.128 US\$                    | 357.615 AUD         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | (293)                           | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i> |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 107.657 CHF                     | 128.807 US\$        | 16.01.2025       | Citibank NA                    | 1         | (9.835)                         | (0,00)               |
| 1.602 CHF                       | 1.884 US\$          | 16.01.2025       | Standard Chartered Bank        | 1         | (113)                           | (0,00)               |
| 6.972 CHF                       | 7.962 US\$          | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 6         | (257)                           | (0,00)               |
| 10.743 CHF                      | 12.369 US\$         | 16.01.2025       | UBS AG                         | 6         | (497)                           | (0,00)               |
| 11.041 CHF                      | 12.757 US\$         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 8         | (555)                           | (0,00)               |
| 1.687 US\$                      | 1.530 CHF           | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (3)                             | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen CNY</i> |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 3.572.893 CNY                   | 508.998 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                         | 9         | (22.346)                        | (0,00)               |
| 479.673 CNY                     | 66.857 US\$         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 13        | (1.520)                         | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 95.462.190 €                    | 105.254.539 US\$    | 16.01.2025       | Citibank NA                    | 1         | (6.350.898)                     | (0,60)               |
| 3.180.473 €                     | 3.427.141 US\$      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 3         | (132.011)                       | (0,01)               |
| 5.286.587 €                     | 5.782.460 US\$      | 16.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 3         | (305.291)                       | (0,03)               |
| 1.667.084 €                     | 1.783.502 US\$      | 16.01.2025       | Standard Chartered Bank        | 2         | (56.318)                        | (0,01)               |
| 559.766 €                       | 589.206 US\$        | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (9.261)                         | (0,00)               |

## Next Generation Connectivity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (1,22 %) (31. Dezember 2023: (0,10 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR (Fortsetzung)</i>                                    |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 10.811.279 €   | 11.609.464 US\$     | 16.01.2025       | UBS AG                         | 9         | (408.433)                       | (0,04)               |
| 10.400.545 €   | 11.165.697 US\$     | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 41        | (390.205)                       | (0,04)               |
| 1.342.070 US\$   | 1.296.043 €         | 16.01.2025       | UBS AG                         | 1         | (695)                           | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>  |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 52.799 £   | 66.154 US\$         | 16.01.2025       | BNP Paribas                    | 1         | (35)                            | (0,00)               |
| 9.663.393 £  | 12.662.226 US\$     | 16.01.2025       | Citibank NA                    | 3         | (561.173)                       | (0,05)               |
| 215.909 £  | 278.265 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 2         | (7.891)                         | (0,00)               |
| 53.545 £   | 67.952 US\$         | 16.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (900)                           | (0,00)               |
| 109.588 £  | 142.203 US\$        | 16.01.2025       | Standard Chartered Bank        | 1         | (4.971)                         | (0,00)               |
| 546.181 £  | 704.881 US\$        | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 4         | (20.922)                        | (0,00)               |
| 470.565 £  | 600.650 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                         | 3         | (11.382)                        | (0,00)               |
| 1.625.327 £  | 2.101.094 US\$      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 35        | (65.763)                        | (0,01)               |
| 416.488 US\$   | 332.820 £           | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | (289)                           | (0,00)               |
| 152.860 US\$   | 122.121 £           | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 2         | (67)                            | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen HKD</i>  |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 1.915.521 HKD  | 246.886 US\$        | 16.01.2025       | BNP Paribas                    | 1         | (273)                           | (0,00)               |
| 4.331.376 HKD  | 558.228 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 3         | (588)                           | (0,00)               |
| 4.019.248 HKD  | 517.667 US\$        | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 2         | (211)                           | (0,00)               |
| 5.087.362 HKD  | 655.426 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                         | 4         | (457)                           | (0,00)               |
| 147.127.145 HKD  | 18.959.417 US\$     | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 24        | (17.627)                        | (0,00)               |
| 471.474 US\$   | 3.664.981 HKD       | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 3         | (371)                           | (0,00)               |
| 739.247 US\$   | 5.748.449 HKD       | 16.01.2025       | UBS AG                         | 4         | (834)                           | (0,00)               |
| 4.493.237 US\$   | 34.929.404 HKD      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 30        | (3.727)                         | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>  |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 40.286.617 SGD   | 31.053.244 US\$     | 16.01.2025       | Citibank NA                    | 3         | (1.505.275)                     | (0,14)               |
| 1.584.938 SGD  | 1.183.910 US\$      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 3         | (21.447)                        | (0,00)               |
| 880.169 SGD  | 668.073 US\$        | 16.01.2025       | Standard Chartered Bank        | 1         | (22.519)                        | (0,00)               |
| 2.227.082 SGD  | 1.672.180 US\$      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 5         | (38.741)                        | (0,01)               |
| 2.177.720 SGD  | 1.633.726 US\$      | 16.01.2025       | UBS AG                         | 3         | (36.490)                        | (0,00)               |
| 3.824.049 SGD  | 2.909.924 US\$      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 47        | (105.200)                       | (0,01)               |
| <i>Abgesicherte Klassen ZAR</i>  |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 41.478 US\$  | 785.170 ZAR         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | (81)                            | (0,00)               |
| 8.138.218 ZAR  | 454.664 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 9         | (23.918)                        | (0,00)               |
| 81.499.227 ZAR   | 4.614.923 US\$      | 16.01.2025       | Standard Chartered Bank        | 2         | (301.273)                       | (0,03)               |
| 103.970.779 ZAR  | 5.827.227 US\$      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 75        | (324.192)                       | (0,03)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                                |           | <b>(12.934.421)</b>             | <b>(1,22)</b>        |

## Next Generation Connectivity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

|   | Zeitwert<br>US\$     | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|---|----------------------|------------------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(12.934.421)</b>  | <b>(1,22)</b>                |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>1.029.678.695</b> | <b>96,85</b>                 |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>33.505.267</b>    | <b>3,15</b>                  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>1.063.183.962</b> | <b>100,00</b>                |

| Portfolioanalyse  | US\$                 | % des<br>Gesamtver-<br>mögens |
|---|----------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 1.039.929.740        | 95,97                         |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente   | (10.251.045)         | (0,95)                        |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>1.029.678.695</b> | <b>95,02</b>                  |

## Next Generation Mobility - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der Anteile                                 | Wertpapierbezeichnung                         | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|-------------------|------------------------------|
| <b>Aktien 98,90 % (31. Dezember 2023: 91,99 %)</b> |   |                   |                              |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi</b>                  |   |                   |                              |
| 154.400  | Contemporary Ampere Technology Co Ltd Class A | 5.594.279         | 4,56                         |
| <b>Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt</b>        |   | <b>5.594.279</b>  | <b>4,56</b>                  |
| <b>Euro</b>  |   |                   |                              |
| 12.888   | Ferrari NV                                    | 5.497.439         | 4,47                         |
| 156.247  | Infineon Technologies AG                      | 5.080.324         | 4,14                         |
| 13.683   | Schneider Electric SE                         | 3.413.251         | 2,78                         |
| <b>Euro insgesamt</b>                              |   | <b>13.991.014</b> | <b>11,39</b>                 |
| <b>Hongkong-Dollar</b>                             |   |                   |                              |
| 141.000  | BYD Co Ltd - H Shares                         | 4.839.192         | 3,94                         |
| <b>Hongkong-Dollar insgesamt</b>                   |   | <b>4.839.192</b>  | <b>3,94</b>                  |
| <b>Japanischer Yen</b>                             |   |                   |                              |
| 245.800  | Hitachi Ltd                                   | 6.026.743         | 4,91                         |
| <b>Japanischer Yen insgesamt</b>                   |   | <b>6.026.743</b>  | <b>4,91</b>                  |
| <b>Neuer taiwanesischer Dollar</b>                 |   |                   |                              |
| 124.000  | Silergy Corp                                  | 1.526.148         | 1,24                         |
| <b>Neuer taiwanesischer Dollar insgesamt</b>       |   | <b>1.526.148</b>  | <b>1,24</b>                  |
| <b>Südkoreanischer Won</b>                         |   |                   |                              |
| 44.747   | Hanmi Semiconductor Co Ltd                    | 2.452.944         | 2,00                         |
| 15.251   | HD Hyundai Heavy Industries Co Ltd            | 2.953.609         | 2,41                         |
| 87.519   | Kia Corp                                      | 5.922.373         | 4,82                         |
| 4.808  | L&F Co Ltd                                    | 259.917           | 0,21                         |
| 279.084  | Samsung Heavy Industries Co Ltd               | 2.129.280         | 1,73                         |
| 6.167  | Samsung SDI Co Ltd                            | 1.019.336         | 0,83                         |
| <b>Südkoreanischer Won insgesamt</b>               |   | <b>14.737.459</b> | <b>12,00</b>                 |
| <b>Schweizer Franken</b>                           |   |                   |                              |
| 51.009   | ABB Ltd                                       | 2.758.361         | 2,25                         |
| <b>Schweizer Franken insgesamt</b>                 |   | <b>2.758.361</b>  | <b>2,25</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>                                   |   |                   |                              |
| 24.254   | Albemarle Corp                                | 2.087.784         | 1,70                         |
| 9.653  | Alphabet Inc Class A                          | 1.827.313         | 1,49                         |
| 50.277   | Amphenol Corp Class A                         | 3.491.738         | 2,84                         |
| 28.623   | Applied Materials Inc                         | 4.654.958         | 3,79                         |

## Next Generation Mobility - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile   | Wertpapierbezeichnung                         | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens |
|--|---|--------------------|----------------------|
| <b>Aktien 98,90 % (31. Dezember 2023: 91,99 %) (Fortsetzung)</b> |   |                    |                      |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>                                   |   |                    |                      |
| 6.196  | ASML Holding NV                               | 4.294.324          | 3,50                 |
| 1.405  | Aspen Technology Inc                          | 350.730            | 0,29                 |
| 54.655   | Bentley Systems Inc Class B                   | 2.552.389          | 2,08                 |
| 10.393   | Cadence Design Systems Inc                    | 3.122.681          | 2,54                 |
| 12.719   | Copart Inc                                    | 729.943            | 0,59                 |
| 10.241   | Eaton Corp Plc                                | 3.398.681          | 2,77                 |
| 10.780   | HEICO Corp                                    | 2.562.837          | 2,09                 |
| 4.770  | Linde Plc                                     | 1.997.056          | 1,63                 |
| 47.744   | MakeMyTrip Ltd                                | 5.360.696          | 4,36                 |
| 17.339   | Micron Technology Inc                         | 1.459.250          | 1,19                 |
| 4.375  | Monolithic Power Systems Inc                  | 2.588.688          | 2,11                 |
| 42.438   | nVent Electric Plc                            | 2.892.574          | 2,36                 |
| 28.853   | NVIDIA Corp                                   | 3.874.669          | 3,15                 |
| 8.422  | NXP Semiconductors NV                         | 1.750.513          | 1,42                 |
| 72.844   | ON Semiconductor Corp                         | 4.592.814          | 3,74                 |
| 13.386   | Onto Innovation Inc                           | 2.231.045          | 1,82                 |
| 2.910  | SiTime Corp                                   | 624.282            | 0,51                 |
| 5.398  | Synopsys Inc                                  | 2.619.973          | 2,13                 |
| 29.361   | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR | 5.798.504          | 4,72                 |
| 8.727  | TE Connectivity Plc                           | 1.247.699          | 1,02                 |
| 10.014   | Teradyne Inc                                  | 1.260.963          | 1,03                 |
| 20.919   | Uber Technologies Inc                         | 1.261.834          | 1,03                 |
| 2.235  | Westinghouse Air Brake Technologies Corp      | 423.734            | 0,34                 |
| 7.526  | Zebra Technologies Corp Class A               | 2.906.692          | 2,37                 |
|  | <b>US-Dollar insgesamt</b>                    | <b>71.964.364</b>  | <b>58,61</b>         |
|  | <b>Aktien insgesamt *</b>                     | <b>121.437.560</b> | <b>98,90</b>         |
|  | <b>Anlagen insgesamt</b>                      | <b>121.437.560</b> | <b>98,90</b>         |

## Devisenterminkontrakte 0,00 % (31. Dezember 2023: 0,01 %)

| Geforderter Betrag              | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei   | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|---|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> |                     |                  |   |           |                                |                      |
| 2.102 US\$                      | 1.893 €             | 16.01.2025       | Citibank NA   | 1         | 140                            | 0,00                 |
| 9.417 US\$                      | 8.723 €             | 16.01.2025       | Goldman Sachs International   | 4         | 380                            | 0,00                 |
| 26.581 US\$                     | 24.913 €            | 16.01.2025       | UBS AG  | 7         | 771                            | 0,00                 |
| 9.410 US\$                      | 8.809 €             | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp  | 4         | 283                            | 0,00                 |
|                                 |                     |                  | <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten **</b> |           | <b>1.574</b>                   | <b>0,00</b>          |

## Next Generation Mobility - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

|  | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|--------------------|------------------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> | <b>121.439.134</b> | <b>98,90</b>                 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,01 %) (31. Dezember 2023: (0,01 %))

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 1.718 €  | 1.895 US\$          | 16.01.2025       | Citibank NA                 | 1         | (115)                           | (0,00)               |
| 13.182 €   | 14.132 US\$         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 6         | (476)                           | (0,00)               |
| 5.195 €  | 5.635 US\$          | 16.01.2025       | UBS AG                      | 4         | (253)                           | (0,00)               |
| 177.625 €  | 195.442 US\$        | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 13        | (11.415)                        | (0,01)               |
| 2.814 US\$   | 2.717 €             | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | (2)                             | (0,00)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>(12.261)</b>                 | <b>(0,01)</b>        |

|   | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|---|--------------------|------------------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(12.261)</b>    | <b>(0,01)</b>                |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>121.426.873</b> | <b>98,89</b>                 |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>1.366.627</b>   | <b>1,11</b>                  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>122.793.500</b> | <b>100,00</b>                |

| Portfolioanalyse  | US\$               | % des<br>Gesamtver-<br>mögens |
|---|--------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 121.437.560        | 98,19                         |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente   | (10.687)           | (0,01)                        |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>121.426.873</b> | <b>98,18</b>                  |

## Next Generation Space Economy - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der<br>Anteile                              | Wertpapierbezeichnung                   | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|---|------------------|------------------------------|
| <b>Aktien 93,78 % (31. Dezember 2023: 94,58 %)</b> |   |                  |                              |
| <b>Kanadischer Dollar</b>                          |   |                  |                              |
| 95.052   | MDA Space Ltd**                         | 1.951.666        | 3,32                         |
| <b>Kanadischer Dollar insgesamt</b>                |   | <b>1.951.666</b> | <b>3,32</b>                  |
| <b>Euro</b>  |   |                  |                              |
| 10.920   | Airbus SE*                              | 1.750.200        | 2,97                         |
| 26.661   | Avio SpA*                               | 383.744          | 0,65                         |
| 26.747   | AXA SA*                                 | 950.544          | 1,62                         |
| 258.011  | Eutelsat Communications SACA*           | 605.942          | 1,03                         |
| 6.652  | Safran SA*                              | 1.460.976        | 2,48                         |
| 7.540  | Thales SA*                              | 1.082.533        | 1,84                         |
| <b>Euro insgesamt</b>                              |   | <b>6.233.939</b> | <b>10,59</b>                 |
| <b>Japanischer Yen</b>                             |   |                  |                              |
| 154.000  | Astroscale Holdings Inc*                | 764.362          | 1,30                         |
| 60.000   | Mitsubishi Electric Corp*               | 1.014.338        | 1,72                         |
| 104.200  | Mitsubishi Heavy Industries Ltd*        | 1.454.670        | 2,47                         |
| 11.500   | NEC Corp*                               | 985.295          | 1,67                         |
| 241.900  | SKY Perfect JSAT Holdings Inc*          | 1.381.798        | 2,35                         |
| <b>Japanischer Yen insgesamt</b>                   |   | <b>5.600.463</b> | <b>9,51</b>                  |
| <b>Britisches Pfund</b>                            |   |                  |                              |
| 111.058  | BAE Systems Plc*                        | 1.597.438        | 2,71                         |
| <b>Britisches Pfund insgesamt</b>                  |   | <b>1.597.438</b> | <b>2,71</b>                  |
| <b>Singapur-Dollar</b>                             |   |                  |                              |
| 476.600  | Singapore Technologies Engineering Ltd* | 1.628.028        | 2,77                         |
| <b>Singapur-Dollar insgesamt</b>                   |   | <b>1.628.028</b> | <b>2,77</b>                  |
| <b>Südkoreanischer Won</b>                         |   |                  |                              |
| 51.193   | Intellian Technologies Inc*             | 1.291.104        | 2,19                         |
| <b>Südkoreanischer Won insgesamt</b>               |   | <b>1.291.104</b> | <b>2,19</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>                                   |   |                  |                              |
| 6.726  | Advanced Micro Devices Inc*             | 812.434          | 1,38                         |
| 7.081  | AeroVironment Inc*                      | 1.089.695        | 1,85                         |
| 6.871  | Amazon.com Inc*                         | 1.507.429        | 2,56                         |
| 26.701   | Amphenol Corp Class A*                  | 1.854.384        | 3,15                         |
| 5.519  | Analog Devices Inc*                     | 1.172.567        | 1,99                         |
| 1.411  | ASML Holding NV*                        | 977.936          | 1,66                         |

## Next Generation Space Economy - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile  | Wertpapierbezeichnung                    | Zeitwert US\$     | % des Nettovermögens         |
|---|--|-------------------|------------------------------|
| <b>Aktien 93,78 % (31. Dezember 2023: 94,58 %) (Fortsetzung)</b>  |  |                   |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>  |  |                   |                              |
| 78.186  | AST SpaceMobile Inc Class A*             | 1.649.725         | 2,80                         |
| 8.092   | Boeing Co*                               | 1.432.284         | 2,43                         |
| 2.527   | CACI International Inc Class A*          | 1.021.060         | 1,74                         |
| 1.081   | Cadence Design Systems Inc*              | 324.797           | 0,55                         |
| 2.103   | Deere & Co*                              | 891.041           | 1,51                         |
| 38.658  | Intuitive Machines Inc Class A*          | 702.029           | 1,19                         |
| 10.188  | Keysight Technologies Inc*               | 1.636.498         | 2,78                         |
| 28.186  | Kratos Defense & Security Solutions Inc* | 743.547           | 1,26                         |
| 3.044   | Linde Plc*                               | 1.274.431         | 2,17                         |
| 3.207   | Microsoft Corp*                          | 1.351.750         | 2,30                         |
| 3.737   | Motorola Solutions Inc*                  | 1.727.353         | 2,93                         |
| 2.105   | Northrop Grumman Corp*                   | 987.855           | 1,68                         |
| 34.181  | NV5 Global Inc*                          | 643.970           | 1,09                         |
| 10.069  | NVIDIA Corp*                             | 1.352.166         | 2,30                         |
| 5.776   | Palo Alto Networks Inc*                  | 1.051.001         | 1,79                         |
| 230.706   | Planet Labs PBC*                         | 932.052           | 1,58                         |
| 10.493  | QUALCOMM Inc*                            | 1.611.935         | 2,74                         |
| 45.299  | Redwire Corp*                            | 745.622           | 1,27                         |
| 154.265   | Rocket Lab USA Inc*                      | 3.929.130         | 6,68                         |
| 3.438   | Teledyne Technologies Inc*               | 1.595.679         | 2,71                         |
| 1.025   | TransDigm Group Inc*                     | 1.298.962         | 2,21                         |
| 14.930  | Trimble Inc*                             | 1.054.954         | 1,79                         |
| 16.634  | Uber Technologies Inc*                   | 1.003.363         | 1,71                         |
| 2.907   | Zscaler Inc*                             | 524.452           | 0,89                         |
|   | <b>US-Dollar insgesamt</b>               | <b>36.900.101</b> | <b>62,69</b>                 |
|   | <b>Aktien insgesamt</b>                  | <b>55.202.739</b> | <b>93,78</b>                 |
|   | <b>Anlagen insgesamt</b>                 | <b>55.202.739</b> | <b>93,78</b>                 |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>  |  | <b>55.202.739</b> | <b>93,78</b>                 |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>            |  | <b>55.202.739</b> | <b>93,78</b>                 |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  |  | <b>3.661.480</b>  | <b>6,22</b>                  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                 |  | <b>58.864.219</b> | <b>100,00</b>                |
| <b>Portfolioanalyse</b>   |  | <b>US\$</b>       | <b>% des Gesamtvermögens</b> |
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind |  | 53.251.073        | 89,91                        |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden            |  | 1.951.666         | 3,30                         |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  |  | <b>55.202.739</b> | <b>93,21</b>                 |

## Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung  | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 64,38 % (31. Dezember 2023: 60,85 %)</b> |  |         |                       |                   |                              |
| <b>Euro</b>  |  |         |                       |                   |                              |
| 17.713.264   | NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance Plc*                                       | 7,13 %  | 19.07.2026            | 14.328.277        | 0,38                         |
| <b>Euro insgesamt</b>  |  |         |                       | <b>14.328.277</b> | <b>0,38</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>   |  |         |                       |                   |                              |
| 4.742.000  | 3R Lux Sarl**  | 9,75 %  | 05.02.2031            | 4.906.770         | 0,13                         |
| 21.380.000   | ABQ Finance Ltd*   | 1,88 %  | 08.09.2025            | 20.897.694        | 0,55                         |
| 12.477.000   | ABQ Finance Ltd*   | 2,00 %  | 06.07.2026            | 11.887.384        | 0,31                         |
| 12.926.000   | Abu Dhabi Commercial Bank PJSC*  | 3,50 %  | 31.03.2027            | 12.511.463        | 0,33                         |
| 5.370.000  | Abu Dhabi Commercial Bank PJSC*  | 4,50 %  | 14.09.2027            | 5.313.991         | 0,14                         |
| 10.000.000   | Abu Dhabi Commercial Bank PJSC*  | 5,38 %  | 18.07.2028            | 10.123.610        | 0,27                         |
| 5.799.000  | Abu Dhabi Commercial Bank PJSC*  | 5,50 %  | 12.01.2029            | 5.924.224         | 0,16                         |
| 31.484.000   | Abu Dhabi Developmental Holding Co PJSC*   | 5,38 %  | 08.05.2029            | 31.877.377        | 0,84                         |
| 6.713.000  | Abu Dhabi National Energy Co PJSC*   | 4,38 %  | 24.01.2029            | 6.573.400         | 0,17                         |
| 4.324.000  | Access Bank Plc*   | 6,13 %  | 21.09.2026            | 4.143.441         | 0,11                         |
| 14.649.000   | Adnoc Murban Rsc Ltd*  | 4,25 %  | 11.09.2029            | 14.159.112        | 0,38                         |
| 4.000.000  | Aegea Finance Sarl**   | 9,00 %  | 20.01.2031            | 4.084.864         | 0,11                         |
| 3.509.000  | African Export-Import Bank*  | 2,63 %  | 17.05.2026            | 3.350.691         | 0,09                         |
| 3.589.000  | AIA Group Ltd*   | 5,63 %  | 25.10.2027            | 3.678.444         | 0,10                         |
| 15.000.000   | Akbank TAS**   | 7,50 %  | 20.01.2030            | 15.190.313        | 0,40                         |
| 10.941.000   | Alsea SAB de CV**  | 7,75 %  | 14.12.2026            | 11.137.861        | 0,30                         |
| 8.000.000  | Ambipar Lux Sarl**   | 9,88 %  | 06.02.2031            | 7.992.338         | 0,21                         |
| 21.520.000   | Arab Petroleum Investments Corp**  | 5,43 %  | 02.05.2029            | 21.716.456        | 0,58                         |
| 6.540.000  | AUB Sukuk Ltd*   | 2,62 %  | 09.09.2026            | 6.233.982         | 0,17                         |
| 2.182.199  | Azul Secured Finance LLP**   | 11,93 % | 28.08.2028            | 2.205.714         | 0,06                         |
| 7.828.000  | Banco Bradesco SA*   | 3,20 %  | 27.01.2025            | 7.781.975         | 0,21                         |
| 10.992.000   | Banco Bradesco SA**  | 4,38 %  | 18.03.2027            | 10.697.121        | 0,28                         |
| 13.882.000   | Banco BTG Pactual SA*  | 2,75 %  | 11.01.2026            | 13.391.707        | 0,35                         |
| 3.781.000  | Banco BTG Pactual SA*  | 4,50 %  | 10.01.2025            | 3.771.337         | 0,10                         |
| 14.652.000   | Banco BTG Pactual SA**   | 5,75 %  | 22.01.2030            | 14.165.554        | 0,38                         |
| 8.795.000  | Banco BTG Pactual SA**   | 6,25 %  | 08.04.2029            | 8.814.075         | 0,23                         |
| 5.800.000  | Banco BTG Pactual SA Series JUL*   | 4,50 %  | 10.01.2025            | 5.785.177         | 0,15                         |
| 11.000.000   | Banco de Bogota SA*  | 6,25 %  | 12.05.2026            | 11.005.751        | 0,29                         |
| 7.400.000  | Banco de Credito del Peru SA**   | 2,70 %  | 11.01.2025            | 7.397.309         | 0,20                         |
| 10.245.000   | Banco do Brasil SA*  | 3,25 %  | 30.09.2026            | 9.965.984         | 0,27                         |
| 9.000.000  | Banco Nacional de Comercio Exterior SNC*   | 2,72 %  | 11.08.2031            | 8.297.799         | 0,22                         |
| 4.297.000  | Banco Santander Chile**  | 2,70 %  | 10.01.2025            | 4.292.791         | 0,11                         |
| 17.442.000   | Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand** | 5,38 %  | 17.04.2025            | 17.438.789        | 0,46                         |
| 4.558.000  | Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand*  | 5,62 %  | 10.12.2029            | 4.546.605         | 0,12                         |
| 3.931.000  | Bangkok Bank PCL*  | 4,30 %  | 15.06.2027            | 3.880.284         | 0,10                         |

## Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 64,38 % (31. Dezember 2023: 60,85 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 2.241.000  | Bank Mandiri Persero Tbk PT**   | 4,75 %  | 13.05.2025            | 2.237.279        | 0,06                         |
| 9.789.000  | Bank Muscat SAOG*   | 4,75 %  | 17.03.2026            | 9.667.930        | 0,25                         |
| 3.832.000  | Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT**                                  | 3,75 %  | 30.03.2026            | 3.742.734        | 0,10                         |
| 2.800.000  | Banque Ouest Africaine de Developpement*                                | 5,00 %  | 27.07.2027            | 2.726.395        | 0,07                         |
| 15.000.000   | BBK BSC*  | 6,88 %  | 06.06.2029            | 15.304.635       | 0,41                         |
| 7.457.000  | BBVA Bancomer SA**  | 5,25 %  | 10.09.2029            | 7.325.533        | 0,19                         |
| 5.338.000  | Beijing Gas Singapore Capital Corp*                                     | 1,88 %  | 18.01.2025            | 5.330.941        | 0,14                         |
| 2.318.000  | Bidvest Group UK Plc*   | 3,63 %  | 23.09.2026            | 2.228.027        | 0,06                         |
| 19.438.387   | Bioceanico Sovereign Certificate Ltd*                                   | 0,00 %  | 05.06.2034            | 15.025.873       | 0,40                         |
| 8.457.000  | BOC Aviation Ltd**  | 1,75 %  | 21.01.2026            | 8.192.628        | 0,22                         |
| 200.000  | BOC Aviation Ltd**  | 3,50 %  | 18.09.2027            | 193.483          | 0,01                         |
| 3.500.000  | BOC Aviation USA Corp**   | 5,75 %  | 09.11.2028            | 3.614.096        | 0,10                         |
| 5.432.000  | BOCOM International Blossom Ltd*  | 1,75 %  | 28.06.2026            | 5.186.223        | 0,14                         |
| 2.775.000  | Borr IHC Ltd/Borr Finance LLC**   | 10,00 % | 15.11.2028            | 2.772.853        | 0,07                         |
| 1.399.000  | Boubyan Sukuk Ltd**   | 2,59 %  | 18.02.2025            | 1.392.264        | 0,04                         |
| 8.625.000  | Boubyan Sukuk Ltd*  | 3,39 %  | 29.03.2027            | 8.324.561        | 0,22                         |
| 1.000.000  | Braskem Idesa SAPI*   | 7,45 %  | 15.11.2029            | 796.737          | 0,02                         |
| 37.644.800   | Brazil Minas SPE via State of Minas Gerais**                            | 5,33 %  | 15.02.2028            | 37.459.964       | 0,99                         |
| 23.721.000   | BSF Finance*  | 5,50 %  | 23.11.2027            | 24.037.948       | 0,64                         |
| 25.742.000   | CBQ Finance Ltd*  | 2,00 %  | 15.09.2025            | 25.103.573       | 0,66                         |
| 24.369.000   | CBQ Finance Ltd*  | 2,00 %  | 12.05.2026            | 23.299.578       | 0,62                         |
| 5.000.000  | CBQ Finance Ltd**   | 5,38 %  | 28.03.2029            | 5.061.600        | 0,13                         |
| 3.800.000  | CCBL Cayman 1 Corp Ltd*   | 1,60 %  | 15.09.2026            | 3.595.019        | 0,10                         |
| 5.549.000  | CCBL Cayman 1 Corp Ltd*   | 1,99 %  | 21.07.2025            | 5.457.754        | 0,14                         |
| 8.000.000  | CDBL Funding 2*   | 2,00 %  | 04.03.2026            | 7.743.095        | 0,21                         |
| 7.200.000  | Cencosud SA*  | 4,38 %  | 17.07.2027            | 7.040.223        | 0,19                         |
| 2.439.000  | Centrais Eletricas Brasileiras SA**                                     | 3,63 %  | 04.02.2025            | 2.429.930        | 0,06                         |
| 7.800.000  | Central American Bank for Economic Integration*                         | 1,14 %  | 09.02.2026            | 7.485.618        | 0,20                         |
| 12.476.000   | Central American Bank for Economic Integration*                         | 5,00 %  | 09.02.2026            | 12.486.538       | 0,33                         |
| 10.000.000   | Central American Bottling Corp/CBC Bottling Holdco SL/Beliv Holdco SL** | 5,25 %  | 27.04.2029            | 9.489.474        | 0,25                         |
| 10.000.000   | China Cinda 2020 I Management Ltd**                                     | 5,50 %  | 23.01.2030            | 10.003.025       | 0,27                         |
| 4.399.000  | China Cinda Finance 2015 I Ltd*   | 4,25 %  | 23.04.2025            | 4.386.096        | 0,12                         |
| 6.036.000  | China Construction Bank Corp*   | 1,25 %  | 04.08.2025            | 5.911.954        | 0,16                         |
| 19.471.000   | China Huadian Overseas Development 2018 Ltd*                            | 3,38 %  | 31.12.2149            | 19.078.680       | 0,51                         |
| 4.090.000  | China Overseas Grand Oceans Finance IV Cayman Ltd*                      | 2,45 %  | 09.02.2026            | 3.909.861        | 0,10                         |
| 6.237.000  | CICC Hong Kong Finance 2016 MTN Ltd*                                    | 2,00 %  | 26.01.2026            | 6.052.908        | 0,16                         |
| 4.600.000  | CITIC Ltd**   | 2,88 %  | 17.02.2027            | 4.423.269        | 0,12                         |
| 4.303.000  | CITIC Securities Finance MTN Co Ltd*                                    | 2,00 %  | 03.06.2025            | 4.246.451        | 0,11                         |
| 9.695.000  | CK Hutchison International 23 Ltd**                                     | 4,75 %  | 21.04.2028            | 9.643.430        | 0,26                         |

## Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 64,38 % (31. Dezember 2023: 60,85 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 6.594.000  | CK Hutchison International 24 Ltd*                   | 5,38 %  | 26.04.2029            | 6.704.732        | 0,18                         |
| 10.236.000   | CMB International Leasing Management Ltd*            | 1,88 %  | 12.08.2025            | 10.038.585       | 0,27                         |
| 2.500.000  | CMB International Leasing Management Ltd*            | 2,00 %  | 04.02.2026            | 2.421.991        | 0,06                         |
| 12.815.000   | CMHI Finance BVI Co Ltd**                            | 4,00 %  | 01.06.2027            | 12.615.727       | 0,33                         |
| 43.930.000   | Comision Federal de Electricidad*                    | 4,69 %  | 15.05.2029            | 41.285.704       | 1,09                         |
| 10.872.000   | Comision Federal de Electricidad**                   | 5,70 %  | 24.01.2030            | 10.445.274       | 0,28                         |
| 18.175.000   | Commercial Bank of Dubai PSC*                        | 4,86 %  | 10.10.2029            | 17.960.530       | 0,48                         |
| 14.467.000   | Commercial Bank of Dubai PSC*                        | 5,32 %  | 14.06.2028            | 14.570.667       | 0,39                         |
| 6.871.000  | Compania de Minas Buenaventura SAA**                 | 5,50 %  | 23.07.2026            | 6.870.482        | 0,18                         |
| 6.699.000  | Consolidated Energy Finance SA**                     | 12,00 % | 15.02.2031            | 6.437.977        | 0,17                         |
| 27.333.000   | Corp Andina de Fomento*                              | 2,25 %  | 08.02.2027            | 26.012.069       | 0,69                         |
| 3.657.000  | Corp Andina de Fomento*                              | 5,00 %  | 24.01.2029            | 3.672.827        | 0,10                         |
| 15.367.000   | Corp Andina de Fomento*                              | 6,00 %  | 26.04.2027            | 15.777.786       | 0,42                         |
| 3.700.000  | Cosan Luxembourg SA**                                | 7,25 %  | 27.06.2031            | 3.637.022        | 0,10                         |
| 3.528.000  | Credicorp Ltd**                                      | 2,75 %  | 17.06.2025            | 3.486.431        | 0,09                         |
| 3.800.000  | CSCIF Asia Ltd*                                      | 1,75 %  | 04.08.2025            | 3.725.444        | 0,10                         |
| 15.200.000   | CSN Inova Ventures**                                 | 6,75 %  | 28.01.2028            | 14.231.941       | 0,38                         |
| 2.000.000  | DBS Group Holdings Ltd**                             | 5,48 %  | 12.09.2025            | 2.007.930        | 0,05                         |
| 14.584.000   | DIB Sukuk Ltd*                                       | 1,96 %  | 22.06.2026            | 13.903.829       | 0,37                         |
| 6.741.000  | DIB Sukuk Ltd*                                       | 2,74 %  | 16.02.2027            | 6.407.679        | 0,17                         |
| 22.946.000   | DIB Sukuk Ltd*                                       | 2,95 %  | 16.01.2026            | 22.425.573       | 0,59                         |
| 12.489.000   | DIB Sukuk Ltd*                                       | 4,80 %  | 16.08.2028            | 12.379.546       | 0,33                         |
| 13.584.000   | DIB Sukuk Ltd*                                       | 5,49 %  | 30.11.2027            | 13.750.105       | 0,36                         |
| 10.800.000   | Eastern & Southern African Trade & Development Bank* | 4,13 %  | 30.06.2028            | 9.706.472        | 0,26                         |
| 5.000.000  | Ecopetrol SA**                                       | 6,88 %  | 29.04.2030            | 4.883.636        | 0,13                         |
| 20.000.000   | Ecopetrol SA**                                       | 8,63 %  | 19.01.2029            | 21.230.273       | 0,56                         |
| 18.300.000   | EI Sukuk Co Ltd**                                    | 1,83 %  | 23.09.2025            | 17.816.487       | 0,47                         |
| 5.800.000  | EI Sukuk Co Ltd*                                     | 2,08 %  | 02.11.2026            | 5.500.328        | 0,15                         |
| 34.460.000   | EI Sukuk Co Ltd*                                     | 5,43 %  | 28.05.2029            | 35.191.689       | 0,93                         |
| 27.420.000   | Emirates Development Bank PJSC*                      | 1,64 %  | 15.06.2026            | 26.082.829       | 0,69                         |
| 9.165.000  | Emirates NBD Bank PJSC**                             | 1,64 %  | 13.01.2026            | 8.842.209        | 0,23                         |
| 9.376.000  | Emirates NBD Bank PJSC**                             | 2,63 %  | 18.02.2025            | 9.340.442        | 0,25                         |
| 6.234.000  | Emirates NBD Bank PJSC**                             | 5,14 %  | 26.11.2029            | 6.300.641        | 0,17                         |
| 7.328.000  | Emirates NBD Bank PJSC*                              | 5,63 %  | 21.10.2027            | 7.465.862        | 0,20                         |
| 9.603.000  | Emirates NBD Bank PJSC*                              | 5,88 %  | 11.10.2028            | 9.906.059        | 0,26                         |
| 4.145.000  | Endeavour Mining Plc**                               | 5,00 %  | 14.10.2026            | 4.035.676        | 0,11                         |
| 4.500.000  | Energiean Israel Finance Ltd**                       | 4,88 %  | 30.03.2026            | 4.414.106        | 0,12                         |
| 10.800.000   | ENN Clean Energy International Investment Ltd**      | 3,38 %  | 12.05.2026            | 10.525.702       | 0,28                         |
| 11.568.000   | Fab Sukuk Co Ltd*                                    | 1,41 %  | 14.01.2026            | 11.136.369       | 0,30                         |
| 15.000.000   | First Abu Dhabi Bank PJSC*                           | 4,38 %  | 24.04.2028            | 14.734.346       | 0,39                         |

## Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 64,38 % (31. Dezember 2023: 60,85 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 16.856.000   | First Abu Dhabi Bank PJSC*  | 5,00 % | 28.02.2029            | 16.923.171       | 0,45                         |
| 26.439.000   | First Abu Dhabi Bank PJSC*  | 5,13 % | 13.10.2027            | 26.660.945       | 0,71                         |
| 6.633.000  | Franshion Brilliant Ltd*  | 3,20 % | 09.04.2026            | 6.326.363        | 0,17                         |
| 11.642.000   | FS Luxembourg Sarl*   | 8,88 % | 12.02.2031            | 11.821.281       | 0,31                         |
| 5.500.000  | FWD Group Holdings Ltd**  | 8,40 % | 05.04.2029            | 5.804.622        | 0,15                         |
| 13.000.000   | Geopark Ltd**   | 5,50 % | 17.01.2027            | 12.482.241       | 0,33                         |
| 5.000.000  | GLP Pte Ltd**   | 3,88 % | 04.06.2025            | 4.826.295        | 0,13                         |
| 7.321.100  | Greenko Dutch BV**  | 3,85 % | 29.03.2026            | 7.121.696        | 0,19                         |
| 6.790.000  | Greenko Wind Projects Mauritius Ltd**   | 5,50 % | 06.04.2025            | 6.788.489        | 0,18                         |
| 9.600.000  | Grupo Aval Ltd*   | 4,38 % | 04.02.2030            | 8.463.225        | 0,22                         |
| 16.370.000   | Grupo de Inversiones Suramericana SA*   | 5,50 % | 29.04.2026            | 16.178.648       | 0,43                         |
| 25.576.000   | Gulf International Bank BSC*  | 2,38 % | 23.09.2025            | 25.010.131       | 0,66                         |
| 26.600.000   | Gulf International Bank BSC*  | 5,75 % | 05.06.2029            | 27.048.975       | 0,72                         |
| 4.200.000  | Haitong International Securities Group Ltd*                                       | 3,13 % | 18.05.2025            | 4.163.134        | 0,11                         |
| 1.551.000  | Hengjian International Investment Ltd**   | 1,88 % | 23.06.2025            | 1.527.108        | 0,04                         |
| 13.693.000   | Hikma Finance USA LLC*  | 3,25 % | 09.07.2025            | 13.505.748       | 0,36                         |
| 4.995.000  | Horse Gallop Finance Ltd*   | 1,70 % | 28.07.2025            | 4.897.978        | 0,13                         |
| 8.250.000  | HPHT Finance 21 II Ltd**  | 1,50 % | 17.09.2026            | 7.785.332        | 0,21                         |
| 1.000.000  | Hyundai Capital America**   | 1,65 % | 17.09.2026            | 946.905          | 0,03                         |
| 4.100.000  | Hyundai Capital America**   | 2,65 % | 10.02.2025            | 4.089.860        | 0,11                         |
| 6.097.000  | Hyundai Capital America**   | 5,50 % | 30.03.2026            | 6.138.048        | 0,16                         |
| 9.805.000  | Hyundai Capital America**   | 5,68 % | 26.06.2028            | 9.952.538        | 0,26                         |
| 5.000.000  | Hyundai Capital America**   | 5,95 % | 21.09.2026            | 5.094.949        | 0,14                         |
| 4.250.000  | Hyundai Capital Services Inc**  | 5,13 % | 05.02.2027            | 4.262.288        | 0,11                         |
| 4.700.000  | Hyundai Card Co Ltd*  | 5,75 % | 24.04.2029            | 4.774.776        | 0,13                         |
| 18.600.000   | ICA ICTAS Altyapi Yavuz Sultan Selim Koprusu Ve Kuzey Cevre Otoyolu Yatirim Ve I* | 7,54 % | 31.10.2027            | 18.715.200       | 0,50                         |
| 9.770.000  | IHS Holding Ltd**   | 7,88 % | 29.05.2030            | 9.647.592        | 0,26                         |
| 6.467.000  | Israel Discount Bank Ltd**  | 5,38 % | 26.01.2028            | 6.459.013        | 0,17                         |
| 4.411.000  | JBS USA Holding Lux Sarl/JBS USA Food Co/JBS Lux Co Sarl**                        | 2,50 % | 15.01.2027            | 4.192.517        | 0,11                         |
| 8.439.000  | Kallpa Generacion SA*   | 4,13 % | 16.08.2027            | 8.202.200        | 0,22                         |
| 4.081.000  | Kasikornbank PCL*   | 5,46 % | 07.03.2028            | 4.119.528        | 0,11                         |
| 8.395.000  | KEB Hana Bank*  | 3,25 % | 30.03.2027            | 8.141.128        | 0,22                         |
| 5.079.000  | Kookmin Bank*   | 1,38 % | 06.05.2026            | 4.854.769        | 0,13                         |
| 5.000.000  | Kosmos Energy Ltd**   | 8,75 % | 01.10.2031            | 4.715.452        | 0,13                         |
| 2.775.000  | KT Corp*  | 4,00 % | 08.08.2025            | 2.759.251        | 0,07                         |
| 3.500.000  | Lenovo Group Ltd*   | 5,83 % | 27.01.2028            | 3.550.721        | 0,09                         |
| 12.134.226   | Leviathan Bond Ltd*   | 6,13 % | 30.06.2025            | 12.073.676       | 0,32                         |
| 4.980.000  | LG Energy Solution Ltd**  | 5,38 % | 02.07.2027            | 4.998.501        | 0,13                         |
| 1.939.000  | LG Energy Solution Ltd**  | 5,75 % | 25.09.2028            | 1.964.238        | 0,05                         |
| 3.200.000  | Longfor Group Holdings Ltd*   | 4,50 % | 16.01.2028            | 2.613.951        | 0,07                         |

## Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung  | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 64,38 % (31. Dezember 2023: 60,85 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |        |                       |                  |                              |
| 15.000.000   | Masdar Abu Dhabi Future Energy Co <sup>*</sup>                               | 4,88 % | 25.07.2029            | 14.931.300       | 0,40                         |
| 14.708.000   | MDGH GMTN RSC Ltd <sup>*</sup>   | 3,00 % | 28.03.2027            | 14.136.962       | 0,37                         |
| 4.417.000  | Medco Bell Pte Ltd <sup>**</sup>   | 6,38 % | 30.01.2027            | 4.418.076        | 0,12                         |
| 10.200.000   | MEGlobal Canada ULC <sup>*</sup>   | 5,00 % | 18.05.2025            | 10.183.782       | 0,27                         |
| 3.265.000  | Meituan <sup>*</sup>   | 2,13 % | 28.10.2025            | 3.187.802        | 0,08                         |
| 1.812.000  | Meituan <sup>**</sup>  | 4,63 % | 02.10.2029            | 1.753.637        | 0,05                         |
| 6.638.000  | Melco Resorts Finance Ltd <sup>**</sup>                                      | 4,88 % | 06.06.2025            | 6.602.161        | 0,17                         |
| 9.678.000  | Melco Resorts Finance Ltd <sup>*</sup>                                       | 5,25 % | 26.04.2026            | 9.543.455        | 0,25                         |
| 2.322.000  | MercadoLibre Inc <sup>**</sup>   | 2,38 % | 14.01.2026            | 2.255.187        | 0,06                         |
| 6.913.000  | Mersin Uluslararası Liman İşletmeciliği AS <sup>*</sup>                      | 8,25 % | 15.11.2028            | 7.169.096        | 0,19                         |
| 2.000.000  | MGM China Holdings Ltd <sup>**</sup>   | 4,75 % | 01.02.2027            | 1.937.276        | 0,05                         |
| 9.900.000  | Millicom International Cellular SA <sup>*</sup>                              | 6,25 % | 25.03.2029            | 9.747.939        | 0,26                         |
| 12.151.000   | Movida Europe SA <sup>**</sup>   | 7,85 % | 11.04.2029            | 10.721.092       | 0,28                         |
| 4.881.000  | Muthoot Finance Ltd <sup>**</sup>  | 7,13 % | 14.02.2028            | 4.973.803        | 0,13                         |
| 15.056.000   | National Bank of Ras Al-Khaimah PSC <sup>*</sup>                             | 5,38 % | 25.07.2029            | 15.276.420       | 0,40                         |
| 6.018.000  | Navoi Mining & Metallurgical Combinat <sup>*</sup>                           | 6,70 % | 17.10.2028            | 6.004.426        | 0,16                         |
| 12.721.000   | NBK SPC Ltd <sup>*</sup>   | 1,63 % | 15.09.2027            | 11.962.052       | 0,32                         |
| 7.371.000  | NBK SPC Ltd <sup>**</sup>  | 5,50 % | 06.06.2030            | 7.444.093        | 0,20                         |
| 7.530.000  | NewCo Holding USD 20 Sarl <sup>**</sup>                                      | 9,38 % | 07.11.2029            | 7.507.410        | 0,20                         |
| 8.038.000  | Periana Holdings LLC <sup>**</sup>   | 5,95 % | 19.04.2026            | 8.033.358        | 0,21                         |
| 8.100.000  | Petrobras Global Finance BV <sup>*</sup>                                     | 6,00 % | 27.01.2028            | 8.096.922        | 0,21                         |
| 42.992.000   | Petroleos Mexicanos <sup>**</sup>  | 6,50 % | 13.03.2027            | 41.598.555       | 1,10                         |
| 66.714.000   | Petroleos Mexicanos <sup>**</sup>  | 6,70 % | 16.02.2032            | 58.088.834       | 1,54                         |
| 7.364.000  | POSCO <sup>*</sup>   | 4,38 % | 04.08.2025            | 7.334.273        | 0,19                         |
| 3.931.000  | POSCO <sup>**</sup>  | 5,75 % | 17.01.2028            | 4.001.987        | 0,11                         |
| 7.000.000  | Prosus NV <sup>*</sup>   | 3,26 % | 19.01.2027            | 6.695.978        | 0,18                         |
| 6.747.780  | Qatarenergy LNG S3 <sup>**</sup>   | 5,84 % | 30.09.2027            | 6.812.215        | 0,18                         |
| 12.334.700   | Qatarenergy LNG S3 <sup>**</sup>   | 6,33 % | 30.09.2027            | 12.550.109       | 0,33                         |
| 8.561.000  | QIB Sukuk Ltd <sup>*</sup>   | 1,95 % | 27.10.2025            | 8.329.087        | 0,22                         |
| 6.853.000  | QIB Sukuk Ltd <sup>*</sup>   | 4,49 % | 17.09.2029            | 6.784.350        | 0,18                         |
| 8.352.000  | QNB Bank AS <sup>**</sup>  | 7,25 % | 21.05.2029            | 8.707.135        | 0,23                         |
| 36.347.000   | QNB Finance Ltd <sup>*</sup>   | 2,63 % | 12.05.2025            | 36.031.635       | 0,95                         |
| 8.000.000  | QNB Finance Ltd <sup>*</sup>   | 2,75 % | 12.02.2027            | 7.640.998        | 0,20                         |
| 10.500.000   | ReNew Wind Energy AP2/ReNew Power Pvt Ltd other 9 Subsidiaries <sup>**</sup> | 4,50 % | 14.07.2028            | 9.761.458        | 0,26                         |
| 6.773.000  | SA Global Sukuk Ltd <sup>*</sup>   | 4,25 % | 02.10.2029            | 6.574.957        | 0,17                         |
| 20.000.000   | SA Global Sukuk Ltd <sup>*</sup>   | 1,60 % | 17.06.2026            | 19.059.890       | 0,50                         |
| 11.247.500   | Samarco Mineracao SA <sup>**</sup>   | 9,00 % | 30.06.2031            | 11.007.586       | 0,29                         |
| 5.000.000  | Sands China Ltd <sup>**</sup>  | 3,80 % | 08.01.2026            | 4.906.789        | 0,13                         |
| 3.799.000  | Sands China Ltd <sup>*</sup>   | 5,13 % | 08.08.2025            | 3.785.662        | 0,10                         |
| 1.000.000  | Sands China Ltd <sup>**</sup>  | 5,40 % | 08.08.2028            | 989.476          | 0,03                         |

## Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                              | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 64,38 % (31. Dezember 2023: 60,85 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 10.000.000   | Sasol Financing USA LLC*                           | 6,50 %  | 27.09.2028            | 9.640.879        | 0,26                         |
| 2.319.000  | Saudi Arabian Oil Co*                              | 1,63 %  | 24.11.2025            | 2.255.121        | 0,06                         |
| 22.370.000   | Saudi Electricity Global Sukuk Co 5*               | 1,74 %  | 17.09.2025            | 21.838.629       | 0,58                         |
| 8.000.000  | SEPLAT Energy Plc*                                 | 7,75 %  | 01.04.2026            | 7.982.812        | 0,21                         |
| 5.000.000  | Severstal OAO Via Steel Capital SA*                | 5,90 %  | 17.10.2022            | 500.000          | 0,01                         |
| 4.507.000  | SF Holding Investment 2021 Ltd*                    | 2,38 %  | 17.11.2026            | 4.308.532        | 0,11                         |
| 5.100.000  | Shinhan Bank Co Ltd**                              | 3,88 %  | 24.03.2026            | 5.023.209        | 0,13                         |
| 6.581.000  | Shinhan Financial Group Co Ltd*                    | 1,35 %  | 10.01.2026            | 6.337.301        | 0,17                         |
| 7.500.000  | Shriram Finance Ltd**                              | 6,15 %  | 03.04.2028            | 7.412.849        | 0,20                         |
| 4.512.000  | Shriram Finance Ltd**                              | 6,63 %  | 22.04.2027            | 4.555.090        | 0,12                         |
| 8.500.000  | SierraCol Energy Andina LLC**                      | 6,00 %  | 15.06.2028            | 7.684.524        | 0,20                         |
| 5.000.000  | Sinopec Group Overseas Development 2015 Ltd*       | 3,25 %  | 28.04.2025            | 4.974.267        | 0,13                         |
| 16.866.000   | Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd**      | 1,45 %  | 08.01.2026            | 16.321.498       | 0,43                         |
| 18.800.000   | Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd*       | 2,15 %  | 13.05.2025            | 18.609.695       | 0,49                         |
| 13.000.000   | Sisecam UK Plc*                                    | 8,25 %  | 02.05.2029            | 13.067.795       | 0,35                         |
| 5.135.000  | Sitios Latinoamerica SAB de CV**                   | 6,00 %  | 25.11.2029            | 5.117.798        | 0,14                         |
| 2.800.000  | SK Battery America Inc*                            | 4,88 %  | 23.01.2027            | 2.797.389        | 0,07                         |
| 6.078.000  | SK Hynix Inc*                                      | 6,25 %  | 17.01.2026            | 6.155.768        | 0,16                         |
| 5.594.000  | SK Hynix Inc*                                      | 6,38 %  | 17.01.2028            | 5.771.940        | 0,15                         |
| 1.500.000  | SK On Co Ltd**                                     | 5,38 %  | 11.05.2026            | 1.507.389        | 0,04                         |
| 17.918.000   | SNB Sukuk Ltd*                                     | 2,34 %  | 19.01.2027            | 16.993.933       | 0,45                         |
| 39.000.000   | Southern Gas Corridor CJSC*                        | 6,88 %  | 24.03.2026            | 39.549.802       | 1,05                         |
| 7.600.000  | Standard Chartered Plc*                            | 6,19 %  | 06.07.2027            | 7.729.038        | 0,20                         |
| 12.000.000   | State Oil Co of the Azerbaijan Republic*           | 6,95 %  | 18.03.2030            | 12.414.669       | 0,33                         |
| 5.725.000  | Stillwater Mining Co*                              | 4,00 %  | 16.11.2026            | 5.441.011        | 0,14                         |
| 2.788.000  | Studio City Finance Ltd**                          | 6,00 %  | 15.07.2025            | 2.787.255        | 0,07                         |
| 2.500.000  | Studio City Finance Ltd*                           | 6,50 %  | 15.01.2028            | 2.439.801        | 0,06                         |
| 21.156.000   | Suci Second Investment Co*                         | 4,38 %  | 10.09.2027            | 20.851.946       | 0,55                         |
| 4.000.000  | Suzano Austria GmbH*                               | 2,50 %  | 15.09.2028            | 3.558.767        | 0,09                         |
| 5.023.000  | Telecommunications co Telekom Srbija AD Belgrade** | 7,00 %  | 28.10.2029            | 5.017.927        | 0,13                         |
| 2.000.000  | Tencent Holdings Ltd**                             | 1,81 %  | 26.01.2026            | 1.939.325        | 0,05                         |
| 18.847.000   | Tengizchevroil Finance Co International Ltd**      | 2,63 %  | 15.08.2025            | 18.464.750       | 0,49                         |
| 7.087.000  | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV*    | 4,75 %  | 09.05.2027            | 6.924.505        | 0,18                         |
| 3.835.000  | Transnet SOC Ltd*                                  | 8,25 %  | 06.02.2028            | 3.912.985        | 0,10                         |
| 10.000.000   | Trident Energy Finance Plc**                       | 12,50 % | 30.11.2029            | 10.509.075       | 0,28                         |
| 11.000.000   | Trust Fibra Uno**                                  | 4,87 %  | 15.01.2030            | 9.974.060        | 0,26                         |
| 6.235.000  | Trust Fibra Uno*                                   | 5,25 %  | 30.01.2026            | 6.221.130        | 0,16                         |
| 4.521.000  | TSMC Arizona Corp*                                 | 3,88 %  | 22.04.2027            | 4.441.799        | 0,12                         |
| 4.541.000  | Turk Telekomunikasyon AS**                         | 7,38 %  | 20.05.2029            | 4.630.440        | 0,12                         |
| 1.000.000  | Turkcell Iletisim Hizmetleri AS*                   | 5,80 %  | 11.04.2028            | 970.434          | 0,03                         |

## Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                             | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$     | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|----------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 64,38 % (31. Dezember 2023: 60,85 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                      |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                      |                              |
| 9.361.000  | Turkiye Is Bankasi AS**                           | 7,75 %  | 12.06.2029            | 9.659.663            | 0,26                         |
| 4.145.000  | Turkiye Sinai Kalkinma Bankasi AS*                | 6,00 %  | 23.01.2025            | 4.148.915            | 0,11                         |
| 11.723.000   | Turkiye Vakiflar Bankasi TAO*                     | 5,50 %  | 01.10.2026            | 11.635.078           | 0,31                         |
| 6.678.000  | Turkiye Vakiflar Bankasi TAO*                     | 6,50 %  | 08.01.2026            | 6.742.827            | 0,18                         |
| 9.908.000  | Turkiye Vakiflar Bankasi TAO*                     | 9,00 %  | 12.10.2028            | 10.577.969           | 0,28                         |
| 2.617.000  | Turkiye Varlik Fonu Yonetimi AS**                 | 8,25 %  | 14.02.2029            | 2.726.014            | 0,07                         |
| 7.629.000  | TVF Varlik Kiralama AS*                           | 6,95 %  | 23.01.2030            | 7.678.588            | 0,20                         |
| 17.350.000   | Vedanta Resources Finance II Plc**                | 10,88 % | 17.09.2029            | 17.968.337           | 0,48                         |
| 5.000.000  | VTR Finance NV**                                  | 6,38 %  | 15.07.2028            | 4.752.901            | 0,13                         |
| 2.000.000  | Wynn Macau Ltd*                                   | 5,50 %  | 15.01.2026            | 1.981.966            | 0,05                         |
| 2.500.000  | Wynn Macau Ltd*                                   | 5,50 %  | 01.10.2027            | 2.434.968            | 0,06                         |
| 12.904.000   | XP Inc**  | 6,75 %  | 02.07.2029            | 12.839.617           | 0,34                         |
| 10.201.000   | Yapi ve Kredi Bankasi AS**                        | 9,25 %  | 16.10.2028            | 11.014.377           | 0,29                         |
| 6.134.000  | Yapi ve Kredi Bankasi AS**                        | 9,74 %  | 31.12.2149            | 6.330.745            | 0,17                         |
| 37.125.000   | YPF SA**  | 9,50 %  | 17.01.2031            | 39.742.647           | 1,05                         |
| 6.494.000  | Yunda Holding Investment Ltd*                     | 2,25 %  | 19.08.2025            | 6.352.014            | 0,17                         |
| 11.868.000   | Zhejiang Seaport International Co Ltd*            | 1,98 %  | 17.03.2026            | 11.439.111           | 0,30                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |   |         |                       | <b>2.416.243.124</b> | <b>64,00</b>                 |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>  |   |         |                       | <b>2.430.571.401</b> | <b>64,38</b>                 |
| <b>Staatsanleihen 34,96 % (31. Dezember 2023: 33,07 %)</b>                     |   |         |                       |                      |                              |
| <b>Euro</b>  |   |         |                       |                      |                              |
| 33.397.000   | Egypt Government International Bond*              | 4,75 %  | 16.04.2026            | 34.065.490           | 0,90                         |
| 35.305.000   | Ivory Coast Government International Bond*        | 5,25 %  | 22.03.2030            | 34.665.932           | 0,92                         |
| 68.600.000   | Ivory Coast Government International Bond*        | 5,88 %  | 17.10.2031            | 66.798.670           | 1,77                         |
| 36.360.000   | Romanian Government International Bond*           | 6,63 %  | 27.09.2029            | 40.710.510           | 1,08                         |
| 22.420.000   | Senegal Government International Bond*            | 4,75 %  | 13.03.2028            | 21.411.542           | 0,56                         |
| <b>Euro insgesamt</b>  |   |         |                       | <b>197.652.144</b>   | <b>5,23</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>   |   |         |                       |                      |                              |
| 22.042.000   | Abu Dhabi Government International Bond*          | 4,88 %  | 30.04.2029            | 21.995.446           | 0,58                         |
| 7.396.000  | Airport Authority*                                | 2,10 %  | 31.12.2149            | 7.185.788            | 0,19                         |
| 2.000.000  | Angolan Government International Bond*            | 8,00 %  | 26.11.2029            | 1.793.704            | 0,05                         |
| 59.460.000   | Angolan Government International Bond*            | 8,25 %  | 09.05.2028            | 56.030.273           | 1,48                         |
| 52.198.378   | Argentine Republic Government International Bond* | 0,75 %  | 09.07.2030            | 40.359.786           | 1,07                         |
| 18.645.329   | Argentine Republic Government International Bond* | 1,00 %  | 09.07.2029            | 15.186.620           | 0,40                         |
| 8.300.000  | Argentine Republic Government International Bond* | 5,00 %  | 09.01.2038            | 5.823.186            | 0,15                         |
| 11.862.159   | Avenir Issuer III Ireland DAC*                    | 6,00 %  | 22.03.2027            | 11.466.446           | 0,30                         |
| 25.730.000   | Bahamas Government International Bond*            | 6,00 %  | 21.11.2028            | 24.636.475           | 0,65                         |
| 11.817.000   | Bank Gospodarstwa Krajowego*                      | 6,25 %  | 31.10.2028            | 12.297.420           | 0,33                         |

## Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 34,96 % (31. Dezember 2023: 33,07 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 5.000.000  | Colombia Government International Bond*              | 3,00 %  | 30.01.2030            | 4.153.750        | 0,11                         |
| 103.100.000  | Colombia Government International Bond*              | 4,50 %  | 15.03.2029            | 95.728.350       | 2,54                         |
| 7.900.000  | Development Bank of Mongolia LLC*                    | 11,00 % | 07.03.2026            | 8.225.875        | 0,22                         |
| 1.000.000  | Dominican Republic International Bond*               | 4,50 %  | 30.01.2030            | 918.250          | 0,02                         |
| 21.280.000   | Dominican Republic International Bond*               | 5,50 %  | 22.02.2029            | 20.657.560       | 0,55                         |
| 31.050.000   | Dominican Republic International Bond*               | 8,63 %  | 20.04.2027            | 31.942.687       | 0,85                         |
| 2.725.820  | Ecuador Government International Bond*               | 5,50 %  | 31.07.2035            | 1.554.953        | 0,04                         |
| 23.996.483   | Ecuador Government International Bond*               | 6,90 %  | 31.07.2030            | 16.770.826       | 0,44                         |
| 11.589.000   | Egypt Government International Bond*                 | 5,80 %  | 30.09.2027            | 10.874.828       | 0,29                         |
| 11.300.000   | Egypt Government International Bond*                 | 7,60 %  | 01.03.2029            | 10.973.359       | 0,29                         |
| 11.667.000   | El Salvador Government International Bond**          | 0,25 %  | 17.04.2030            | 237.092          | 0,01                         |
| 14.860.000   | El Salvador Government International Bond*           | 7,65 %  | 15.06.2035            | 14.403.055       | 0,38                         |
| 18.536.000   | El Salvador Government International Bond*           | 8,63 %  | 28.02.2029            | 19.254.270       | 0,51                         |
| 17.467.000   | El Salvador Government International Bond**          | 9,25 %  | 17.04.2030            | 18.536.854       | 0,49                         |
| 10.909.000   | Fondo MIVIVIENDA SA*                                 | 4,63 %  | 12.04.2027            | 10.746.735       | 0,28                         |
| 1.425.088  | Ghana Government International Bond*                 | 0,00 %  | 03.07.2026            | 1.327.859        | 0,04                         |
| 951.105  | Ghana Government International Bond*                 | 0,00 %  | 03.01.2030            | 739.137          | 0,02                         |
| 10.777.228   | Ghana Government International Bond*                 | 5,00 %  | 03.07.2029            | 9.334.467        | 0,25                         |
| 15.497.832   | Ghana Government International Bond*                 | 5,00 %  | 03.07.2035            | 10.935.929       | 0,29                         |
| 6.800.000  | Guatemala Government Bond*                           | 5,25 %  | 10.08.2029            | 6.550.100        | 0,17                         |
| 2.365.000  | Industrial Bank of Korea*                            | 5,38 %  | 04.10.2028            | 2.414.723        | 0,06                         |
| 5.911.256  | Ivory Coast Government International Bond*           | 5,75 %  | 31.12.2032            | 5.612.782        | 0,15                         |
| 6.100.000  | Ivory Coast Government International Bond*           | 6,38 %  | 03.03.2028            | 6.068.399        | 0,16                         |
| 9.372.000  | Korea Development Bank*                              | 4,38 %  | 15.02.2028            | 9.269.276        | 0,25                         |
| 4.465.000  | Korea Electric Power Corp**                          | 5,38 %  | 31.07.2026            | 4.504.262        | 0,12                         |
| 4.325.000  | Korea Expressway Corp*                               | 1,13 %  | 17.05.2026            | 4.113.618        | 0,11                         |
| 25.371.000   | Korea Housing Finance Corp*                          | 4,63 %  | 24.02.2028            | 25.166.748       | 0,67                         |
| 4.166.000  | Korea Hydro & Nuclear Power Co Ltd*                  | 5,00 %  | 18.07.2028            | 4.165.516        | 0,11                         |
| 10.847.000   | Korea Land & Housing Corp*                           | 5,75 %  | 06.10.2025            | 10.909.927       | 0,29                         |
| 31.802.000   | Korea Mine Rehabilitation & Mineral Resources Corp*  | 1,75 %  | 15.04.2026            | 30.543.132       | 0,81                         |
| 37.754.000   | Korea Mine Rehabilitation & Mineral Resources Corp*  | 5,38 %  | 11.05.2028            | 38.065.054       | 1,01                         |
| 15.286.000   | Korea National Oil Corp*                             | 1,75 %  | 18.04.2025            | 15.138.245       | 0,40                         |
| 6.942.000  | Korea National Oil Corp*                             | 4,88 %  | 03.04.2029            | 6.894.433        | 0,18                         |
| 7.831.000  | MFB Magyar Fejlesztési Bank Zrt*                     | 6,50 %  | 29.06.2028            | 7.980.619        | 0,21                         |
| 18.507.000   | Nigeria Government International Bond*               | 8,38 %  | 24.03.2029            | 18.016.102       | 0,48                         |
| 12.240.000   | Nigeria Government International Bond*               | 8,75 %  | 21.01.2031            | 11.802.408       | 0,31                         |
| 90.626.000   | Panama Government International Bond**               | 7,50 %  | 01.03.2031            | 92.039.255       | 2,44                         |
| 49.300.000   | Panama Government International Bond*                | 9,38 %  | 01.04.2029            | 54.483.170       | 1,44                         |
| 1.276.014  | Provincia de Cordoba*                                | 6,88 %  | 10.12.2025            | 1.260.778        | 0,03                         |
| 3.571.429  | Republic of Angola Via Avenir Issuer II Ireland DAC* | 6,93 %  | 19.02.2027            | 3.419.497        | 0,09                         |

## Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung  | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$     | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|--------|-----------------------|----------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 34,96 % (31. Dezember 2023: 33,07 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                      |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |        |                       |                      |                              |
| 2.000.000  | Republic of Azerbaijan International Bond*                       | 5,13 % | 01.09.2029            | 1.938.725            | 0,05                         |
| 10.000.000   | Republic of South Africa Government International Bond*          | 5,88 % | 22.06.2030            | 9.595.200            | 0,25                         |
| 26.900.000   | Romanian Government International Bond*                          | 5,88 % | 30.01.2029            | 26.227.466           | 0,70                         |
| 34.500.000   | Serbia International Bond*                                       | 2,13 % | 01.12.2030            | 28.078.420           | 0,74                         |
| 10.878.813   | Sri Lanka Government International Bond*                         | 3,10 % | 15.01.2030            | 9.029.415            | 0,24                         |
| 21.338.607   | Sri Lanka Government International Bond*                         | 3,35 % | 15.03.2033            | 16.245.082           | 0,43                         |
| 14.408.469   | Sri Lanka Government International Bond*                         | 3,60 % | 15.06.2035            | 10.446.140           | 0,28                         |
| 9.999.813  | Sri Lanka Government International Bond*                         | 3,60 % | 15.05.2036            | 7.624.857            | 0,20                         |
| 20.008.029   | Sri Lanka Government International Bond*                         | 3,60 % | 15.02.2038            | 15.332.153           | 0,41                         |
| 12.218.656   | Sri Lanka Government International Bond*                         | 4,00 % | 15.04.2028            | 11.470.874           | 0,30                         |
| 6.086.000  | Turkiye Ihracat Kredi Bankasi AS*                                | 9,00 % | 28.01.2027            | 6.404.677            | 0,17                         |
| 2.615.995  | Ukraine Government International Bond*                           | 0,00 % | 01.02.2030            | 1.436.181            | 0,04                         |
| 9.775.574  | Ukraine Government International Bond*                           | 0,00 % | 01.02.2034            | 4.069.266            | 0,11                         |
| 8.261.049  | Ukraine Government International Bond*                           | 0,00 % | 01.02.2035            | 4.898.647            | 0,13                         |
| 6.884.207  | Ukraine Government International Bond*                           | 0,00 % | 01.02.2036            | 4.061.114            | 0,11                         |
| 13.100.255   | Ukraine Government International Bond*                           | 1,75 % | 01.02.2029            | 9.139.603            | 0,24                         |
| 16.852.289   | Ukraine Government International Bond*                           | 1,75 % | 01.02.2034            | 9.542.609            | 0,25                         |
| 14.306.812   | Ukraine Government International Bond*                           | 1,75 % | 01.02.2035            | 7.900.665            | 0,21                         |
| 3.630.791  | Ukraine Government International Bond*                           | 1,75 % | 01.02.2036            | 1.976.639            | 0,05                         |
| 48.200.000   | United States Treasury Note/Bond*                                | 4,63 % | 30.04.2029            | 48.674.190           | 1,29                         |
| 34.000.000   | United States Treasury Note/Bond*                                | 4,88 % | 31.10.2028            | 34.619.430           | 0,92                         |
| 12.790.560   | Zambia Government International Bond*                            | 5,75 % | 30.06.2033            | 11.245.540           | 0,30                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |  |        |                       | <b>1.122.465.917</b> | <b>29,73</b>                 |
| <b>Staatsanleihen insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>1.320.118.061</b> | <b>34,96</b>                 |
| <b>Pensionsgeschäfte 0,24 % (31. Dezember 2023: 0,00 %)</b>              |  |        |                       |                      |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |  |        |                       |                      |                              |
| 9.000.000  | State Street Bank and Trust Co, repurchase value US\$ 9,002,215^ | 4,43 % | 02.01.2025            | 9.000.000            | 0,24                         |
| <b>Pensionsgeschäfte insgesamt †</b>                                     |  |        |                       | <b>9.000.000</b>     | <b>0,24</b>                  |
| <b>Anlagen insgesamt</b>   |  |        |                       | <b>3.759.689.462</b> | <b>99,58</b>                 |

^ Besichert über US-Schatz-/Staatsanleihen mit einem Wert von insgesamt USD 9.180.010.

### Devisenterminkontrakte 0,24 % (31. Dezember 2023: 1,63 %)

| Geforderter<br>Betrag           | Zu zahlender<br>Betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei          | Kontrakte | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|---------------------------------|------------------------|-----------------------|----------------------|-----------|--------------------------------------|------------------------------|
| 239.734.383 US\$                | 227.497.260 €          | 04.02.2025            | HSBC Bank Plc        | 1         | 3.851.486                            | 0,10                         |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> |                        |                       |                      |           |                                      |                              |
| 34 US\$                         | 52 AUD                 | 13.03.2025            | Citibank NA          | 1         | 1                                    | 0,00                         |
| 8.606 US\$                      | 13.729 AUD             | 13.03.2025            | Westpac Banking Corp | 2         | 105                                  | 0,00                         |

## Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 0,24 % (31. Dezember 2023: 1,63 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens        |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|-----------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen CAD</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 2.084 US\$   | 2.982 CAD           | 13.03.2025       | Royal Bank of Canada        | 1         | 5                              | 0,00                        |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 449.697 US\$   | 398.463 CHF         | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 5         | 6.645                          | 0,00                        |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 76.137 €   | 79.071 US\$         | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | 5                              | 0,00                        |
| 109.115.976 US\$   | 102.739.452 €       | 13.03.2025       | Royal Bank of Canada        | 1         | 2.410.273                      | 0,06                        |
| 119.162.307 US\$   | 112.316.876 €       | 13.03.2025       | UBS AG                      | 2         | 2.509.445                      | 0,07                        |
| 17.348.200 US\$  | 16.467.014 €        | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 8         | 245.479                        | 0,01                        |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 1.357.541 US\$   | 1.077.829 £         | 13.03.2025       | Goldman Sachs International | 1         | 8.372                          | 0,00                        |
| 569.466 US\$   | 448.689 £           | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 8         | 7.822                          | 0,00                        |
| <i>Abgesicherte Klassen SEK</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 5.583 US\$   | 61.196 SEK          | 13.03.2025       | Goldman Sachs International | 1         | 24                             | 0,00                        |
| 22.949 US\$  | 251.478 SEK         | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 4         | 104                            | 0,00                        |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 389.763 US\$   | 526.039 SGD         | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 8         | 3.088                          | 0,00                        |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>sm</sup></b>                       |                     |                  |                             |           | <b>9.042.854</b>               | <b>0,24</b>                 |
|  |                     |                  |                             |           | <b>Zeitwert US\$</b>           | <b>% des Nettovermögens</b> |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |                     |                  |                             |           | <b>3.768.732.316</b>           | <b>99,82</b>                |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (1,83 %) (31. Dezember 2023: (0,23 %))

| Geforderter Betrag              | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 20.026.864 €                    | 21.054.485 US\$     | 04.02.2025       | HSBC Bank Plc               | 2         | (289.423)                       | (0,01)               |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 945.392 AUD                     | 610.886 US\$        | 13.03.2025       | Citibank NA                 | 2         | (25.493)                        | (0,00)               |
| 925.181 AUD                     | 597.569 US\$        | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 6         | (24.691)                        | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen CAD</i> |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 3.871 CAD                       | 2.751 US\$          | 13.03.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (53)                            | (0,00)               |
| 418.180 CAD                     | 297.438 US\$        | 13.03.2025       | Royal Bank of Canada        | 2         | (5.928)                         | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i> |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 25.345.427 CHF                  | 29.158.582 US\$     | 13.03.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (976.925)                       | (0,03)               |
| 28.709.393 CHF                  | 33.019.504 US\$     | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 9         | (1.097.442)                     | (0,04)               |
| 61.648 US\$                     | 55.466 CHF          | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | (25)                            | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 12.043.369 €                    | 12.782.167 US\$     | 13.03.2025       | Citibank NA                 | 1         | (273.864)                       | (0,01)               |
| 802.143.203 €                   | 851.928.221 US\$    | 13.03.2025       | Royal Bank of Canada        | 1         | (18.818.323)                    | (0,50)               |

## Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (1,83 %) (31. Dezember 2023: (0,23 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens         |
|---|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|------------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR (Fortsetzung)</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                              |
| 802.143.203 €   | 851.990.788 US\$    | 13.03.2025       | UBS AG                      | 1         | (18.880.890)                    | (0,50)                       |
| 7.013.115 €   | 7.358.732 US\$      | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 15        | (74.876)                        | (0,00)                       |
| 169 US\$  | 163 €               | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | (0)                             | (0,00)                       |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                              |
| 157.955.094 £   | 201.660.062 US\$    | 13.03.2025       | Citibank NA                 | 5         | (3.940.375)                     | (0,10)                       |
| 346.120 £   | 436.430 US\$        | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 12        | (3.177)                         | (0,00)                       |
| 321.147 US\$  | 256.686 £           | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 3         | (159)                           | (0,00)                       |
| <i>Abgesicherte Klassen JPY</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                              |
| 39.643.820.162 ¥  | 265.925.270 US\$    | 13.03.2025       | Goldman Sachs International | 2         | (11.640.374)                    | (0,31)                       |
| 39.643.820.161 ¥  | 265.939.451 US\$    | 13.03.2025       | Royal Bank of Canada        | 2         | (11.654.554)                    | (0,31)                       |
| 14.478.869 ¥  | 96.052 US\$         | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 2         | (3.181)                         | (0,00)                       |
| 4.590 US\$  | 716.850 ¥           | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | (8)                             | (0,00)                       |
| <i>Abgesicherte Klassen SEK</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                              |
| 8.830.188 SEK   | 814.156 US\$        | 13.03.2025       | Goldman Sachs International | 5         | (12.002)                        | (0,00)                       |
| 596 SEK   | 54 US\$             | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 5         | (1)                             | (0,00)                       |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                              |
| 577.568 SGD   | 433.178 US\$        | 13.03.2025       | Citibank NA                 | 1         | (8.626)                         | (0,00)                       |
| 35.088.620 SGD  | 26.317.419 US\$     | 13.03.2025       | Goldman Sachs International | 2         | (524.909)                       | (0,01)                       |
| 35.088.620 SGD  | 26.308.619 US\$     | 13.03.2025       | Royal Bank of Canada        | 2         | (516.109)                       | (0,01)                       |
| 42.866 SGD  | 31.605 US\$         | 13.03.2025       | UBS AG                      | 1         | (96)                            | (0,00)                       |
| 1.194.043 SGD   | 887.423 US\$        | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp        | 18        | (9.720)                         | (0,00)                       |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>                          |                     |                  |                             |           | <b>(68.781.224)</b>             | <b>(1,83)</b>                |
|   |                     |                  |                             |           | <b>Zeitwert US\$</b>            | <b>% des Nettovermögens</b>  |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> |                     |                  |                             |           | <b>(68.781.224)</b>             | <b>(1,83)</b>                |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              |                     |                  |                             |           | <b>3.699.951.092</b>            | <b>97,99</b>                 |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  |                     |                  |                             |           | <b>75.724.194</b>               | <b>2,01</b>                  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   |                     |                  |                             |           | <b>3.775.675.286</b>            | <b>100,00</b>                |
| <b>Portfolioanalyse</b>   |                     |                  |                             |           | <b>US\$</b>                     | <b>% des Gesamtvermögens</b> |
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind   |                     |                  |                             |           | 2.721.381.115                   | 70,62                        |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden              |                     |                  |                             |           | 1.029.308.347                   | 26,71                        |
| † Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente  |                     |                  |                             |           | 9.000.000                       | 0,23                         |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente   |                     |                  |                             |           | (59.738.370)                    | (1,55)                       |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  |                     |                  |                             |           | <b>3.699.951.092</b>            | <b>96,01</b>                 |

## Short Duration Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|-----------------|------------------------------|
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 14,70 % (31. Dezember 2023: 9,14 %)</b> |   |        |                       |                 |                              |
| <b>Euro</b>  |   |        |                       |                 |                              |
| 6.000.000  | Auto ABS Italian Stella Loans Srl Series 2024-1 Class A       | 3,59 % | 29.12.2036            | 6.012.624       | 0,32                         |
| 3.100.000  | Auto ABS Italian Stella Loans Srl Series 2024-1 Class B       | 4,06 % | 29.12.2036            | 3.112.533       | 0,17                         |
| 4.523.281  | Auto1 Car Funding Sarl Series 2024-1 Class A                  | 3,55 % | 15.12.2033            | 4.529.076       | 0,24                         |
| 5.107.130  | Bbva Consumer Auto FT Series 2024-1 Class B                   | 3,97 % | 19.03.2038            | 5.114.883       | 0,27                         |
| 5.533.206  | Brignole Co Series 2024 Class A                               | 3,58 % | 24.02.2042            | 5.544.715       | 0,29                         |
| 1.790.155  | Brignole Co Series 2024 Class C                               | 4,80 % | 24.02.2042            | 1.805.681       | 0,10                         |
| 3.723.418  | Brignole CQ Series 2024 Class A                               | 3,95 % | 24.09.2040            | 3.736.175       | 0,20                         |
| 1.489.367  | Brignole CQ Series 2024 Class B                               | 4,33 % | 24.09.2040            | 1.494.988       | 0,08                         |
| 13.307.398   | Clavel Residential 3 DAC Series 2023-1X Class A               | 4,47 % | 28.01.2076            | 13.328.516      | 0,71                         |
| 3.640.242  | Dilosk Rmbs No. 10 STS DAC Series 10 Class A                  | 3,52 % | 24.09.2060            | 3.645.983       | 0,19                         |
| 1.647.294  | Dilosk Rmbs No. 9 DAC Series 9 Class A                        | 3,77 % | 25.01.2063            | 1.649.515       | 0,09                         |
| 632.569  | Domi BV Series 2020-1 Class A                                 | 3,98 % | 15.04.2052            | 633.529         | 0,03                         |
| 1.500.000  | Domi BV Series 2020-2 Class B                                 | 4,52 % | 15.11.2052            | 1.506.597       | 0,08                         |
| 14.005.015   | Domi BV Series 2024-1 Class A                                 | 3,57 % | 15.06.2056            | 14.027.941      | 0,75                         |
| 10.094.950   | Dutch Property Finance BV Series 2021-2 Class A               | 3,77 % | 28.04.2059            | 10.113.888      | 0,54                         |
| 1.767.673  | Dutch Property Finance BV Series 2022-2 Class A               | 3,97 % | 28.04.2062            | 1.776.803       | 0,09                         |
| 3.200.000  | GAMMA Sociedade de Titularizacao de Creditos Series 2 Class A | 3,91 % | 25.02.2034            | 3.207.402       | 0,17                         |
| 3.100.000  | Golden Bar Securitisation Srl Series 2024-1 Class A           | 3,67 % | 22.09.2043            | 3.110.428       | 0,17                         |
| 2.300.000  | Golden Bar Securitisation Srl Series 2024-1 Class C           | 4,99 % | 22.09.2043            | 2.316.698       | 0,12                         |
| 6.275.183  | Golden Ray SA - Compartment Series 1 Class A2                 | 3,65 % | 27.12.2057            | 6.287.081       | 0,33                         |
| 5.600.000  | Hill FL BV Series 2024-2FL Class A                            | 3,57 % | 18.10.2032            | 5.618.133       | 0,30                         |
| 2.900.000  | Italian Stella Loans Srl Series 2024-2 Class B                | 4,00 % | 27.05.2039            | 2.905.426       | 0,15                         |
| 9.800.000  | Jeronimo Funding DAC Series 1 Class A                         | 3,96 % | 25.10.2064            | 9.744.625       | 0,52                         |
| 1.772.000  | Jeronimo Funding DAC Series 1 Class C                         | 5,21 % | 25.10.2064            | 1.735.302       | 0,09                         |
| 2.738.474  | Jubilee Place BV Series 3 Class A                             | 4,07 % | 17.01.2059            | 2.748.242       | 0,15                         |
| 5.518.248  | Kinbane DAC Series 2024-RPL2X Class A                         | 3,90 % | 24.01.2063            | 5.530.796       | 0,29                         |
| 4.740.000  | Kinbane DAC Series 2024-RPL2X Class B                         | 4,40 % | 24.01.2063            | 4.757.216       | 0,25                         |
| 5.275.000  | Lugo Funding DAC Series 2024-1X Class A                       | 3,99 % | 26.05.2066            | 5.263.195       | 0,28                         |
| 4.675.456  | Marzio Finance Srl Series 2024-15 Class A                     | 3,69 % | 28.09.2049            | 4.688.883       | 0,25                         |
| 4.957.696  | Merrion Square Residential DAC Series 2023-1X Class A         | 3,80 % | 24.10.2064            | 4.963.982       | 0,26                         |
| 7.000.000  | Miltonia Mortgage Finance Srl Series 1 Class B                | 4,37 % | 28.04.2062            | 6.987.631       | 0,37                         |
| 11.418.548   | Mulcair Securities No. 3 DAC Series 3 Class A                 | 4,05 % | 24.04.2065            | 11.434.614      | 0,61                         |
| 2.000.000  | Mulcair Securities No. 3 DAC Series 3 Class B                 | 4,85 % | 24.04.2065            | 2.003.412       | 0,11                         |
| 2.400.000  | Noria DE Series 2024-DE1 Class B                              | 3,80 % | 25.02.2043            | 2.397.989       | 0,13                         |
| 6.700.000  | Pepper Iberia Consumer Series 2024-1 Class A                  | 3,75 % | 25.04.2037            | 6.699.511       | 0,36                         |
| 700.000  | Pepper Iberia Consumer Series 2024-1 Class B                  | 4,15 % | 25.04.2037            | 701.220         | 0,04                         |
| 4.368.617  | Primrose Residential Series 2022-1 Class A                    | 3,80 % | 24.10.2061            | 4.383.947       | 0,23                         |
| 3.500.000  | Primrose Residential Series 2022-1 Class D                    | 5,20 % | 24.10.2061            | 3.307.693       | 0,18                         |
| 5.271.277  | Quarzo Srl Series 2023-1 Class A1                             | 3,84 % | 15.12.2039            | 5.289.230       | 0,28                         |

## Short Duration Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung  | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR    | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|---------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 14,70 % (31. Dezember 2023: 9,14 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                    |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |  |         |                       |                    |                              |
| 3.765.198  | Quarzo Srl Series 2023-1 Class A2  | 3,84 %  | 15.12.2039            | 3.778.765          | 0,20                         |
| 9.000.000  | Quarzo Srl Series 2024-1 Class A1  | 3,68 %  | 15.06.2041            | 9.018.513          | 0,48                         |
| 1.400.000  | Quarzo Srl Series 2024-1 Class C   | 5,19 %  | 15.06.2041            | 1.415.385          | 0,07                         |
| 800.000  | Red & Black Auto Germany UG Series 11 Class B  | 4,05 %  | 15.09.2033            | 802.524            | 0,04                         |
| 2.816.132  | Red & Black Auto Italy Srl Series 2 Class A1   | 3,86 %  | 28.07.2034            | 2.833.310          | 0,15                         |
| 3.930.642  | Red & Black Auto Italy Srl Series 3 Class A  | 3,67 %  | 28.07.2036            | 3.941.342          | 0,21                         |
| 1.000.000  | Red & Black Auto Italy Srl Series 3 Class B  | 3,96 %  | 28.07.2036            | 1.001.899          | 0,05                         |
| 2.260.244  | Red & Black Auto Lease France Series 2 Class A   | 3,76 %  | 27.06.2035            | 2.263.736          | 0,12                         |
| 1.500.000  | SC Germany SA Compartment Consumer Series 2024-1 Class B                                 | 3,88 %  | 14.01.2038            | 1.499.691          | 0,08                         |
| 2.200.000  | SCF Rahoituspalvelut XIII DAC Series 13 Class A  | 3,38 %  | 25.06.2034            | 2.202.743          | 0,12                         |
| 2.500.000  | Shamrock Residential DAC Series 2023-1X Class C  | 5,55 %  | 24.06.2071            | 2.349.810          | 0,12                         |
| 18.500.000   | Shamrock Residential DAC Series 2024-1X Class A  | 3,99 %  | 24.12.2078            | 18.527.436         | 0,98                         |
| 1.600.000  | Shamrock Residential DAC Series 2024-1X Class B  | 4,49 %  | 24.12.2078            | 1.606.269          | 0,09                         |
| 4.216.512  | Stresa Securitisation Srl Series 1 Class A   | 4,04 %  | 22.12.2045            | 4.131.085          | 0,22                         |
| 3.300.000  | Sunrise Spv 95 Srl Series 2024-1 Class A1  | 3,65 %  | 27.03.2049            | 3.307.689          | 0,18                         |
| 5.200.000  | Sunrise SpV 270 Srl Series 2024-2 Class A1   | 3,69 %  | 27.10.2049            | 5.215.870          | 0,28                         |
| 101.179  | Tagus - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA Series 2019-ENGY Class A1              | 4,84 %  | 12.05.2025            | 101.152            | 0,01                         |
| 1.956.173  | Tagus - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Ulisses Finance No. 3 Series 3 Class C | 6,50 %  | 23.06.2039            | 1.986.541          | 0,11                         |
| 8.400.000  | Tagus - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Vasco Finance No. 2 Series 2 Class A   | 4,03 %  | 27.10.2042            | 8.407.316          | 0,45                         |
| 1.800.000  | Tagus - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Vasco Finance No. 2 Series 2 Class B   | 4,65 %  | 27.10.2042            | 1.802.461          | 0,10                         |
| 7.000.000  | Thunder Logistics DAC Series 2024-1X Class A   | 4,21 %  | 17.11.2036            | 6.950.748          | 0,37                         |
| 3.100.000  | Titrisocram Series 2024-1 Class A  | 3,66 %  | 26.03.2039            | 3.103.931          | 0,16                         |
| 2.300.000  | Tulip Mortgage Funding BV Series 2024-1 Class A  | 3,36 %  | 15.01.2064            | 2.285.687          | 0,12                         |
| 817.613  | Warrington Residential DAC Series 2022-1 Class A1  | 4,80 %  | 24.12.2056            | 802.325            | 0,04                         |
| 2.924.458  | Youni Italy Srl Series 2024-1 Class A  | 3,73 %  | 20.04.2034            | 2.936.159          | 0,16                         |
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) insgesamt **</b>                                      |  |         |                       | <b>276.388.490</b> | <b>14,70</b>                 |
| <b>Unternehmensanleihen 72,99 % (31. Dezember 2023: 79,48 %)</b>   |  |         |                       |                    |                              |
| <b>Euro</b>  |  |         |                       |                    |                              |
| 2.500.000  | 888 Acquisitions Ltd**   | 7,56 %  | 15.07.2027            | 2.452.285          | 0,13                         |
| 2.700.000  | A2A SpA*   | 5,00 %  | 31.12.2149            | 2.792.858          | 0,15                         |
| 1.800.000  | Abertis Infraestructuras Finance BV*   | 4,87 %  | 31.12.2149            | 1.846.231          | 0,10                         |
| 100.000  | ABN AMRO Bank NV*  | 3,75 %  | 20.04.2025            | 100.216            | 0,01                         |
| 3.300.000  | AccorInvest Group SA*  | 5,50 %  | 15.11.2031            | 3.380.420          | 0,18                         |
| 2.700.000  | Achmea Bank NV*  | 2,75 %  | 10.12.2027            | 2.695.650          | 0,14                         |
| 8.000.000  | Aegon Ltd*   | 2,68 %  | 31.12.2149            | 6.462.820          | 0,34                         |
| 1.200.000  | Afflelou SAS*  | 6,00 %  | 25.07.2029            | 1.255.164          | 0,07                         |
| 1.000.000  | AIB Group Plc*   | 2,25 %  | 04.04.2028            | 985.530            | 0,05                         |
| 1.200.000  | Alexandrite Monnet UK Holdco Plc*  | 10,50 % | 15.05.2029            | 1.317.778          | 0,07                         |

## Short Duration Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung  | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|---------|-----------------------|-----------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 72,99 % (31. Dezember 2023: 79,48 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                 |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |  |         |                       |                 |                              |
| 2.600.000  | Allianz SE*  | 2,60 %  | 31.12.2149            | 2.195.973       | 0,12                         |
| 3.500.000  | Almaviva-The Italian Innovation Co SpA*                                    | 5,00 %  | 30.10.2030            | 3.565.625       | 0,19                         |
| 9.000.000  | AMCO - Asset Management Co SpA**   | 1,38 %  | 27.01.2025            | 8.989.884       | 0,48                         |
| 3.600.000  | American Tower Corp*   | 0,40 %  | 15.02.2027            | 3.424.496       | 0,18                         |
| 6.000.000  | American Tower Corp*   | 0,95 %  | 05.10.2030            | 5.266.404       | 0,28                         |
| 700.000  | American Tower Corp*   | 1,95 %  | 22.05.2026            | 692.207         | 0,04                         |
| 100.000  | ANZ New Zealand Int'l Ltd*   | 3,95 %  | 17.07.2026            | 102.325         | 0,01                         |
| 400.000  | APA Infrastructure Ltd*  | 7,13 %  | 09.11.2083            | 441.033         | 0,02                         |
| 3.700.000  | ArcelorMittal SA*  | 3,13 %  | 13.12.2028            | 3.669.971       | 0,19                         |
| 200.000  | Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc* | 2,00 %  | 01.09.2028            | 182.430         | 0,01                         |
| 2.000.000  | Arkema SA*   | 1,50 %  | 31.12.2149            | 1.946.987       | 0,10                         |
| 3.400.000  | Aroundtown Finance Sarl*   | 5,00 %  | 31.12.2149            | 3.008.320       | 0,16                         |
| 6.947.000  | Aroundtown Finance Sarl*   | 7,13 %  | 31.12.2149            | 6.826.691       | 0,36                         |
| 5.000.000  | Aroundtown SA*   | 0,38 %  | 15.04.2027            | 4.666.839       | 0,25                         |
| 2.600.000  | Aroundtown SA*   | 1,45 %  | 09.07.2028            | 2.413.023       | 0,13                         |
| 1.500.000  | Aroundtown SA*   | 1,63 %  | 31.01.2028            | 1.420.683       | 0,08                         |
| 3.000.000  | Aroundtown SA*   | 1,63 %  | 31.12.2149            | 2.733.642       | 0,15                         |
| 4.000.000  | Arval Service Lease SA*  | 0,00 %  | 01.10.2025            | 3.920.108       | 0,21                         |
| 5.000.000  | Arval Service Lease SA*  | 0,88 %  | 17.02.2025            | 4.986.000       | 0,26                         |
| 1.800.000  | Arval Service Lease SA*  | 4,13 %  | 13.04.2026            | 1.822.641       | 0,10                         |
| 4.000.000  | Arval Service Lease SA*  | 4,25 %  | 11.11.2025            | 4.043.842       | 0,21                         |
| 2.500.000  | ASK Chemicals Deutschland Holding GmbH**                                   | 10,00 % | 15.11.2029            | 2.467.875       | 0,13                         |
| 3.500.000  | ASR Nederland NV*  | 6,63 %  | 31.12.2149            | 3.677.450       | 0,20                         |
| 9.600.000  | AT&T Inc*  | 2,88 %  | 31.12.2149            | 9.558.840       | 0,51                         |
| 10.900.000   | Athene Global Funding*   | 0,37 %  | 10.09.2026            | 10.456.592      | 0,56                         |
| 9.000.000  | Athene Global Funding*   | 0,83 %  | 08.01.2027            | 8.638.110       | 0,46                         |
| 500.000  | AusNet Services Holdings Pty Ltd*  | 1,63 %  | 11.03.2081            | 482.990         | 0,03                         |
| 100.000  | Australia & New Zealand Banking Group Ltd*                                 | 3,44 %  | 04.04.2025            | 100.137         | 0,00                         |
| 3.000.000  | Autostrade per l'Italia SpA*   | 2,00 %  | 04.12.2028            | 2.868.262       | 0,15                         |
| 5.000.000  | Autostrade per l'Italia SpA*   | 4,38 %  | 16.09.2025            | 5.045.962       | 0,27                         |
| 4.800.000  | Avis Budget Finance Plc*   | 7,00 %  | 28.02.2029            | 5.042.628       | 0,27                         |
| 8.184.000  | AXA SA*  | 2,46 %  | 31.12.2149            | 7.755.690       | 0,41                         |
| 3.000.000  | Ayvens Bank NV*  | 0,25 %  | 23.02.2026            | 2.911.828       | 0,15                         |
| 4.400.000  | Ayvens SA*   | 3,88 %  | 22.02.2027            | 4.477.361       | 0,24                         |
| 7.400.000  | Ayvens SA*   | 3,88 %  | 24.01.2028            | 7.574.085       | 0,40                         |
| 13.000.000   | Ayvens SA*   | 3,88 %  | 16.07.2029            | 13.311.581      | 0,71                         |
| 5.000.000  | Balder Finland OYJ*  | 1,00 %  | 20.01.2029            | 4.504.880       | 0,24                         |
| 3.400.000  | Balder Finland OYJ*  | 2,00 %  | 18.01.2031            | 3.048.818       | 0,16                         |
| 3.000.000  | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA*  | 1,38 %  | 14.05.2025            | 2.983.367       | 0,16                         |
| 100.000  | Banco BPM SpA**  | 0,88 %  | 15.07.2026            | 97.478          | 0,00                         |

## Short Duration Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                               | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|--------|-----------------------|-----------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 72,99 % (31. Dezember 2023: 79,48 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                 |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |   |        |                       |                 |                              |
| 1.920.000  | Banco BPM SpA <sup>*</sup>                          | 3,38 % | 24.01.2030            | 1.957.937       | 0,10                         |
| 100.000  | Banco BPM SpA <sup>*</sup>                          | 3,88 % | 18.09.2026            | 102.014         | 0,01                         |
| 4.500.000  | Banco BPM SpA <sup>*</sup>                          | 3,88 % | 09.09.2030            | 4.567.905       | 0,24                         |
| 4.900.000  | Banco BPM SpA <sup>*</sup>                          | 4,50 % | 26.11.2036            | 4.949.480       | 0,26                         |
| 6.500.000  | Banco BPM SpA <sup>*</sup>                          | 4,63 % | 29.11.2027            | 6.802.137       | 0,36                         |
| 2.000.000  | Banco BPM SpA <sup>**</sup>                         | 5,00 % | 18.06.2034            | 2.071.862       | 0,11                         |
| 100.000  | Banco de Credito Social Cooperativo SA <sup>*</sup> | 1,75 % | 09.03.2028            | 97.317          | 0,00                         |
| 3.000.000  | Banco de Sabadell SA <sup>*</sup>                   | 0,88 % | 22.07.2025            | 2.965.931       | 0,16                         |
| 5.400.000  | Banco de Sabadell SA <sup>*</sup>                   | 2,63 % | 24.03.2026            | 5.393.099       | 0,29                         |
| 4.000.000  | Banco de Sabadell SA <sup>*</sup>                   | 6,00 % | 16.08.2033            | 4.265.400       | 0,23                         |
| 5.400.000  | Banco Santander SA <sup>*</sup>                     | 3,25 % | 02.04.2029            | 5.416.511       | 0,29                         |
| 10.000.000   | Banco Santander SA <sup>*</sup>                     | 3,88 % | 22.04.2029            | 10.266.335      | 0,55                         |
| 600.000  | Banjay Entertainment SAS <sup>**</sup>              | 7,00 % | 01.05.2029            | 633.755         | 0,03                         |
| 2.000.000  | Bank of America Corp <sup>*</sup>                   | 1,78 % | 04.05.2027            | 1.970.522       | 0,10                         |
| 9.500.000  | Bank of Montreal <sup>*</sup>                       | 3,65 % | 12.04.2027            | 9.506.793       | 0,51                         |
| 4.700.000  | Banque Federative du Credit Mutuel SA <sup>*</sup>  | 0,01 % | 07.03.2025            | 4.674.164       | 0,25                         |
| 200.000  | Banque Federative du Credit Mutuel SA <sup>*</sup>  | 0,01 % | 11.05.2026            | 192.582         | 0,01                         |
| 11.800.000   | Banque Federative du Credit Mutuel SA <sup>*</sup>  | 2,28 % | 31.12.2149            | 11.746.693      | 0,62                         |
| 6.510.000  | Banque Federative du Credit Mutuel SA <sup>*</sup>  | 2,88 % | 31.12.2149            | 6.495.027       | 0,35                         |
| 5.700.000  | Banque Stellantis France SACA <sup>*</sup>          | 0,00 % | 22.01.2025            | 5.690.789       | 0,30                         |
| 10.000.000   | Barclays Plc <sup>*</sup>                           | 0,58 % | 09.08.2029            | 9.138.115       | 0,49                         |
| 2.916.000  | Barclays Plc <sup>*</sup>                           | 1,38 % | 24.01.2026            | 2.913.120       | 0,15                         |
| 4.000.000  | Barclays Plc <sup>*</sup>                           | 2,89 % | 31.01.2027            | 4.002.313       | 0,21                         |
| 2.900.000  | Barclays Plc <sup>*</sup>                           | 3,85 % | 08.05.2028            | 2.911.307       | 0,15                         |
| 10.000.000   | Barclays Plc <sup>*</sup>                           | 4,92 % | 08.08.2030            | 10.693.180      | 0,57                         |
| 4.000.000  | Bayer AG <sup>*</sup>                               | 6,63 % | 25.09.2083            | 4.151.205       | 0,22                         |
| 200.000  | Bayer Capital Corp BV <sup>*</sup>                  | 1,50 % | 26.06.2026            | 196.225         | 0,01                         |
| 1.200.000  | Bayerische Landesbank <sup>*</sup>                  | 7,00 % | 05.01.2034            | 1.326.024       | 0,07                         |
| 1.850.000  | BCP V Modular Services Finance II Plc <sup>**</sup> | 4,75 % | 30.11.2028            | 1.821.186       | 0,10                         |
| 800.000  | Bertrand Franchise Finance SAS <sup>*</sup>         | 6,50 % | 18.07.2030            | 839.700         | 0,04                         |
| 3.500.000  | BNP Paribas Home Loan SFH SA <sup>*</sup>           | 2,52 % | 29.10.2027            | 3.508.111       | 0,19                         |
| 12.000.000   | BNP Paribas SA <sup>*</sup>                         | 0,25 % | 13.04.2027            | 11.593.434      | 0,62                         |
| 15.500.000   | BNP Paribas SA <sup>*</sup>                         | 1,38 % | 28.05.2029            | 14.319.923      | 0,76                         |
| 8.500.000  | BNP Paribas SA <sup>*</sup>                         | 2,13 % | 23.01.2027            | 8.426.475       | 0,45                         |
| 200.000  | BPCE SA <sup>*</sup>                                | 0,38 % | 02.02.2026            | 194.672         | 0,01                         |
| 10.000.000   | BPCE SA <sup>*</sup>                                | 0,50 % | 15.09.2027            | 9.575.637       | 0,51                         |
| 6.000.000  | BPCE SA <sup>*</sup>                                | 0,63 % | 28.04.2025            | 5.956.260       | 0,32                         |
| 10.000.000   | BPCE SA <sup>*</sup>                                | 4,38 % | 13.07.2028            | 10.388.665      | 0,55                         |
| 100.000  | BPCE SFH SA <sup>*</sup>                            | 0,13 % | 31.03.2025            | 99.348          | 0,00                         |
| 4.092.000  | British Telecommunications Plc <sup>*</sup>         | 1,87 % | 18.08.2080            | 4.042.078       | 0,21                         |

## Short Duration Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                    | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|--------|-----------------------|-----------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 72,99 % (31. Dezember 2023: 79,48 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                 |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |  |        |                       |                 |                              |
| 1.300.000  | British Telecommunications Plc*          | 5,13 % | 03.10.2054            | 1.349.392       | 0,07                         |
| 1.020.000  | CA Auto Bank SpA*                        | 4,03 % | 13.01.2025            | 1.020.350       | 0,05                         |
| 1.800.000  | CA Auto Bank SpA*                        | 4,75 % | 25.01.2027            | 1.859.107       | 0,10                         |
| 1.000.000  | Caisse de Refinancement de l'Habitat SA* | 2,40 % | 17.01.2025            | 999.785         | 0,05                         |
| 100.000  | Canadian Imperial Bank of Commerce*      | 0,38 % | 10.03.2026            | 97.536          | 0,00                         |
| 10.000.000   | Canadian Imperial Bank of Commerce*      | 3,81 % | 09.07.2029            | 10.287.666      | 0,55                         |
| 1.500.000  | CECONOMY AG*                             | 6,25 % | 15.07.2029            | 1.554.244       | 0,08                         |
| 200.000  | Celanese US Holdings LLC*                | 2,13 % | 01.03.2027            | 192.575         | 0,01                         |
| 1.000.000  | Cie de Financement Foncier SA*           | 0,75 % | 21.01.2025            | 998.944         | 0,05                         |
| 500.000  | Cirsa Finance International Sarl*        | 4,50 % | 15.03.2027            | 501.473         | 0,03                         |
| 100.000  | Cirsa Finance International Sarl*        | 7,88 % | 31.07.2028            | 106.002         | 0,01                         |
| 13.000.000   | Citigroup Inc*                           | 1,25 % | 06.07.2026            | 12.883.065      | 0,68                         |
| 16.000.000   | Citigroup Inc*                           | 1,50 % | 24.07.2026            | 15.860.280      | 0,84                         |
| 1.200.000  | Citigroup Inc*                           | 4,25 % | 25.02.2030            | 1.200.721       | 0,06                         |
| 1.300.000  | Citycon Treasury BV*                     | 5,00 % | 11.03.2030            | 1.309.136       | 0,07                         |
| 2.250.000  | Citycon Treasury BV*                     | 6,50 % | 08.03.2029            | 2.391.947       | 0,13                         |
| 200.000  | Commerzbank AG*                          | 0,10 % | 11.09.2025            | 196.571         | 0,01                         |
| 700.000  | Commerzbank AG*                          | 3,57 % | 12.03.2027            | 702.597         | 0,04                         |
| 11.100.000   | Commerzbank AG*                          | 5,13 % | 18.01.2030            | 11.837.007      | 0,63                         |
| 4.500.000  | CPI Property Group SA*                   | 1,50 % | 27.01.2031            | 3.583.125       | 0,19                         |
| 7.000.000  | CPI Property Group SA*                   | 1,75 % | 14.01.2030            | 5.910.625       | 0,31                         |
| 7.000.000  | CPI Property Group SA*                   | 3,75 % | 31.12.2149            | 6.158.731       | 0,33                         |
| 4.000.000  | CPI Property Group SA*                   | 4,88 % | 31.12.2149            | 3.845.000       | 0,20                         |
| 7.400.000  | CPI Property Group SA*                   | 6,00 % | 27.01.2032            | 7.448.803       | 0,40                         |
| 5.000.000  | CPI Property Group SA*                   | 7,00 % | 07.05.2029            | 5.324.288       | 0,28                         |
| 700.000  | Credit Agricole SA*                      | 3,00 % | 02.02.2025            | 699.906         | 0,04                         |
| 9.000.000  | Credit Mutuel Home Loan SFH SA*          | 0,63 % | 10.02.2025            | 8.978.418       | 0,48                         |
| 2.400.000  | Crelan SA*                               | 5,38 % | 30.04.2035            | 2.521.764       | 0,13                         |
| 5.000.000  | Crelan SA*                               | 5,75 % | 26.01.2028            | 5.364.706       | 0,28                         |
| 16.400.000   | Crelan SA*                               | 6,00 % | 28.02.2030            | 18.048.782      | 0,96                         |
| 3.500.000  | Cullinan Holdco Scsp**                   | 4,63 % | 15.10.2026            | 3.297.437       | 0,18                         |
| 1.400.000  | Danske Bank A/S*                         | 1,38 % | 12.02.2030            | 1.396.646       | 0,07                         |
| 3.000.000  | Deutsche Postbank Funding Trust I*       | 2,24 % | 31.12.2149            | 2.595.844       | 0,14                         |
| 3.000.000  | Deutsche Postbank Funding Trust III*     | 2,91 % | 31.12.2149            | 2.604.000       | 0,14                         |
| 4.000.000  | Digital Euro Finco LLC*                  | 2,50 % | 16.01.2026            | 3.985.007       | 0,21                         |
| 1.300.000  | doValue SpA*                             | 3,38 % | 31.07.2026            | 1.276.516       | 0,07                         |
| 1.300.000  | Duomo Bidco SpA**                        | 7,30 % | 15.07.2031            | 1.311.836       | 0,07                         |
| 3.000.000  | E.ON SE*                                 | 0,88 % | 08.01.2025            | 2.999.369       | 0,16                         |
| 3.000.000  | easyJet FinCo BV*                        | 1,88 % | 03.03.2028            | 2.887.820       | 0,15                         |
| 1.600.000  | EDP SA*                                  | 1,70 % | 20.07.2080            | 1.579.334       | 0,08                         |

## Short Duration Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                       | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|-----------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 72,99 % (31. Dezember 2023: 79,48 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                 |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |   |         |                       |                 |                              |
| 1.200.000  | Electricite de France SA*                   | 2,88 %  | 31.12.2149            | 1.174.332       | 0,06                         |
| 2.000.000  | Electricite de France SA*                   | 3,38 %  | 31.12.2149            | 1.868.527       | 0,10                         |
| 100.000  | Electricite de France SA*                   | 3,75 %  | 05.06.2027            | 101.974         | 0,01                         |
| 1.000.000  | Electricite de France SA*                   | 5,63 %  | 31.12.2149            | 1.035.720       | 0,05                         |
| 1.500.000  | ELO SACA*                                   | 5,88 %  | 17.04.2028            | 1.318.549       | 0,07                         |
| 400.000  | Emeria SASU**                               | 3,38 %  | 31.03.2028            | 328.182         | 0,02                         |
| 1.000.000  | EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG*         | 1,88 %  | 29.06.2080            | 977.280         | 0,05                         |
| 2.500.000  | EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG*         | 2,13 %  | 31.08.2081            | 2.135.536       | 0,11                         |
| 3.000.000  | EnBW International Finance BV*              | 4,88 %  | 16.01.2025            | 3.002.486       | 0,16                         |
| 200.000  | Enel Finance International NV*              | 0,25 %  | 28.05.2026            | 193.635         | 0,01                         |
| 1.500.000  | Enel SpA*                                   | 1,38 %  | 31.12.2149            | 1.410.341       | 0,07                         |
| 2.300.000  | Enel SpA*                                   | 1,88 %  | 31.12.2149            | 2.017.244       | 0,11                         |
| 32.000.000   | Enel SpA*                                   | 3,50 %  | 31.12.2149            | 32.039.280      | 1,70                         |
| 800.000  | Energia Group Roi Financeco DAC**           | 6,88 %  | 31.07.2028            | 839.576         | 0,04                         |
| 700.000  | Energizer Gamma Acquisition BV**            | 3,50 %  | 30.06.2029            | 675.295         | 0,04                         |
| 2.500.000  | Engie SA*                                   | 1,88 %  | 31.12.2149            | 2.206.332       | 0,12                         |
| 1.700.000  | Engineering - Ingegneria Informatica - SpA* | 11,13 % | 15.05.2028            | 1.796.688       | 0,10                         |
| 1.500.000  | Eni SpA*                                    | 2,75 %  | 31.12.2149            | 1.397.866       | 0,07                         |
| 1.800.000  | Eni SpA*                                    | 3,38 %  | 31.12.2149            | 1.748.486       | 0,09                         |
| 2.600.000  | Eroski S Coop*                              | 10,63 % | 30.04.2029            | 2.835.677       | 0,15                         |
| 100.000  | Evonik Industries AG*                       | 1,38 %  | 02.09.2081            | 95.750          | 0,00                         |
| 3.400.000  | Fastighets AB Balder*                       | 1,13 %  | 29.01.2027            | 3.265.764       | 0,17                         |
| 783.000  | Fastighets AB Balder*                       | 1,25 %  | 28.01.2028            | 731.502         | 0,04                         |
| 900.000  | Fiber Bidco SpA*                            | 6,68 %  | 15.01.2030            | 908.736         | 0,05                         |
| 2.200.000  | Flora Food Management BV**                  | 6,88 %  | 02.07.2029            | 2.300.425       | 0,12                         |
| 500.000  | Fnac Darty SA*                              | 6,00 %  | 01.04.2029            | 525.083         | 0,03                         |
| 3.000.000  | Ford Motor Credit Co LLC*                   | 6,13 %  | 15.05.2028            | 3.247.090       | 0,17                         |
| 2.600.000  | Forvia SE*                                  | 5,50 %  | 15.06.2031            | 2.598.526       | 0,14                         |
| 2.400.000  | Fressnapf Holding SE**                      | 5,25 %  | 31.10.2031            | 2.478.375       | 0,13                         |
| 3.400.000  | General Motors Financial Co Inc*            | 3,90 %  | 12.01.2028            | 3.481.201       | 0,18                         |
| 10.000.000   | Goldman Sachs Group Inc*                    | 1,25 %  | 07.02.2029            | 9.334.550       | 0,50                         |
| 200.000  | Goldstory SAS*                              | 6,75 %  | 01.02.2030            | 209.476         | 0,01                         |
| 1.400.000  | Goldstory SAS*                              | 7,06 %  | 01.02.2030            | 1.413.724       | 0,07                         |
| 416.000  | Grand City Properties Finance Sarl*         | 6,13 %  | 31.12.2149            | 412.578         | 0,02                         |
| 6.800.000  | Grand City Properties SA*                   | 1,50 %  | 31.12.2149            | 6.514.602       | 0,35                         |
| 2.900.000  | Grifols SA*                                 | 2,25 %  | 15.11.2027            | 2.775.251       | 0,15                         |
| 1.600.000  | Gruenthal GmbH**                            | 4,63 %  | 15.11.2031            | 1.620.728       | 0,09                         |
| 2.500.000  | Grupo Antolin-Irausa SA*                    | 3,50 %  | 30.04.2028            | 1.858.319       | 0,10                         |
| 100.000  | Haleon Netherlands Capital BV*              | 1,25 %  | 29.03.2026            | 98.428          | 0,00                         |
| 5.000.000  | HBOS Plc*                                   | 4,50 %  | 18.03.2030            | 5.003.050       | 0,27                         |

## Short Duration Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                             | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|-----------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 72,99 % (31. Dezember 2023: 79,48 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                 |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |   |         |                       |                 |                              |
| 100.000  | Heathrow Funding Ltd <sup>*</sup>                 | 1,50 %  | 12.10.2025            | 99.045          | 0,00                         |
| 11.735.000   | Heimstaden Bostad AB <sup>*</sup>                 | 1,13 %  | 21.01.2026            | 11.475.246      | 0,61                         |
| 5.500.000  | Heimstaden Bostad AB <sup>*</sup>                 | 2,63 %  | 31.12.2149            | 5.109.163       | 0,27                         |
| 400.000  | Heimstaden Bostad AB <sup>*</sup>                 | 3,00 %  | 31.12.2149            | 367.385         | 0,02                         |
| 6.800.000  | Heimstaden Bostad AB <sup>*</sup>                 | 3,38 %  | 31.12.2149            | 6.619.196       | 0,35                         |
| 11.000.000   | Heimstaden Bostad AB <sup>*</sup>                 | 3,63 %  | 31.12.2149            | 10.530.160      | 0,56                         |
| 14.000.000   | Holcim Finance Luxembourg SA <sup>*</sup>         | 1,50 %  | 06.04.2025            | 13.943.132      | 0,74                         |
| 100.000  | Iberdrola Finanzas SA <sup>*</sup>                | 1,58 %  | 31.12.2149            | 94.386          | 0,00                         |
| 16.300.000   | Iberdrola International BV <sup>*</sup>           | 3,25 %  | 31.12.2149            | 16.290.016      | 0,87                         |
| 3.574.000  | Iccrea Banca SpA <sup>**</sup>                    | 4,25 %  | 05.02.2030            | 3.701.190       | 0,20                         |
| 1.750.000  | Iceland Bondco Plc <sup>**</sup>                  | 8,52 %  | 15.12.2027            | 1.774.176       | 0,09                         |
| 100.000  | IHO Verwaltungs GmbH <sup>*</sup>                 | 8,75 %  | 15.05.2028            | 105.769         | 0,01                         |
| 100.000  | INEOS Finance Plc <sup>*</sup>                    | 6,38 %  | 15.04.2029            | 105.092         | 0,01                         |
| 4.000.000  | Infineon Technologies AG <sup>*</sup>             | 2,88 %  | 31.12.2149            | 3.990.950       | 0,21                         |
| 4.000.000  | ING Groep NV <sup>*</sup>                         | 1,13 %  | 14.02.2025            | 3.990.676       | 0,21                         |
| 3.700.000  | ING Groep NV <sup>*</sup>                         | 2,00 %  | 22.03.2030            | 3.688.708       | 0,20                         |
| 6.500.000  | International Business Machines Corp <sup>*</sup> | 0,88 %  | 31.01.2025            | 6.489.306       | 0,34                         |
| 15.000.000   | Intesa Sanpaolo SpA <sup>**</sup>                 | 2,13 %  | 26.05.2025            | 14.948.321      | 0,79                         |
| 5.500.000  | Intesa Sanpaolo SpA <sup>**</sup>                 | 5,00 %  | 08.03.2028            | 5.727.783       | 0,30                         |
| 2.500.000  | Intrum AB <sup>*</sup>                            | 9,25 %  | 15.03.2028            | 1.826.719       | 0,10                         |
| 8.000.000  | Investec Bank Plc <sup>*</sup>                    | 1,25 %  | 11.08.2026            | 7.895.914       | 0,42                         |
| 13.325.000   | Islandsbanki HF <sup>*</sup>                      | 4,63 %  | 27.03.2028            | 13.802.564      | 0,73                         |
| 650.000  | Italmatch Chemicals SpA <sup>*</sup>              | 10,00 % | 06.02.2028            | 688.312         | 0,04                         |
| 5.000.000  | JPMorgan Chase & Co <sup>*</sup>                  | 3,67 %  | 06.06.2028            | 5.094.895       | 0,27                         |
| 3.600.000  | KBC Group NV <sup>*</sup>                         | 4,50 %  | 06.06.2026            | 3.621.494       | 0,19                         |
| 100.000  | Kleopatra Finco Sarl <sup>**</sup>                | 4,25 %  | 01.03.2026            | 92.678          | 0,00                         |
| 500.000  | Koninklijke KPN NV <sup>*</sup>                   | 4,88 %  | 31.12.2149            | 519.763         | 0,03                         |
| 4.372.000  | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau <sup>*</sup>      | 2,75 %  | 15.03.2028            | 4.433.045       | 0,24                         |
| 8.300.000  | Landsbankinn HF <sup>*</sup>                      | 0,75 %  | 25.05.2026            | 8.057.337       | 0,43                         |
| 14.200.000   | Landsbankinn HF <sup>*</sup>                      | 3,75 %  | 08.10.2029            | 14.207.750      | 0,76                         |
| 11.671.000   | Landsbankinn HF <sup>*</sup>                      | 5,00 %  | 13.05.2028            | 12.248.845      | 0,65                         |
| 7.284.000  | Landsbankinn HF <sup>*</sup>                      | 6,38 %  | 12.03.2027            | 7.733.987       | 0,41                         |
| 12.000.000   | Leasys SpA <sup>*</sup>                           | 3,38 %  | 25.01.2029            | 11.982.133      | 0,64                         |
| 1.957.000  | Leasys SpA <sup>*</sup>                           | 3,88 %  | 12.10.2027            | 1.989.287       | 0,11                         |
| 5.600.000  | Leasys SpA <sup>*</sup>                           | 3,88 %  | 01.03.2028            | 5.688.476       | 0,30                         |
| 7.200.000  | Leasys SpA <sup>*</sup>                           | 4,00 %  | 08.04.2026            | 7.225.666       | 0,38                         |
| 100.000  | Lion/Polaris Lux 4 SA <sup>*</sup>                | 6,30 %  | 01.07.2029            | 100.550         | 0,01                         |
| 100.000  | Lloyds Bank Plc <sup>*</sup>                      | 3,25 %  | 02.02.2026            | 100.826         | 0,01                         |
| 6.000.000  | Lloyds Banking Group Plc <sup>*</sup>             | 3,50 %  | 01.04.2026            | 6.005.775       | 0,32                         |
| 200.000  | Loxam SAS <sup>*</sup>                            | 4,50 %  | 15.04.2027            | 197.502         | 0,01                         |

## Short Duration Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                 | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---------------------------------------|--------|-----------------------|-----------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 72,99 % (31. Dezember 2023: 79,48 %) (Fortsetzung)</b> |                                       |        |                       |                 |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |                                       |        |                       |                 |                              |
| 200.000  | Loxam SAS*                            | 6,38 % | 31.05.2029            | 211.163         | 0,01                         |
| 8.000.000  | Luminor Bank AS*                      | 0,54 % | 23.09.2026            | 7.845.390       | 0,42                         |
| 2.000.000  | Luminor Bank AS*                      | 5,40 % | 14.10.2035            | 2.036.500       | 0,11                         |
| 21.000.000   | Luminor Bank AS*                      | 7,75 % | 08.06.2027            | 22.359.482      | 1,19                         |
| 380.000  | Maxeda DIY Holding BV**               | 5,88 % | 01.10.2026            | 283.290         | 0,01                         |
| 10.000.000   | Mizuho Financial Group Inc*           | 3,46 % | 27.08.2030            | 10.119.175      | 0,54                         |
| 5.000.000  | Mizuho Financial Group Inc*           | 4,61 % | 28.08.2030            | 5.347.185       | 0,28                         |
| 200.000  | MMS USA Holdings Inc*                 | 0,63 % | 13.06.2025            | 198.005         | 0,01                         |
| 1.000.000  | Morgan Stanley*                       | 0,41 % | 29.10.2027            | 957.109         | 0,05                         |
| 5.500.000  | Morgan Stanley*                       | 3,52 % | 19.03.2027            | 5.516.512       | 0,29                         |
| 2.200.000  | Motability Operations Group Plc*      | 4,00 % | 17.01.2030            | 2.280.099       | 0,12                         |
| 12.000.000   | NatWest Group Plc*                    | 1,75 % | 02.03.2026            | 11.976.423      | 0,64                         |
| 1.900.000  | NIBC Bank NV*                         | 4,50 % | 12.06.2035            | 1.900.627       | 0,10                         |
| 2.000.000  | Nidda Healthcare Holding GmbH**       | 5,63 % | 21.02.2030            | 2.067.420       | 0,11                         |
| 5.000.000  | Norddeutsche Landesbank-Girozentrale* | 3,63 % | 11.09.2029            | 5.058.898       | 0,27                         |
| 5.900.000  | Norddeutsche Landesbank-Girozentrale* | 5,63 % | 23.08.2034            | 6.118.247       | 0,33                         |
| 2.600.000  | Nykredit Realkredit AS*               | 3,88 % | 05.07.2027            | 2.655.851       | 0,14                         |
| 1.600.000  | OEG Finance Plc**                     | 7,25 % | 27.09.2029            | 1.676.252       | 0,09                         |
| 200.000  | Orano SA*                             | 3,38 % | 23.04.2026            | 200.686         | 0,01                         |
| 100.000  | Paprec Holding SA**                   | 6,50 % | 17.11.2027            | 105.820         | 0,01                         |
| 14.000.000   | Permanent TSB Group Holdings Plc*     | 3,00 % | 19.08.2031            | 13.866.177      | 0,74                         |
| 5.000.000  | Permanent TSB Group Holdings Plc*     | 4,25 % | 10.07.2030            | 5.159.090       | 0,27                         |
| 13.194.000   | Permanent TSB Group Holdings Plc*     | 6,63 % | 25.04.2028            | 14.150.895      | 0,75                         |
| 100.000  | PEU Finance Plc*                      | 7,25 % | 01.07.2028            | 104.873         | 0,01                         |
| 1.700.000  | Picard Groupe SAS**                   | 6,38 % | 01.07.2029            | 1.772.387       | 0,09                         |
| 1.400.000  | Pinnacle Bidco Plc*                   | 8,25 % | 11.10.2028            | 1.487.719       | 0,08                         |
| 43.000   | Playtech Plc*                         | 4,25 % | 07.03.2026            | 43.007          | 0,00                         |
| 100.000  | PrestigeBidCo GmbH**                  | 6,93 % | 01.07.2029            | 101.665         | 0,01                         |
| 1.700.000  | Project Grand UK Plc*                 | 9,00 % | 01.06.2029            | 1.791.630       | 0,09                         |
| 2.900.000  | Prosus NV*                            | 2,78 % | 19.01.2034            | 2.613.561       | 0,14                         |
| 5.200.000  | Public Property Invest AS*            | 4,63 % | 12.03.2030            | 5.206.263       | 0,28                         |
| 1.637.000  | PVH Corp*                             | 4,13 % | 16.07.2029            | 1.684.833       | 0,09                         |
| 2.400.000  | Rakuten Group Inc*                    | 4,25 % | 31.12.2149            | 2.251.320       | 0,12                         |
| 1.800.000  | RCI Banque SA*                        | 1,63 % | 11.04.2025            | 1.793.429       | 0,10                         |
| 1.500.000  | RCI Banque SA*                        | 1,75 % | 10.04.2026            | 1.474.495       | 0,08                         |
| 10.000.000   | RCI Banque SA*                        | 2,63 % | 18.02.2030            | 9.975.400       | 0,53                         |
| 1.700.000  | RCI Banque SA*                        | 4,63 % | 13.07.2026            | 1.731.833       | 0,09                         |
| 2.100.000  | RCI Banque SA*                        | 4,63 % | 02.10.2026            | 2.145.998       | 0,11                         |
| 1.500.000  | RCI Banque SA*                        | 5,50 % | 09.10.2034            | 1.534.965       | 0,08                         |
| 1.000.000  | Repsol International Finance BV*      | 2,50 % | 31.12.2149            | 977.682         | 0,05                         |

## Short Duration Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                          | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|--------|-----------------------|-----------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 72,99 % (31. Dezember 2023: 79,48 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                 |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |  |        |                       |                 |                              |
| 4.928.000  | Repsol International Finance BV*               | 4,50 % | 25.03.2075            | 4.936.121       | 0,26                         |
| 2.000.000  | Roquette Freres SA*                            | 5,49 % | 31.12.2149            | 2.042.130       | 0,11                         |
| 1.300.000  | Rossini Sarl*                                  | 6,75 % | 31.12.2029            | 1.377.227       | 0,07                         |
| 1.000.000  | Royal Bank of Canada*                          | 3,65 % | 17.01.2025            | 1.000.312       | 0,05                         |
| 700.000  | RTE Réseau de Transport d'Electricite SADIR*   | 3,75 % | 30.04.2044            | 691.097         | 0,04                         |
| 1.400.000  | RWE AG*  | 3,50 % | 21.04.2075            | 1.399.741       | 0,07                         |
| 200.000  | Ryanair DAC*                                   | 0,88 % | 25.05.2026            | 194.872         | 0,01                         |
| 13.323.000   | SACE SpA*                                      | 3,88 % | 31.12.2149            | 13.305.947      | 0,71                         |
| 18.000.000   | Santander UK Group Holdings Plc*               | 0,60 % | 13.09.2029            | 16.330.261      | 0,87                         |
| 200.000  | Schaeffler AG*                                 | 4,50 % | 28.03.2030            | 201.422         | 0,01                         |
| 1.900.000  | SELP Finance Sarl*                             | 3,75 % | 10.08.2027            | 1.931.148       | 0,10                         |
| 500.000  | Snam SpA*                                      | 3,38 % | 19.02.2028            | 507.138         | 0,03                         |
| 500.000  | SoftBank Group Corp*                           | 5,00 % | 15.04.2028            | 513.844         | 0,03                         |
| 2.200.000  | Sogecap SA*                                    | 4,13 % | 31.12.2149            | 2.209.730       | 0,12                         |
| 200.000  | Sogecap SA*                                    | 6,50 % | 16.05.2044            | 223.567         | 0,01                         |
| 4.640.000  | Southern Co*                                   | 1,88 % | 15.09.2081            | 4.361.194       | 0,23                         |
| 6.000.000  | Southern Gas Networks Plc*                     | 3,50 % | 16.10.2030            | 5.983.400       | 0,32                         |
| 2.610.000  | Standard Chartered Plc*                        | 2,50 % | 09.09.2030            | 2.594.155       | 0,14                         |
| 14.100.000   | Sumitomo Mitsui Banking Corp*                  | 3,60 % | 16.02.2026            | 14.226.533      | 0,76                         |
| 100.000  | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd*                | 4,09 % | 19.04.2028            | 103.753         | 0,01                         |
| 1.200.000  | Sveafastigheter AB*                            | 4,75 % | 29.01.2027            | 1.180.997       | 0,06                         |
| 5.619.000  | Swedbank AB*                                   | 4,63 % | 30.05.2026            | 5.654.098       | 0,30                         |
| 1.000.000  | Synthomer Plc*                                 | 7,38 % | 02.05.2029            | 1.047.320       | 0,06                         |
| 12.600.000   | TAG Immobilien AG*                             | 4,25 % | 04.03.2030            | 12.816.937      | 0,68                         |
| 100.000  | TDC Net A/S*                                   | 5,62 % | 06.02.2030            | 106.424         | 0,01                         |
| 2.000.000  | Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH**       | 5,38 % | 15.07.2029            | 2.073.625       | 0,11                         |
| 1.500.000  | Telefonica Europe BV*                          | 2,38 % | 31.12.2149            | 1.399.718       | 0,07                         |
| 100.000  | Tereos Finance Groupe I SA**                   | 4,75 % | 30.04.2027            | 101.140         | 0,01                         |
| 1.200.000  | Tereos Finance Groupe I SA**                   | 5,88 % | 30.04.2030            | 1.233.000       | 0,07                         |
| 1.200.000  | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV* | 4,38 % | 09.05.2030            | 1.231.320       | 0,07                         |
| 6.500.000  | Thames Water Utilities Finance Plc*            | 0,88 % | 31.01.2028            | 4.807.941       | 0,26                         |
| 4.400.000  | Thames Water Utilities Finance Plc*            | 4,00 % | 18.04.2027            | 3.374.470       | 0,18                         |
| 100.000  | Toronto-Dominion Bank*                         | 1,71 % | 28.07.2025            | 99.466          | 0,00                         |
| 7.300.000  | Toronto-Dominion Bank*                         | 3,63 % | 13.12.2029            | 7.440.288       | 0,40                         |
| 100.000  | Toronto-Dominion Bank*                         | 3,77 % | 08.09.2026            | 102.137         | 0,01                         |
| 3.000.000  | TotalEnergies SE*                              | 2,13 % | 31.12.2149            | 2.601.183       | 0,14                         |
| 10.000.000   | TotalEnergies SE*                              | 2,63 % | 31.12.2149            | 9.971.125       | 0,53                         |
| 2.500.000  | Transportes Aereos Portugueses SA*             | 5,13 % | 15.11.2029            | 2.565.843       | 0,14                         |
| 5.000.000  | Transurban Finance Co Pty Ltd*                 | 1,45 % | 16.05.2029            | 4.673.765       | 0,25                         |
| 11.400.000   | Traton Finance Luxembourg SA*                  | 4,22 % | 21.01.2026            | 11.459.046      | 0,61                         |

## Short Duration Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                            | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR      | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|--|--------|-----------------------|----------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 72,99 % (31. Dezember 2023: 79,48 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                      |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |  |        |                       |                      |                              |
| 2.800.000  | Traton Finance Luxembourg SA <sup>*</sup>        | 4,50 % | 23.11.2026            | 2.869.352            | 0,15                         |
| 100.000  | TUI AG <sup>*</sup>                              | 5,88 % | 15.03.2029            | 105.016              | 0,01                         |
| 2.200.000  | TUI Cruises GmbH <sup>**</sup>                   | 5,00 % | 15.05.2030            | 2.235.700            | 0,12                         |
| 6.600.000  | UBS AG <sup>*</sup>                              | 0,25 % | 05.01.2026            | 6.436.046            | 0,34                         |
| 2.000.000  | UBS AG <sup>*</sup>                              | 1,50 % | 10.04.2026            | 1.969.255            | 0,10                         |
| 9.000.000  | UBS Group AG <sup>*</sup>                        | 0,25 % | 29.01.2026            | 8.978.823            | 0,48                         |
| 8.000.000  | UBS Group AG <sup>*</sup>                        | 0,25 % | 03.11.2026            | 7.820.260            | 0,42                         |
| 13.800.000   | UBS Group AG <sup>*</sup>                        | 2,13 % | 13.10.2026            | 13.715.285           | 0,73                         |
| 2.000.000  | UBS Group AG <sup>*</sup>                        | 3,25 % | 02.04.2026            | 1.999.902            | 0,11                         |
| 9.000.000  | UniCredit SpA <sup>**</sup>                      | 1,20 % | 20.01.2026            | 8.992.035            | 0,48                         |
| 16.049.000   | UniCredit SpA <sup>*</sup>                       | 1,25 % | 16.06.2026            | 15.935.871           | 0,85                         |
| 5.896.000  | UniCredit SpA <sup>**</sup>                      | 2,20 % | 22.07.2027            | 5.832.670            | 0,31                         |
| 2.500.000  | UniCredit SpA <sup>*</sup>                       | 5,38 % | 16.04.2034            | 2.648.811            | 0,14                         |
| 2.200.000  | UniCredit SpA <sup>**</sup>                      | 5,85 % | 15.11.2027            | 2.314.745            | 0,12                         |
| 200.000  | United Group BV <sup>**</sup>                    | 5,25 % | 01.02.2030            | 199.005              | 0,01                         |
| 1.500.000  | Veolia Environnement SA <sup>*</sup>             | 2,50 % | 31.12.2149            | 1.404.337            | 0,07                         |
| 1.500.000  | Veolia Environnement SA <sup>*</sup>             | 5,99 % | 31.12.2149            | 1.606.604            | 0,09                         |
| 100.000  | Verisure Holding AB <sup>*</sup>                 | 7,13 % | 01.02.2028            | 103.931              | 0,01                         |
| 4.000.000  | Virgin Money UK Plc <sup>*</sup>                 | 4,00 % | 18.03.2028            | 4.081.870            | 0,22                         |
| 2.600.000  | Vodafone Group Plc <sup>*</sup>                  | 3,00 % | 27.08.2080            | 2.458.975            | 0,13                         |
| 4.800.000  | Volkswagen Bank GmbH <sup>*</sup>                | 2,50 % | 31.07.2026            | 4.757.352            | 0,25                         |
| 3.000.000  | Volkswagen Financial Services AG <sup>*</sup>    | 0,25 % | 31.01.2025            | 2.993.325            | 0,16                         |
| 8.500.000  | Volkswagen Financial Services AG <sup>*</sup>    | 3,25 % | 19.05.2027            | 8.503.400            | 0,45                         |
| 5.501.000  | Volkswagen Financial Services AG <sup>*</sup>    | 3,75 % | 10.09.2026            | 5.566.143            | 0,30                         |
| 1.600.000  | Volkswagen International Finance NV <sup>*</sup> | 3,88 % | 29.03.2026            | 1.614.694            | 0,09                         |
| 4.500.000  | Volkswagen International Finance NV <sup>*</sup> | 4,38 % | 31.12.2149            | 4.152.009            | 0,22                         |
| 8.300.000  | Volkswagen Leasing GmbH <sup>*</sup>             | 3,63 % | 11.10.2026            | 8.378.279            | 0,45                         |
| 10.512.000   | Volkswagen Leasing GmbH <sup>*</sup>             | 4,50 % | 25.03.2026            | 10.685.771           | 0,57                         |
| 10.000.000   | Vonovia SE <sup>*</sup>                          | 0,63 % | 14.12.2029            | 8.825.505            | 0,47                         |
| 100.000  | VZ Vendor Financing II BV <sup>*</sup>           | 2,88 % | 15.01.2029            | 91.968               | 0,00                         |
| 10.000.000   | Warnermedia Holdings Inc <sup>*</sup>            | 4,30 % | 17.01.2030            | 10.080.000           | 0,54                         |
| 3.400.000  | Westlake Corp <sup>*</sup>                       | 1,63 % | 17.07.2029            | 3.175.974            | 0,17                         |
| 25.100.000   | Westpac Banking Corp <sup>*</sup>                | 3,46 % | 04.04.2025            | 25.135.598           | 1,34                         |
| 100.000  | Westpac Securities NZ Ltd <sup>*</sup>           | 1,78 % | 14.01.2026            | 99.249               | 0,00                         |
| 7.000.000  | Wizz Air Finance Co BV <sup>*</sup>              | 1,00 % | 19.01.2026            | 6.791.178            | 0,36                         |
| 100.000  | Zegona Finance Plc <sup>*</sup>                  | 6,75 % | 15.07.2029            | 106.705              | 0,01                         |
| 100.000  | ZF Europe Finance BV <sup>*</sup>                | 6,13 % | 13.03.2029            | 102.464              | 0,01                         |
| 4.800.000  | Ziggo Bond Co BV <sup>**</sup>                   | 6,13 % | 15.11.2032            | 4.836.000            | 0,26                         |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>  |  |        |                       | <b>1.372.639.876</b> | <b>72,99</b>                 |

## Short Duration Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag  | Wertpapierbezeichnung                             | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>EUR      | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|---|---|--------|-----------------------|----------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 4,98 % (31. Dezember 2023: 7,59 %)</b>  |   |        |                       |                      |                              |
| <b>Euro</b>   |   |        |                       |                      |                              |
| 4.400.000   | Bank Gospodarstwa Krajowego*                      | 3,88 % | 13.03.2035            | 4.388.366            | 0,23                         |
| 1.000.000   | Bank Gospodarstwa Krajowego*                      | 4,00 % | 08.09.2027            | 1.028.300            | 0,05                         |
| 1.400.000   | Bank Gospodarstwa Krajowego*                      | 4,38 % | 13.03.2039            | 1.421.172            | 0,08                         |
| 1.732.000   | Bulgaria Government International Bond*           | 3,63 % | 05.09.2032            | 1.774.295            | 0,09                         |
| 2.430.000   | Bulgaria Government International Bond*           | 4,38 % | 13.05.2031            | 2.601.467            | 0,14                         |
| 3.400.000   | Bulgaria Government International Bond*           | 4,50 % | 27.01.2033            | 3.697.951            | 0,20                         |
| 1.470.000   | Bulgaria Government International Bond*           | 4,88 % | 13.05.2036            | 1.616.662            | 0,09                         |
| 1.000.000   | Croatia Government International Bond*            | 3,38 % | 12.03.2034            | 1.031.623            | 0,05                         |
| 6.840.000   | Denmark Government International Bond*            | 2,25 % | 02.10.2026            | 6.839.019            | 0,36                         |
| 5.740.000   | European Stability Mechanism*                     | 2,38 % | 30.09.2027            | 5.750.956            | 0,31                         |
| 686.000   | European Union*                                   | 2,50 % | 04.12.2031            | 679.356              | 0,04                         |
| 1.292.000   | European Union*                                   | 4,00 % | 04.04.2044            | 1.413.037            | 0,08                         |
| 2.969.550   | French Republic Government Bond OAT*              | 0,10 % | 01.03.2028            | 2.893.453            | 0,15                         |
| 2.000.000   | French Republic Government Bond OAT*              | 1,25 % | 25.05.2034            | 1.695.654            | 0,09                         |
| 2.730.000   | Hellenic Republic Government Bond*                | 3,38 % | 15.06.2034            | 2.762.357            | 0,15                         |
| 1.570.000   | Hellenic Republic Government Bond*                | 4,13 % | 15.06.2054            | 1.632.616            | 0,09                         |
| 6.839.000   | Hellenic Republic Government Bond*                | 4,38 % | 18.07.2038            | 7.439.707            | 0,40                         |
| 6.954.796   | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**               | 1,40 % | 26.05.2025            | 6.943.042            | 0,37                         |
| 5.517.600   | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*                | 2,00 % | 14.03.2028            | 5.544.539            | 0,29                         |
| 3.100.000   | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**               | 3,45 % | 15.07.2027            | 3.173.655            | 0,17                         |
| 3.171.000   | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**               | 3,85 % | 01.02.2035            | 3.266.739            | 0,17                         |
| 1.350.000   | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**               | 4,15 % | 01.10.2039            | 1.399.140            | 0,07                         |
| 5.163.000   | Republic of Poland Government International Bond* | 3,13 % | 22.10.2031            | 5.197.697            | 0,28                         |
| 4.111.000   | Republic of Poland Government International Bond* | 3,88 % | 22.10.2039            | 4.141.761            | 0,22                         |
| 1.100.000   | Romanian Government International Bond*           | 3,62 % | 26.05.2030            | 1.034.306            | 0,05                         |
| 3.048.000   | Romanian Government International Bond*           | 5,25 % | 30.05.2032            | 2.980.600            | 0,16                         |
| 913.000   | Romanian Government International Bond*           | 5,63 % | 22.02.2036            | 877.720              | 0,05                         |
| 6.520.000   | Romanian Government International Bond*           | 6,38 % | 18.09.2033            | 6.804.981            | 0,36                         |
| 1.200.000   | Romanian Government International Bond*           | 6,63 % | 27.09.2029            | 1.294.871            | 0,07                         |
| 2.232.000   | Slovakia Government Bond*                         | 3,75 % | 06.03.2034            | 2.299.555            | 0,12                         |
| <b>Staatsanleihen insgesamt</b>                           |   |        |                       | <b>93.624.597</b>    | <b>4,98</b>                  |
| <b>Investmentfonds 1,80 % (31. Dezember 2023: 0,00 %)</b> |   |        |                       |                      |                              |
| <b>Euro</b>   |   |        |                       |                      |                              |
| 1.810.000   | Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return        |        |                       | 19.149.800           | 1,02                         |
| 1.410.000   | Neuberger Berman Euro Bond Fund                   |        |                       | 14.805.000           | 0,78                         |
| <b>Investmentfonds insgesamt <sup>1)</sup></b>            |   |        |                       | <b>33.954.800</b>    | <b>1,80</b>                  |
| <b>Anlagen insgesamt</b>                                  |   |        |                       | <b>1.776.607.763</b> | <b>94,47</b>                 |

## Short Duration Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 0,08 % (31. Dezember 2023: 0,03 %)

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn EUR | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|-------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i>   |                     |                  |                             |           |                               |                      |
| 57.033 CHF  | 60.792 €            | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 3         | 42                            | 0,00                 |
| 62.422 €  | 58.026 CHF          | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 5         | 529                           | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen USD</i>   |                     |                  |                             |           |                               |                      |
| 26.520.771 US\$   | 24.057.669 €        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 3         | 1.540.271                     | 0,08                 |
| 46.382 US\$   | 41.787 €            | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 2         | 2.982                         | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>1.543.824</b>              | <b>0,08</b>          |

### Futures-Kontrakte 0,14 % (31. Dezember 2023: 0,05 %)

| Anzahl Kontrakte   | Beschreibung                             | Nicht realisierter Gewinn EUR | % des Nettovermögens |                             |
|--|--|-------------------------------|----------------------|-----------------------------|
| (348)  | Euro-BOBL Future March 2025              | 403.680                       | 0,02                 |                             |
| (508)  | Euro-Bund Future March 2025              | 1.524.000                     | 0,08                 |                             |
| (57)   | Euro-Buxl 30-Year Bond Future March 2025 | 449.160                       | 0,03                 |                             |
| (96)   | Euro-OAT Future March 2025               | 164.980                       | 0,01                 |                             |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten <sup>*</sup></b>                             |  | <b>2.541.820</b>              | <b>0,14</b>          |                             |
|  |  |                               | <b>Zeitwert EUR</b>  | <b>% des Nettovermögens</b> |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |  |                               | <b>1.780.693.407</b> | <b>94,69</b>                |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (0,08 %) (31. Dezember 2023: (0,25 %))

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust EUR | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 5.541.648 CHF  | 5.930.419 €         | 16.01.2025       | Citibank NA                 | 1         | (19.435)                       | (0,00)               |
| 266.655 CHF  | 286.858 €           | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 8         | (2.430)                        | (0,00)               |
| 216.349 €  | 203.015 CHF         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | (197)                          | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen USD</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 22.279.048 €   | 24.560.890 US\$     | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (1.427.208)                    | (0,08)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>(1.449.270)</b>             | <b>(0,08)</b>        |

### Futures-Kontrakte (0,05 %) (31. Dezember 2023: (0,28 %))

| Anzahl Kontrakte  | Beschreibung                  | Nicht realisierter Verlust EUR | % des Nettovermögens |
|---|-------------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 279   | Euro-BOBL Future March 2025   | (326.430)                      | (0,02)               |
| 69  | Euro-BTP Future March 2025    | (179.810)                      | (0,01)               |
| 1.635   | Euro-Schatz Future March 2025 | (490.500)                      | (0,02)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten <sup>*</sup></b> |                               | <b>(996.740)</b>               | <b>(0,05)</b>        |

## Short Duration Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Credit-Default-Swap-Kontrakten 0,13 % (31. Dezember 2023: (0,22 %))

|  | Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei                 | Referenzverbindlichkeit                                     | Zeitwert<br>EUR    | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|-------------|------------|-----------------------------|---|--------------------|------------------------------|
| EUR  | 31.200.000  | 20.12.2029 | ICE Clear U.S. <sup>1</sup> | Buying default protection on iTRAXX Europe Crossover S42.V1 | (2.448.213)        | (0,13)                       |
| <b>Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt *</b> |             |            |                             |   | <b>(2.448.213)</b> | <b>(0,13)</b>                |

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

### Zinsswap-Kontrakte (0,01 %) (31. Dezember 2023: (0,03 %))

|   | Nominalwert | Fälligkeit | Gegenpartei                    | Erhalt/(Zahlung) <sup>#</sup> | Fester<br>Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht<br>realisierter<br>Verlust EUR | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|---|-------------|------------|--------------------------------|-------------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------------|------------------------------|
| EUR   | 12.479.054  | 30.08.2032 | LCH Clearenet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)                     | 2,22 %             | 6M EURIBOR         | (97.029)                             | (0,01)                       |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Zinsswapkontrakten <sup>∞</sup></b> |             |            |                                |                               |                    |                    | <b>(97.029)</b>                      | <b>(0,01)</b>                |

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

|   | Zeitwert<br>EUR      | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|---|----------------------|------------------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(4.991.252)</b>   | <b>(0,27)</b>                |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>1.775.702.155</b> | <b>94,42</b>                 |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>104.920.227</b>   | <b>5,58</b>                  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>1.880.622.382</b> | <b>100,00</b>                |

| Portfolioanalyse         |   | Zeitwert<br>EUR      | % des<br>Gesamtver-<br>mögens |
|--------------------------|---|----------------------|-------------------------------|
| *                        | Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 1.360.026.816        | 71,57                         |
| **                       | Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden             | 382.626.147          | 20,14                         |
| μ                        | Investmentfonds   | 33.954.800           | 1,79                          |
| ±                        | Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden                          | 1.545.080            | 0,08                          |
| ∞                        | OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap                            | (2.450.688)          | (0,13)                        |
| <b>Anlagen insgesamt</b> |   | <b>1.775.702.155</b> | <b>93,45</b>                  |

## Short Duration High Yield Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 90,03 % (31. Dezember 2023: 89,20 %)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 1.685.000  | 1011778 BC ULC/New Red Finance Inc**  | 4,00 % | 15.10.2030            | 1.508.484        | 0,28                         |
| 1.750.000  | 1011778 BC ULC/New Red Finance Inc**  | 4,38 % | 15.01.2028            | 1.673.138        | 0,31                         |
| 2.335.000  | AAR Escrow Issuer LLC**   | 6,75 % | 15.03.2029            | 2.370.054        | 0,43                         |
| 3.110.000  | Acadia Healthcare Co Inc**  | 5,00 % | 15.04.2029            | 2.912.508        | 0,53                         |
| 2.470.000  | Acadia Healthcare Co Inc**  | 5,50 % | 01.07.2028            | 2.369.832        | 0,43                         |
| 700.000  | Acrisure LLC/Acrisure Finance Inc**   | 7,50 % | 06.11.2030            | 721.535          | 0,13                         |
| 1.355.000  | Acrisure LLC/Acrisure Finance Inc**   | 8,25 % | 01.02.2029            | 1.404.479        | 0,26                         |
| 690.000  | Adient Global Holdings Ltd**  | 7,00 % | 15.04.2028            | 698.724          | 0,13                         |
| 2.050.000  | Ahead DB Holdings LLC**   | 6,63 % | 01.05.2028            | 2.011.570        | 0,37                         |
| 3.100.000  | Ahlstrom Holding 3 Oy*  | 4,88 % | 04.02.2028            | 2.955.753        | 0,54                         |
| 1.255.000  | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC**                   | 3,50 % | 15.03.2029            | 1.143.437        | 0,21                         |
| 715.000  | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC**                   | 5,88 % | 15.02.2028            | 712.640          | 0,13                         |
| 3.130.000  | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC**                   | 6,50 % | 15.02.2028            | 3.173.985        | 0,58                         |
| 1.085.000  | Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**                      | 5,88 % | 01.11.2029            | 1.047.672        | 0,19                         |
| 880.000  | Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**                      | 6,50 % | 01.10.2031            | 872.409          | 0,16                         |
| 2.815.000  | Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**                      | 6,75 % | 15.10.2027            | 2.794.563        | 0,51                         |
| 1.450.000  | Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**                      | 6,75 % | 15.04.2028            | 1.458.310        | 0,27                         |
| 2.455.000  | Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl**      | 4,63 % | 01.06.2028            | 2.323.274        | 0,43                         |
| 1.245.000  | Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl 144A** | 4,63 % | 01.06.2028            | 1.173.848        | 0,22                         |
| 2.635.000  | American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd**                                  | 5,50 % | 20.04.2026            | 2.628.564        | 0,48                         |
| 4.090.000  | American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd**                                  | 5,75 % | 20.04.2029            | 4.059.232        | 0,74                         |
| 3.745.000  | Amsted Industries Inc**   | 5,63 % | 01.07.2027            | 3.727.449        | 0,68                         |
| 2.380.000  | AmWINS Group Inc**  | 6,38 % | 15.02.2029            | 2.396.082        | 0,44                         |
| 725.000  | Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp**                        | 5,38 % | 15.06.2029            | 706.551          | 0,13                         |
| 1.260.000  | Aramark Services Inc**  | 5,00 % | 01.02.2028            | 1.225.554        | 0,22                         |
| 1.060.000  | Archrock Partners LP/Archrock Partners Finance Corp**                               | 6,25 % | 01.04.2028            | 1.055.012        | 0,19                         |
| 1.165.000  | Archrock Partners LP/Archrock Partners Finance Corp**                               | 6,88 % | 01.04.2027            | 1.172.142        | 0,22                         |
| 750.000  | Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc**         | 3,25 % | 01.09.2028            | 674.479          | 0,12                         |
| 850.000  | Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc**         | 4,00 % | 01.09.2029            | 731.122          | 0,13                         |
| 695.000  | Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc**         | 6,00 % | 15.06.2027            | 690.195          | 0,13                         |
| 575.000  | Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc**                              | 4,13 % | 15.08.2026            | 518.121          | 0,10                         |
| 735.000  | Arsenal AIC Parent LLC**  | 8,00 % | 01.10.2030            | 761.494          | 0,14                         |
| 1.650.000  | Artera Services LLC**   | 8,50 % | 15.02.2031            | 1.592.105        | 0,29                         |
| 1.240.000  | Asbury Automotive Group Inc**   | 4,63 % | 15.11.2029            | 1.155.703        | 0,21                         |
| 1.825.000  | Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**                              | 5,88 % | 30.06.2029            | 1.779.111        | 0,33                         |
| 4.585.000  | ASGN Inc**  | 4,63 % | 15.05.2028            | 4.358.591        | 0,80                         |
| 3.790.000  | AthenaHealth Group Inc**  | 6,50 % | 15.02.2030            | 3.605.564        | 0,66                         |
| 3.820.000  | ATI Inc*  | 5,88 % | 01.12.2027            | 3.789.594        | 0,70                         |
| 3.060.000  | ATS Corp**  | 4,13 % | 15.12.2028            | 2.847.785        | 0,52                         |

## Short Duration High Yield Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 90,03 % (31. Dezember 2023: 89,20 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 895.000  | Avantor Funding Inc**   | 4,63 %  | 15.07.2028            | 855.033          | 0,16                         |
| 400.000  | Axalta Coating Systems LLC**  | 3,38 %  | 15.02.2029            | 363.475          | 0,07                         |
| 1.130.000  | Axalta Coating Systems LLC/Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV**      | 4,75 %  | 15.06.2027            | 1.108.528        | 0,20                         |
| 1.500.000  | Azorra Finance Ltd**  | 7,75 %  | 15.04.2030            | 1.492.781        | 0,27                         |
| 1.560.000  | Bath & Body Works Inc*  | 5,25 %  | 01.02.2028            | 1.537.328        | 0,28                         |
| 1.020.000  | Bath & Body Works Inc*  | 7,50 %  | 15.06.2029            | 1.054.951        | 0,19                         |
| 3.405.000  | Bausch & Lomb Corp**  | 8,38 %  | 01.10.2028            | 3.528.431        | 0,65                         |
| 2.030.000  | Bausch Health Cos Inc**   | 4,88 %  | 01.06.2028            | 1.626.263        | 0,30                         |
| 1.435.000  | Bausch Health Cos Inc**   | 5,50 %  | 01.11.2025            | 1.401.001        | 0,26                         |
| 1.200.000  | Bausch Health Cos Inc**   | 6,13 %  | 01.02.2027            | 1.090.338        | 0,20                         |
| 1.530.000  | Bausch Health Cos Inc**   | 11,00 % | 30.09.2028            | 1.455.290        | 0,27                         |
| 2.140.000  | BCPE Empire Holdings Inc**  | 7,63 %  | 01.05.2027            | 2.134.872        | 0,39                         |
| 435.000  | Beacon Roofing Supply Inc**   | 4,13 %  | 15.05.2029            | 413.060          | 0,08                         |
| 705.000  | Beazer Homes USA Inc*   | 5,88 %  | 15.10.2027            | 696.440          | 0,13                         |
| 2.870.000  | Beazer Homes USA Inc**  | 7,25 %  | 15.10.2029            | 2.913.150        | 0,53                         |
| 1.960.000  | Benteler International AG**   | 10,50 % | 15.05.2028            | 2.062.429        | 0,38                         |
| 3.075.000  | Berry Global Inc**  | 5,63 %  | 15.07.2027            | 3.073.003        | 0,56                         |
| 1.005.000  | Blackstone Mortgage Trust Inc**   | 3,75 %  | 15.01.2027            | 958.114          | 0,18                         |
| 665.000  | Blackstone Mortgage Trust Inc**   | 7,75 %  | 01.12.2029            | 684.330          | 0,13                         |
| 1.305.000  | Blue Racer Midstream LLC/Blue Racer Finance Corp**                          | 6,63 %  | 15.07.2026            | 1.310.682        | 0,24                         |
| 535.000  | Blue Racer Midstream LLC/Blue Racer Finance Corp**                          | 7,00 %  | 15.07.2029            | 546.977          | 0,10                         |
| 3.050.000  | Bombardier Inc**  | 6,00 %  | 15.02.2028            | 3.040.235        | 0,56                         |
| 700.000  | Bombardier Inc**  | 7,50 %  | 01.02.2029            | 728.926          | 0,13                         |
| 630.244  | Borr IHC Ltd/Borr Finance LLC**   | 10,00 % | 15.11.2028            | 629.592          | 0,12                         |
| 2.360.000  | BroadStreet Partners Inc**  | 5,88 %  | 15.04.2029            | 2.295.317        | 0,42                         |
| 1.310.000  | Buckeye Partners LP**   | 4,13 %  | 01.12.2027            | 1.250.398        | 0,23                         |
| 555.000  | Buckeye Partners LP**   | 4,50 %  | 01.03.2028            | 529.197          | 0,10                         |
| 1.310.000  | Cablevision Lightpath LLC**   | 3,88 %  | 15.09.2027            | 1.246.426        | 0,23                         |
| 1.020.000  | Calderys Financing II LLC**   | 11,75 % | 01.06.2028            | 1.038.441        | 0,19                         |
| 2.130.000  | Calderys Financing LLC**  | 11,25 % | 01.06.2028            | 2.282.597        | 0,42                         |
| 1.205.000  | Camelot Return Merger Sub Inc**   | 8,75 %  | 01.08.2028            | 1.156.003        | 0,21                         |
| 1.500.000  | Carpenter Technology Corp*  | 6,38 %  | 15.07.2028            | 1.503.190        | 0,28                         |
| 731.625  | Carvana Co**  | 9,00 %  | 01.12.2028            | 781.894          | 0,14                         |
| 680.000  | Carvana Co**  | 13,00 % | 01.06.2030            | 747.301          | 0,14                         |
| 2.255.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                | 5,00 %  | 01.02.2028            | 2.175.486        | 0,40                         |
| 2.895.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                | 5,13 %  | 01.05.2027            | 2.847.132        | 0,52                         |
| 2.335.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                | 5,38 %  | 01.06.2029            | 2.235.251        | 0,41                         |
| 2.125.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                | 6,38 %  | 01.09.2029            | 2.109.193        | 0,39                         |
| 705.000  | Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co/Magnum Management Corp/Millennium Op** | 5,25 %  | 15.07.2029            | 678.186          | 0,12                         |

## Short Duration High Yield Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 90,03 % (31. Dezember 2023: 89,20 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 3.735.000  | Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co/Magnum Management Corp/Millennium Op** | 6,50 % | 01.10.2028            | 3.758.418        | 0,69                         |
| 2.865.000  | Champions Financing Inc**   | 8,75 % | 15.02.2029            | 2.796.696        | 0,51                         |
| 100.000  | Civitas Resources Inc**   | 5,00 % | 15.10.2026            | 98.774           | 0,02                         |
| 2.470.000  | Civitas Resources Inc**   | 8,38 % | 01.07.2028            | 2.568.352        | 0,47                         |
| 3.145.000  | Clear Channel Outdoor Holdings Inc**  | 5,13 % | 15.08.2027            | 3.030.862        | 0,56                         |
| 1.445.000  | Clear Channel Outdoor Holdings Inc**  | 9,00 % | 15.09.2028            | 1.519.470        | 0,28                         |
| 3.000.000  | Cleveland-Cliffs Inc**  | 6,88 % | 01.11.2029            | 2.971.261        | 0,55                         |
| 3.865.000  | Cloud Software Group Inc**  | 6,50 % | 31.03.2029            | 3.798.475        | 0,70                         |
| 1.005.000  | Clydesdale Acquisition Holdings Inc**                                       | 6,88 % | 15.01.2030            | 1.013.057        | 0,19                         |
| 1.960.000  | Community Health Systems Inc**  | 5,63 % | 15.03.2027            | 1.883.232        | 0,35                         |
| 2.800.000  | Comstock Resources Inc**  | 6,75 % | 01.03.2029            | 2.724.721        | 0,50                         |
| 1.725.000  | Comstock Resources Inc 144A**   | 6,75 % | 01.03.2029            | 1.683.311        | 0,31                         |
| 930.000  | Consolidated Communications Inc**   | 5,00 % | 01.10.2028            | 866.514          | 0,16                         |
| 2.725.000  | Consolidated Communications Inc**   | 6,50 % | 01.10.2028            | 2.628.585        | 0,48                         |
| 3.380.000  | Constellium SE**  | 5,63 % | 15.06.2028            | 3.321.921        | 0,61                         |
| 735.000  | Cornerstone Building Brands Inc**   | 9,50 % | 15.08.2029            | 716.264          | 0,13                         |
| 820.000  | Coty Inc/HFC Prestige Products Inc/HFC Prestige International US LLC**      | 4,75 % | 15.01.2029            | 782.186          | 0,14                         |
| 1.805.000  | CSC Holdings LLC**  | 5,50 % | 15.04.2027            | 1.617.496        | 0,30                         |
| 3.995.000  | Cushman & Wakefield US Borrower LLC**                                       | 6,75 % | 15.05.2028            | 4.002.364        | 0,73                         |
| 2.620.000  | Dealer Tire LLC/DT Issuer LLC**   | 8,00 % | 01.02.2028            | 2.576.490        | 0,47                         |
| 1.150.000  | Edgewell Personal Care Co**   | 5,50 % | 01.06.2028            | 1.126.608        | 0,21                         |
| 891.000  | Element Solutions Inc**   | 3,88 % | 01.09.2028            | 845.877          | 0,16                         |
| 830.000  | Ellucian Holdings Inc**   | 6,50 % | 01.12.2029            | 832.427          | 0,15                         |
| 2.625.000  | EnerSys**   | 4,38 % | 15.12.2027            | 2.519.932        | 0,46                         |
| 2.080.000  | EquipmentShare.com Inc**  | 9,00 % | 15.05.2028            | 2.160.263        | 0,40                         |
| 2.450.000  | Fortrea Holdings Inc**  | 7,50 % | 01.07.2030            | 2.457.127        | 0,45                         |
| 3.675.000  | Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC**                    | 5,50 % | 01.05.2028            | 3.612.541        | 0,66                         |
| 3.245.000  | Frontier Communications Holdings LLC**                                      | 5,88 % | 15.10.2027            | 3.237.212        | 0,59                         |
| 2.105.000  | Gap Inc**   | 3,63 % | 01.10.2029            | 1.892.298        | 0,35                         |
| 2.365.000  | Gates Corp**  | 6,88 % | 01.07.2029            | 2.408.677        | 0,44                         |
| 1.015.000  | Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp*                              | 7,75 % | 01.02.2028            | 1.017.182        | 0,19                         |
| 1.260.000  | GGAM Finance Ltd**  | 6,88 % | 15.04.2029            | 1.279.018        | 0,23                         |
| 2.600.000  | Global Aircraft Leasing Co Ltd**  | 8,75 % | 01.09.2027            | 2.654.967        | 0,49                         |
| 820.000  | Global Infrastructure Solutions Inc**                                       | 5,63 % | 01.06.2029            | 792.318          | 0,15                         |
| 1.130.000  | Goodyear Tire & Rubber Co**   | 4,88 % | 15.03.2027            | 1.092.613        | 0,20                         |
| 1.445.000  | Goodyear Tire & Rubber Co**   | 5,00 % | 31.05.2026            | 1.423.355        | 0,26                         |
| 3.020.000  | Goodyear Tire & Rubber Co**   | 5,00 % | 15.07.2029            | 2.776.419        | 0,51                         |
| 850.000  | Group 1 Automotive Inc**  | 6,38 % | 15.01.2030            | 853.823          | 0,16                         |
| 2.590.000  | Gulfport Energy Operating Corp**  | 6,75 % | 01.09.2029            | 2.611.293        | 0,48                         |
| 2.740.000  | GYP Holdings III Corp**   | 4,63 % | 01.05.2029            | 2.586.715        | 0,47                         |

## Short Duration High Yield Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 90,03 % (31. Dezember 2023: 89,20 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 2.585.000  | Harvest Midstream I LP**  | 7,50 %  | 01.09.2028            | 2.610.245        | 0,48                         |
| 595.000  | Heartland Dental LLC/Heartland Dental Finance Corp**                          | 10,50 % | 30.04.2028            | 631.567          | 0,12                         |
| 1.705.000  | Herc Holdings Inc**   | 5,50 %  | 15.07.2027            | 1.689.914        | 0,31                         |
| 775.000  | Herc Holdings Inc**   | 6,63 %  | 15.06.2029            | 785.485          | 0,14                         |
| 3.540.000  | Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co**                                      | 6,25 %  | 01.11.2028            | 3.431.320        | 0,63                         |
| 1.375.000  | Hillenbrand Inc*  | 6,25 %  | 15.02.2029            | 1.375.825        | 0,25                         |
| 1.430.000  | HUB International Ltd**   | 5,63 %  | 01.12.2029            | 1.388.218        | 0,25                         |
| 805.000  | Hudbay Minerals Inc**   | 4,50 %  | 01.04.2026            | 794.223          | 0,15                         |
| 525.000  | Hudbay Minerals Inc**   | 6,13 %  | 01.04.2029            | 527.545          | 0,10                         |
| 1.020.000  | IHO Verwaltungs GmbH**  | 7,75 %  | 15.11.2030            | 1.019.512        | 0,19                         |
| 2.655.000  | Iliad Holding SASU**  | 7,00 %  | 15.10.2028            | 2.692.742        | 0,49                         |
| 1.960.000  | Illuminate Buyer LLC/Illuminate Holdings IV Inc**                             | 9,00 %  | 01.07.2028            | 1.986.453        | 0,36                         |
| 1.975.000  | Imola Merger Corp**   | 4,75 %  | 15.05.2029            | 1.874.513        | 0,34                         |
| 2.520.000  | INEOS Finance Plc*  | 6,75 %  | 15.05.2028            | 2.547.261        | 0,47                         |
| 885.000  | INEOS Finance Plc**   | 7,50 %  | 15.04.2029            | 907.012          | 0,17                         |
| 785.000  | INEOS Quattro Finance 2 Plc**   | 9,63 %  | 15.03.2029            | 829.910          | 0,15                         |
| 2.325.000  | Intelligent Packaging Ltd Finco Inc/Intelligent Packaging Ltd Co-Issuer LLC** | 6,00 %  | 15.09.2028            | 2.294.254        | 0,42                         |
| 1.070.000  | Iron Mountain Inc**   | 5,25 %  | 15.03.2028            | 1.047.449        | 0,19                         |
| 3.775.000  | JELD-WEN Inc**  | 4,88 %  | 15.12.2027            | 3.590.932        | 0,66                         |
| 3.855.000  | Kaiser Aluminum Corp**  | 4,63 %  | 01.03.2028            | 3.628.921        | 0,67                         |
| 2.335.000  | Kinetik Holdings LP**   | 6,63 %  | 15.12.2028            | 2.390.407        | 0,44                         |
| 1.440.000  | Ladder Capital Finance Holdings LLLP/Ladder Capital Finance Corp**            | 4,25 %  | 01.02.2027            | 1.389.620        | 0,26                         |
| 1.570.000  | LCM Investments Holdings II LLC**   | 4,88 %  | 01.05.2029            | 1.468.088        | 0,27                         |
| 445.000  | Leeward Renewable Energy Operations LLC**                                     | 4,25 %  | 01.07.2029            | 407.811          | 0,07                         |
| 1.175.000  | Level 3 Financing Inc**   | 10,50 % | 15.04.2029            | 1.315.295        | 0,24                         |
| 1.943.053  | Level 3 Financing Inc**   | 11,00 % | 15.11.2029            | 2.188.206        | 0,40                         |
| 2.495.000  | LifePoint Health Inc**  | 4,38 %  | 15.02.2027            | 2.393.257        | 0,44                         |
| 1.340.000  | LifePoint Health Inc**  | 5,38 %  | 15.01.2029            | 1.176.291        | 0,22                         |
| 1.510.000  | Lindblad Expeditions Holdings Inc**   | 9,00 %  | 15.05.2028            | 1.581.471        | 0,29                         |
| 1.100.000  | Lindblad Expeditions LLC**  | 6,75 %  | 15.02.2027            | 1.106.348        | 0,20                         |
| 1.215.000  | Live Nation Entertainment Inc**   | 4,75 %  | 15.10.2027            | 1.175.701        | 0,22                         |
| 2.129.465  | Lumen Technologies Inc**  | 4,13 %  | 15.04.2029            | 1.931.792        | 0,35                         |
| 805.000  | Macy's Retail Holdings LLC**  | 5,88 %  | 01.04.2029            | 789.475          | 0,14                         |
| 1.055.000  | Madison IAQ LLC**   | 4,13 %  | 30.06.2028            | 999.579          | 0,18                         |
| 1.185.000  | Madison IAQ LLC**   | 5,88 %  | 30.06.2029            | 1.120.221        | 0,21                         |
| 465.000  | Magnera Corp**  | 7,25 %  | 15.11.2031            | 454.531          | 0,08                         |
| 825.000  | Mattamy Group Corp**  | 5,25 %  | 15.12.2027            | 807.310          | 0,15                         |
| 4.635.000  | Mauser Packaging Solutions Holding Co**                                       | 7,88 %  | 15.04.2027            | 4.734.467        | 0,87                         |
| 825.000  | Mauser Packaging Solutions Holding Co**                                       | 9,25 %  | 15.04.2027            | 838.337          | 0,15                         |
| 2.580.000  | McGraw-Hill Education Inc**   | 5,75 %  | 01.08.2028            | 2.521.907        | 0,46                         |

## Short Duration High Yield Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung  | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 90,03 % (31. Dezember 2023: 89,20 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 965.000  | McGraw-Hill Education Inc**  | 7,38 %  | 01.09.2031            | 988.820          | 0,18                         |
| 705.000  | McGraw-Hill Education Inc**  | 8,00 %  | 01.08.2029            | 705.882          | 0,13                         |
| 740.000  | Medline Borrower LP**  | 3,88 %  | 01.04.2029            | 685.911          | 0,13                         |
| 3.625.000  | Medline Borrower LP**  | 5,25 %  | 01.10.2029            | 3.501.801        | 0,64                         |
| 495.000  | Mercer International Inc**   | 12,88 % | 01.10.2028            | 533.463          | 0,10                         |
| 790.000  | Merlin Entertainments Ltd**  | 5,75 %  | 15.06.2026            | 784.077          | 0,14                         |
| 1.130.000  | MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp*                                 | 5,25 %  | 01.08.2026            | 1.041.434        | 0,19                         |
| 1.495.000  | Nationstar Mortgage Holdings Inc**   | 5,50 %  | 15.08.2028            | 1.452.858        | 0,27                         |
| 3.305.000  | Nationstar Mortgage Holdings Inc**   | 6,50 %  | 01.08.2029            | 3.302.822        | 0,61                         |
| 2.450.000  | NCL Corp Ltd**   | 8,13 %  | 15.01.2029            | 2.583.388        | 0,47                         |
| 595.000  | NCL Corp Ltd**   | 8,38 %  | 01.02.2028            | 622.579          | 0,11                         |
| 2.130.000  | Necessity Retail REIT Inc/American Finance Operating Partner LP**              | 4,50 %  | 30.09.2028            | 1.958.734        | 0,36                         |
| 210.000  | Neptune Bidco US Inc**   | 9,29 %  | 15.04.2029            | 195.558          | 0,04                         |
| 3.755.000  | New Fortress Energy Inc**  | 6,50 %  | 30.09.2026            | 3.617.026        | 0,66                         |
| 1.295.000  | Newell Brands Inc**  | 5,70 %  | 01.04.2026            | 1.295.568        | 0,24                         |
| 355.000  | Newell Brands Inc**  | 6,63 %  | 15.09.2029            | 361.669          | 0,07                         |
| 730.000  | NRG Energy Inc**   | 5,25 %  | 15.06.2029            | 709.583          | 0,13                         |
| 1.035.000  | NRG Energy Inc**   | 5,75 %  | 15.07.2029            | 1.011.319        | 0,19                         |
| 1.685.000  | Olympus Water US Holding Corp**  | 4,25 %  | 01.10.2028            | 1.576.047        | 0,29                         |
| 4.110.000  | Olympus Water US Holding Corp**  | 7,13 %  | 01.10.2027            | 4.186.956        | 0,77                         |
| 1.405.000  | Olympus Water US Holding Corp**  | 9,75 %  | 15.11.2028            | 1.492.484        | 0,27                         |
| 510.000  | OneMain Finance Corp*  | 3,50 %  | 15.01.2027            | 486.889          | 0,09                         |
| 900.000  | OneMain Finance Corp*  | 3,88 %  | 15.09.2028            | 830.120          | 0,15                         |
| 720.000  | OneMain Finance Corp*  | 5,38 %  | 15.11.2029            | 692.803          | 0,13                         |
| 2.360.000  | OneMain Finance Corp*  | 6,63 %  | 15.01.2028            | 2.391.058        | 0,44                         |
| 1.450.000  | OneMain Finance Corp*  | 6,63 %  | 15.05.2029            | 1.469.865        | 0,27                         |
| 990.000  | OneMain Finance Corp*  | 7,88 %  | 15.03.2030            | 1.033.721        | 0,19                         |
| 1.290.000  | Open Text Corp**   | 3,88 %  | 15.02.2028            | 1.216.305        | 0,22                         |
| 1.650.000  | Outfront Media Capital LLC/Outfront Media Capital Corp**                       | 4,25 %  | 15.01.2029            | 1.536.098        | 0,28                         |
| 10.000   | Paramount Global**   | 6,25 %  | 28.02.2057            | 9.566            | 0,00                         |
| 10.000   | Paramount Global**   | 6,38 %  | 30.03.2062            | 9.677            | 0,00                         |
| 830.000  | Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/PK Finance Co-Issuer** | 4,88 %  | 15.05.2029            | 781.892          | 0,14                         |
| 2.580.000  | Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/PK Finance Co-Issuer** | 5,88 %  | 01.10.2028            | 2.523.281        | 0,46                         |
| 1.005.000  | Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/PK Finance Co-Issuer** | 7,00 %  | 01.02.2030            | 1.020.737        | 0,19                         |
| 3.015.000  | Pebblebrook Hotel LP/PEB Finance Corp**  | 6,38 %  | 15.10.2029            | 2.987.275        | 0,55                         |
| 2.660.000  | PennyMac Financial Services Inc**  | 4,25 %  | 15.02.2029            | 2.467.154        | 0,45                         |
| 990.000  | PennyMac Financial Services Inc**  | 7,88 %  | 15.12.2029            | 1.038.161        | 0,19                         |
| 3.490.000  | Performance Food Group Inc**   | 5,50 %  | 15.10.2027            | 3.464.112        | 0,64                         |
| 865.000  | Permian Resources Operating LLC**  | 5,38 %  | 15.01.2026            | 860.465          | 0,16                         |
| 795.000  | Permian Resources Operating LLC**  | 5,88 %  | 01.07.2029            | 780.632          | 0,14                         |

## Short Duration High Yield Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung  | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 90,03 % (31. Dezember 2023: 89,20 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 2.460.000  | Perrigo Finance Unlimited Co*                                | 4,90 %  | 15.06.2030            | 2.307.291        | 0,42                         |
| 1.550.000  | PetSmart Inc/PetSmart Finance Corp**                         | 4,75 %  | 15.02.2028            | 1.464.216        | 0,27                         |
| 935.000  | PetSmart Inc/PetSmart Finance Corp**                         | 7,75 %  | 15.02.2029            | 904.964          | 0,17                         |
| 785.000  | Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**     | 5,75 %  | 15.04.2026            | 785.267          | 0,14                         |
| 4.835.000  | Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**     | 6,25 %  | 15.01.2028            | 4.814.058        | 0,88                         |
| 2.670.000  | Provident Funding Associates LP/PFG Finance Corp**           | 9,75 %  | 15.09.2029            | 2.746.004        | 0,50                         |
| 885.000  | Raven Acquisition Holdings LLC**                             | 6,88 %  | 15.11.2031            | 878.335          | 0,16                         |
| 2.970.000  | Resideo Funding Inc**  | 4,00 %  | 01.09.2029            | 2.692.899        | 0,49                         |
| 815.000  | RHP Hotel Properties LP/RHP Finance Corp**                   | 4,50 %  | 15.02.2029            | 770.955          | 0,14                         |
| 720.000  | RHP Hotel Properties LP/RHP Finance Corp**                   | 4,75 %  | 15.10.2027            | 697.077          | 0,13                         |
| 2.270.000  | RHP Hotel Properties LP/RHP Finance Corp**                   | 7,25 %  | 15.07.2028            | 2.342.272        | 0,43                         |
| 1.600.000  | Ritchie Bros Holdings Inc**                                  | 6,75 %  | 15.03.2028            | 1.637.824        | 0,30                         |
| 3.130.000  | RLJ Lodging Trust LP**                                       | 3,75 %  | 01.07.2026            | 3.046.530        | 0,56                         |
| 795.000  | RLJ Lodging Trust LP**                                       | 4,00 %  | 15.09.2029            | 721.076          | 0,13                         |
| 825.000  | Rockies Express Pipeline LLC**                               | 4,95 %  | 15.07.2029            | 783.900          | 0,14                         |
| 2.180.000  | SCIH Salt Holdings Inc**                                     | 4,88 %  | 01.05.2028            | 2.053.197        | 0,38                         |
| 2.890.000  | SCIL IV LLC/SCIL USA Holdings LLC**                          | 5,38 %  | 01.11.2026            | 2.833.754        | 0,52                         |
| 3.135.000  | SeaWorld Parks & Entertainment Inc**                         | 5,25 %  | 15.08.2029            | 2.994.349        | 0,55                         |
| 2.020.000  | Sirius XM Radio LLC**  | 4,00 %  | 15.07.2028            | 1.863.362        | 0,34                         |
| 1.030.000  | Sirius XM Radio LLC**  | 5,00 %  | 01.08.2027            | 1.002.620        | 0,18                         |
| 3.538.000  | Six Flags Entertainment Corp**                               | 5,50 %  | 15.04.2027            | 3.518.434        | 0,65                         |
| 2.385.000  | SNF Group SACA**   | 3,13 %  | 15.03.2027            | 2.256.373        | 0,41                         |
| 2.845.000  | Standard Industries Inc**                                    | 5,00 %  | 15.02.2027            | 2.786.474        | 0,51                         |
| 1.315.000  | Starwood Property Trust Inc**                                | 3,63 %  | 15.07.2026            | 1.270.145        | 0,23                         |
| 1.080.000  | Starwood Property Trust Inc**                                | 4,38 %  | 15.01.2027            | 1.045.051        | 0,19                         |
| 930.000  | Starwood Property Trust Inc**                                | 6,50 %  | 01.07.2030            | 931.785          | 0,17                         |
| 1.075.000  | Starwood Property Trust Inc**                                | 7,25 %  | 01.04.2029            | 1.104.083        | 0,20                         |
| 2.680.000  | Sunrise HoldCo IV BV**                                       | 5,50 %  | 15.01.2028            | 2.626.442        | 0,48                         |
| 1.690.000  | Surgery Center Holdings Inc**                                | 7,25 %  | 15.04.2032            | 1.726.072        | 0,32                         |
| 2.675.000  | Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp** | 5,50 %  | 15.01.2028            | 2.575.117        | 0,47                         |
| 595.000  | Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp** | 7,38 %  | 15.02.2029            | 597.458          | 0,11                         |
| 2.201.859  | Team Health Holdings Inc**                                   | 13,50 % | 30.06.2028            | 2.435.807        | 0,45                         |
| 2.830.000  | Tenet Healthcare Corp**                                      | 6,13 %  | 01.10.2028            | 2.827.283        | 0,52                         |
| 2.135.000  | Tenet Healthcare Corp**                                      | 6,25 %  | 01.02.2027            | 2.134.993        | 0,39                         |
| 2.670.000  | Terex Corp**   | 5,00 %  | 15.05.2029            | 2.544.843        | 0,47                         |
| 1.155.000  | TK Elevator Holdco GmbH**                                    | 7,63 %  | 15.07.2028            | 1.156.478        | 0,21                         |
| 1.785.000  | TK Elevator US Newco Inc**                                   | 5,25 %  | 15.07.2027            | 1.748.828        | 0,32                         |
| 2.645.000  | TMS International Corp**                                     | 6,25 %  | 15.04.2029            | 2.552.339        | 0,47                         |
| 1.435.000  | TransAlta Corp*  | 7,75 %  | 15.11.2029            | 1.497.634        | 0,27                         |
| 775.000  | TransDigm Inc*   | 4,63 %  | 15.01.2029            | 726.371          | 0,13                         |

## Short Duration High Yield Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 90,03 % (31. Dezember 2023: 89,20 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 2.775.000  | TransDigm Inc <sup>†</sup>  | 4,88 %  | 01.05.2029            | 2.622.769        | 0,48                         |
| 1.510.000  | TransDigm Inc <sup>†</sup>  | 5,50 %  | 15.11.2027            | 1.485.016        | 0,27                         |
| 2.180.000  | TransDigm Inc <sup>**</sup>   | 6,38 %  | 01.03.2029            | 2.187.568        | 0,40                         |
| 1.405.000  | TransDigm Inc <sup>**</sup>   | 6,75 %  | 15.08.2028            | 1.419.013        | 0,26                         |
| 790.000  | TreeHouse Foods Inc <sup>†</sup>  | 4,00 %  | 01.09.2028            | 718.400          | 0,13                         |
| 1.415.000  | Tri Pointe Homes Inc <sup>†</sup>   | 5,25 %  | 01.06.2027            | 1.392.228        | 0,26                         |
| 4.820.000  | Trivium Packaging Finance BV <sup>†</sup>                                 | 5,50 %  | 15.08.2026            | 4.769.366        | 0,87                         |
| 965.000  | TTM Technologies Inc <sup>**</sup>  | 4,00 %  | 01.03.2029            | 896.364          | 0,16                         |
| 2.745.000  | United Airlines Inc <sup>**</sup>   | 4,38 %  | 15.04.2026            | 2.701.159        | 0,50                         |
| 840.000  | Uniti Group LP/Uniti Group Finance 2019 Inc/CSL Capital LLC <sup>**</sup> | 4,75 %  | 15.04.2028            | 788.169          | 0,14                         |
| 4.230.000  | Uniti Group LP/Uniti Group Finance 2019 Inc/CSL Capital LLC <sup>**</sup> | 10,50 % | 15.02.2028            | 4.514.744        | 0,83                         |
| 3.245.000  | US Acute Care Solutions LLC <sup>**</sup>                                 | 9,75 %  | 15.05.2029            | 3.311.066        | 0,61                         |
| 855.000  | US Foods Inc <sup>**</sup>  | 4,75 %  | 15.02.2029            | 819.675          | 0,15                         |
| 2.395.000  | US Foods Inc <sup>**</sup>  | 6,88 %  | 15.09.2028            | 2.453.618        | 0,45                         |
| 1.970.000  | UWM Holdings LLC <sup>**</sup>  | 6,63 %  | 01.02.2030            | 1.959.711        | 0,36                         |
| 970.000  | Venture Global LNG Inc <sup>**</sup>                                      | 7,00 %  | 15.01.2030            | 985.466          | 0,18                         |
| 1.785.000  | Venture Global LNG Inc <sup>**</sup>                                      | 8,13 %  | 01.06.2028            | 1.858.279        | 0,34                         |
| 2.550.000  | Venture Global LNG Inc <sup>**</sup>                                      | 9,50 %  | 01.02.2029            | 2.820.022        | 0,52                         |
| 1.170.000  | Veritiv Operating Co <sup>**</sup>  | 10,50 % | 30.11.2030            | 1.261.529        | 0,23                         |
| 740.000  | VF Corp <sup>†</sup>  | 2,80 %  | 23.04.2027            | 693.841          | 0,13                         |
| 965.000  | Viking Cruises Ltd <sup>**</sup>  | 5,88 %  | 15.09.2027            | 960.908          | 0,18                         |
| 690.000  | Viking Cruises Ltd <sup>**</sup>  | 7,00 %  | 15.02.2029            | 694.483          | 0,13                         |
| 725.000  | Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd <sup>**</sup>                           | 5,63 %  | 15.02.2029            | 714.065          | 0,13                         |
| 1.610.000  | VistaJet Malta Finance Plc/Vista Management Holding Inc <sup>**</sup>     | 7,88 %  | 01.05.2027            | 1.568.974        | 0,29                         |
| 225.000  | VistaJet Malta Finance Plc/Vista Management Holding Inc <sup>**</sup>     | 9,50 %  | 01.06.2028            | 226.675          | 0,04                         |
| 3.760.000  | VM Consolidated Inc <sup>**</sup>   | 5,50 %  | 15.04.2029            | 3.662.246        | 0,67                         |
| 4.275.000  | VOC Escrow Ltd <sup>**</sup>  | 5,00 %  | 15.02.2028            | 4.181.351        | 0,77                         |
| 745.000  | Walgreens Boots Alliance Inc <sup>**</sup>                                | 3,45 %  | 01.06.2026            | 722.234          | 0,13                         |
| 760.000  | Walgreens Boots Alliance Inc <sup>**</sup>                                | 8,13 %  | 15.08.2029            | 753.210          | 0,14                         |
| 2.790.000  | WESCO Distribution Inc <sup>**</sup>                                      | 6,38 %  | 15.03.2029            | 2.830.777        | 0,52                         |
| 465.000  | White Cap Buyer LLC <sup>**</sup>   | 6,88 %  | 15.10.2028            | 462.266          | 0,08                         |
| 915.000  | White Cap Buyer LLC 144A <sup>**</sup>                                    | 6,88 %  | 15.10.2028            | 909.522          | 0,17                         |
| 2.610.000  | Williams Scotsman Inc <sup>**</sup>                                       | 4,63 %  | 15.08.2028            | 2.494.300        | 0,46                         |
| 2.000.000  | Williams Scotsman Inc <sup>**</sup>                                       | 6,63 %  | 15.06.2029            | 2.025.652        | 0,37                         |
| 635.000  | Windstream Services LLC/Windstream Escrow Finance Corp <sup>**</sup>      | 8,25 %  | 01.10.2031            | 656.585          | 0,12                         |
| 2.150.000  | WR Grace Holdings LLC <sup>**</sup>                                       | 4,88 %  | 15.06.2027            | 2.086.160        | 0,38                         |
| 1.615.000  | WR Grace Holdings LLC <sup>**</sup>                                       | 5,63 %  | 15.08.2029            | 1.487.145        | 0,27                         |
| 1.145.000  | Wyndham Hotels & Resorts Inc <sup>**</sup>                                | 4,38 %  | 15.08.2028            | 1.092.947        | 0,20                         |

## Short Duration High Yield Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung             | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|-----------------------------------|---------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 90,03 % (31. Dezember 2023: 89,20 %) (Fortsetzung)</b>             |                                   |         |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |                                   |         |                       |                    |                              |
| 750.000  | XHR LP**                          | 4,88 %  | 01.06.2029            | 708.163            | 0,13                         |
| 2.065.000  | XHR LP**                          | 6,63 %  | 15.05.2030            | 2.074.359          | 0,38                         |
| 2.915.000  | Zayo Group Holdings Inc**         | 4,00 %  | 01.03.2027            | 2.691.402          | 0,49                         |
| 2.370.000  | ZF North America Capital Inc**    | 4,75 %  | 29.04.2025            | 2.360.514          | 0,43                         |
| 835.000  | ZF North America Capital Inc**    | 6,88 %  | 14.04.2028            | 833.327            | 0,15                         |
| 1.565.000  | Ziff Davis Inc**                  | 4,63 %  | 15.10.2030            | 1.440.271          | 0,26                         |
| 745.000  | Ziggo BV*                         | 4,88 %  | 15.01.2030            | 685.876            | 0,13                         |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>  |                                   |         |                       | <b>490.955.600</b> | <b>90,03</b>                 |
| <b>Mittelfristige Schuldverschreibungen<sup>^</sup> 7,88 % (31. Dezember 2023: 1,80 %)</b> |                                   |         |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |                                   |         |                       |                    |                              |
| 1.821.224  | Ascend Learning LLC               | 7,96 %  | 11.12.2028            | 1.833.326          | 0,34                         |
| 3.675.630  | Aveanna Healthcare LLC            | 8,36 %  | 17.07.2028            | 3.651.058          | 0,67                         |
| 725.000  | Aveanna Healthcare LLC            | 11,66 % | 10.12.2029            | 701.438            | 0,13                         |
| 1.735.639  | Champions Holdco Inc              | 9,27 %  | 23.02.2029            | 1.648.319          | 0,30                         |
| 1.755.487  | Cloudera Inc                      | 8,21 %  | 08.10.2028            | 1.754.118          | 0,32                         |
| 1.725.000  | Consolidated Communications Inc   | 7,97 %  | 02.10.2027            | 1.710.519          | 0,31                         |
| 1.810.298  | Cornerstone Building Brands Inc   | 7,75 %  | 12.04.2028            | 1.733.813          | 0,32                         |
| 860.000  | Cornerstone Generation LLC        | 0,00 %  | 28.10.2031            | 868.600            | 0,16                         |
| 224.138  | Covia Holdings LLC                | 0,00 %  | 31.07.2026            | 223.970            | 0,04                         |
| 2.311.824  | Engineered Machinery Holdings Inc | 10,59 % | 21.05.2029            | 2.323.383          | 0,43                         |
| 684.282  | Gen Digital Inc                   | 6,11 %  | 12.09.2029            | 682.950            | 0,13                         |
| 2.470.000  | Glatfelter Corp                   | 8,76 %  | 04.11.2031            | 2.478.744          | 0,46                         |
| 1.836.357  | Ineos Quattro Holdings UK Ltd     | 8,21 %  | 14.03.2030            | 1.844.400          | 0,34                         |
| 395.015  | Ingram Micro Inc                  | 7,08 %  | 22.09.2031            | 397.730            | 0,07                         |
| 1.465.219  | ITT Holdings LLC                  | 7,11 %  | 11.10.2030            | 1.476.024          | 0,27                         |
| 1.103.564  | Madison IAQ LLC                   | 7,89 %  | 21.06.2028            | 1.108.911          | 0,20                         |
| 2.328.725  | Medline Borrower LP               | 6,61 %  | 23.10.2028            | 2.339.576          | 0,43                         |
| 71.869   | National Mentor Holdings Inc      | 8,18 %  | 02.03.2028            | 71.364             | 0,01                         |
| 2.480.578  | National Mentor Holdings Inc      | 8,20 %  | 02.03.2028            | 2.463.127          | 0,45                         |
| 1.550.800  | Nautilus Power LLC                | 9,84 %  | 16.11.2026            | 1.545.814          | 0,28                         |
| 1.994.811  | Neptune BidCo US Inc              | 9,76 %  | 11.04.2029            | 1.795.689          | 0,33                         |
| 2.079.044  | Parexel International Inc         | 7,36 %  | 15.11.2028            | 2.095.936          | 0,38                         |
| 1.077.279  | Petco Health and Wellness Co Inc  | 7,84 %  | 03.03.2028            | 1.048.774          | 0,19                         |
| 3.697.063  | Star Parent Inc                   | 8,33 %  | 27.09.2030            | 3.618.038          | 0,66                         |
| 1.710.000  | Verde Purchaser LLC               | 0,00 %  | 30.11.2030            | 1.717.481          | 0,32                         |
| 1.845.281  | White Cap Supply Holdings LLC     | 7,61 %  | 19.10.2029            | 1.851.121          | 0,34                         |
| <b>Mittelfristige Schuldverschreibungen insgesamt<sup>+</sup></b>                          |                                   |         |                       | <b>42.984.223</b>  | <b>7,88</b>                  |

## Short Duration High Yield Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-betrag  | Wertpapierbezeichnung   | Kupon  | Fälligkeits-datum | Zeitwert US\$     | % des Nettover-mögens |
|---|---|--------|-------------------|-------------------|-----------------------|
| <b>Pensionsgeschäfte 2,93 % (31. Dezember 2023: 0,00 %)</b> |   |        |                   |                   |                       |
| <b>US-Dollar</b>  |   |        |                   |                   |                       |
| 16.000.000  | State Street Bank and Trust Co, repurchase value US\$ 16,003,938 <sup>^</sup> | 4,43 % | 02.01.2025        | 16.000.000        | 2,93                  |
| <b>Pensionsgeschäfte insgesamt <sup>†</sup></b>             |   |        |                   | <b>16.000.000</b> | <b>2,93</b>           |

<sup>^</sup> Besichert über US-Schatz-/Staatsanleihen mit einem Wert von insgesamt USD 16.320.095.

| Anzahl der Anteile  | Wertpapierbezeichnung             | Zeitwert US\$      | % des Nettover-mögens |
|---|-----------------------------------|--------------------|-----------------------|
| <b>Investmentfonds 0,94 % (31. Dezember 2023: 0,03 %)</b> |                                   |                    |                       |
| <b>Britisches Pfund</b>                                   |                                   |                    |                       |
| 34.770  | NB Global Monthly Income Fund Ltd | 25.039             | 0,01                  |
| <b>Britisches Pfund insgesamt</b>                         |                                   | <b>25.039</b>      | <b>0,01</b>           |
| <b>US-Dollar</b>  |                                   |                    |                       |
| 303.860   | Neuberger Berman CLO Income Fund  | 5.086.623          | 0,93                  |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>                                |                                   | <b>5.086.623</b>   | <b>0,93</b>           |
| <b>Investmentfonds insgesamt <sup>‡</sup></b>             |                                   | <b>5.111.662</b>   | <b>0,94</b>           |
| <b>Anlagen insgesamt</b>                                  |                                   | <b>555.051.485</b> | <b>101,78</b>         |

### Devisenterminkontrakte 1,09 % (31. Dezember 2023: 2,05 %)

| Geforderter Betrag              | Zu zahlender Betrag | Fälligkeits-datum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettover-mögens |
|---------------------------------|---------------------|-------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|-----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> |                     |                   |                             |           |                                |                       |
| 3.277 US\$                      | 4.809 AUD           | 16.01.2025        | Goldman Sachs International | 2         | 299                            | 0,00                  |
| 36.709 US\$                     | 54.580 AUD          | 16.01.2025        | UBS AG                      | 2         | 2.916                          | 0,00                  |
| 14.721 US\$                     | 23.487 AUD          | 16.01.2025        | Westpac Banking Corp        | 1         | 178                            | 0,00                  |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i> |                     |                   |                             |           |                                |                       |
| 5.499 US\$                      | 4.890 CHF           | 16.01.2025        | UBS AG                      | 1         | 95                             | 0,00                  |
| 960.405 US\$                    | 813.881 CHF         | 16.01.2025        | Westpac Banking Corp        | 1         | 60.985                         | 0,01                  |
| <i>Abgesicherte Klassen CNY</i> |                     |                   |                             |           |                                |                       |
| 78.529 US\$                     | 550.711 CNY         | 16.01.2025        | UBS AG                      | 2         | 3.518                          | 0,00                  |
| 6.925 US\$                      | 49.007 CNY          | 16.01.2025        | Westpac Banking Corp        | 4         | 249                            | 0,00                  |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> |                     |                   |                             |           |                                |                       |
| 392.589 US\$                    | 375.439 €           | 16.01.2025        | Goldman Sachs International | 1         | 3.615                          | 0,00                  |
| 837.852 US\$                    | 778.137 €           | 16.01.2025        | UBS AG                      | 2         | 31.663                         | 0,01                  |
| 99.309.709 US\$                 | 91.108.390 €        | 16.01.2025        | Westpac Banking Corp        | 67        | 4.916.824                      | 0,90                  |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> |                     |                   |                             |           |                                |                       |
| 83 £                            | 103 US\$            | 16.01.2025        | Westpac Banking Corp        | 2         | 0                              | 0,00                  |
| 1.056.581 US\$                  | 796.943 £           | 16.01.2025        | Goldman Sachs International | 1         | 58.604                         | 0,01                  |
| 1.070.081 US\$                  | 839.981 £           | 16.01.2025        | UBS AG                      | 2         | 18.209                         | 0,00                  |
| 24.372.434 US\$                 | 18.989.548 £        | 16.01.2025        | Westpac Banking Corp        | 12        | 592.635                        | 0,11                  |

## Short Duration High Yield Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 1,09 % (31. Dezember 2023: 2,05 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens        |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|-----------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen HKD</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 4.467 HKD  | 575 US\$            | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | 0                              | 0,00                        |
| 2.070 US\$   | 16.069 HKD          | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 3         | 2                              | 0,00                        |
| <i>Abgesicherte Klassen JPY</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 783.113 US\$   | 121.459.360 ¥       | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 2         | 9.057                          | 0,00                        |
| 818.214 US\$   | 119.728.157 ¥       | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | 55.191                         | 0,01                        |
| 3.710.599 US\$   | 558.939.999 ¥       | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 3         | 148.493                        | 0,03                        |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 22.569 US\$  | 29.033 SGD          | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | 1.275                          | 0,00                        |
| 23.960 US\$  | 32.407 SGD          | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | 191                            | 0,00                        |
| 499.828 US\$   | 652.934 SGD         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 18        | 20.938                         | 0,01                        |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>sm</sup></b>                       |                     |                  |                             |           | <b>5.924.937</b>               | <b>1,09</b>                 |
|  |                     |                  |                             |           | <b>Zeitwert US\$</b>           | <b>% des Nettovermögens</b> |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |                     |                  |                             |           | <b>560.976.422</b>             | <b>102,87</b>               |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (4,14 %) (31. Dezember 2023: (0,42 %))

| Geforderter Betrag              | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 10.054 €                        | 13.459 US\$         | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | (869)                           | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 2.287 AUD                       | 1.504 US\$          | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (88)                            | (0,00)               |
| 469.850 AUD                     | 316.495 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | (25.582)                        | (0,01)               |
| 2.006.449 AUD                   | 1.305.128 US\$      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 6         | (62.813)                        | (0,01)               |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i> |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 1.510.963 CHF                   | 1.782.984 US\$      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | (113.218)                       | (0,02)               |
| <i>Abgesicherte Klassen CNY</i> |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 2.502.143 CNY                   | 357.296 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | (16.487)                        | (0,00)               |
| 20.923 CNY                      | 2.960 US\$          | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 2         | (110)                           | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 736.908 €                       | 825.326 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (61.852)                        | (0,01)               |
| 146.154.045 €                   | 161.118.027 US\$    | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | (9.695.069)                     | (1,78)               |
| 4.025.653 €                     | 4.297.612 US\$      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 47        | (126.829)                       | (0,02)               |
| 1.108 US\$                      | 1.069 €             | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | (0)                             | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 343.746 €                       | 442.323 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (11.865)                        | (0,00)               |
| 64.458.797 €                    | 84.448.823 US\$     | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | (3.729.831)                     | (0,68)               |
| 14.827.279 €                    | 18.813.140 US\$     | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 48        | (245.573)                       | (0,05)               |

## Short Duration High Yield Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (4,14 %) (31. Dezember 2023: (0,42 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens        |
|---|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|-----------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen HKD</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                             |
| 829.716 HKD   | 106.912 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | (91)                            | (0,00)                      |
| 8.548 HKD   | 1.102 US\$          | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | (1)                             | (0,00)                      |
| 1.611 US\$  | 12.519 HKD          | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 2         | (1)                             | (0,00)                      |
| <i>Abgesicherte Klassen JPY</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                             |
| 17.620.767.950 ¥  | 120.425.832 US\$    | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (8.129.265)                     | (1,49)                      |
| 557.865.198 ¥   | 3.708.720 US\$      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 6         | (153.463)                       | (0,03)                      |
| 605.704 US\$  | 95.188.009 ¥        | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | (926)                           | (0,00)                      |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>   |                     |                  |                             |           |                                 |                             |
| 5.846.581 SGD   | 4.497.782 US\$      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 44        | (209.638)                       | (0,04)                      |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>                          |                     |                  |                             |           | <b>(22.583.571)</b>             | <b>(4,14)</b>               |
|   |                     |                  |                             |           | <b>Zeitwert US\$</b>            | <b>% des Nettovermögens</b> |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> |                     |                  |                             |           | <b>(22.583.571)</b>             | <b>(4,14)</b>               |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              |                     |                  |                             |           | <b>538.392.851</b>              | <b>98,73</b>                |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  |                     |                  |                             |           | <b>6.921.344</b>                | <b>1,27</b>                 |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   |                     |                  |                             |           | <b>545.314.195</b>              | <b>100,00</b>               |

<sup>^</sup> Schuldverschreibungen mit einem Zinssatz von 0,00 %, wurden zum 31. Dezember 2024 eventuell noch nicht abgerechnet und haben somit keinen gültigen Zinssatz. Die Zinssätze werden erst bei Abrechnung gültig.

| Portfolioanalyse         |   | US\$               | % des Gesamtvermögens |
|--------------------------|---|--------------------|-----------------------|
| *                        | Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 41.322.206         | 7,14                  |
| **                       | Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden             | 449.633.394        | 77,72                 |
| †                        | Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente  | 58.984.223         | 10,20                 |
| μ                        | Investmentfonds   | 5.111.662          | 0,88                  |
| ∞                        | OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente   | (16.658.634)       | (2,88)                |
| <b>Anlagen insgesamt</b> |   | <b>538.392.851</b> | <b>93,06</b>          |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag  | Wertpapierbezeichnung  | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Agency Bonds 0,02 % (31. Dezember 2023: 0,04 %)</b>                                      |  |         |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar</b>  |  |         |                       |                   |                              |
| 690.000   | Federal National Mortgage Association                                | 5,63 %  | 15.07.2037            | 739.410           | 0,02                         |
| <b>Agency Bonds insgesamt **</b>  |  |         |                       | <b>739.410</b>    | <b>0,02</b>                  |
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 25,57 % (31. Dezember 2023: 10,45 %)</b> |  |         |                       |                   |                              |
| <b>Euro</b>   |  |         |                       |                   |                              |
| 4.000.000   | Auto ABS Italian Stella Loans 2024-1 SRL Class B                     | 4,06 %  | 29.12.2036            | 4.158.746         | 0,09                         |
| 4.188.846   | Brignole CQ Series 2024 Class B                                      | 4,33 %  | 24.09.2040            | 4.353.919         | 0,09                         |
| 4.200.000   | Hill FL 2024-2 BV Series 2024-2FL Class C                            | 4,22 %  | 18.10.2032            | 4.357.415         | 0,09                         |
| 2.000.000   | Italian Stella Loans SRL Series 2024-2 Class C                       | 4,16 %  | 27.05.2039            | 2.076.337         | 0,05                         |
| 1.500.000   | Italian Stella Loans SRL Series 2024-2 Class D                       | 4,91 %  | 27.05.2039            | 1.557.234         | 0,03                         |
| 6.550.000   | Kinbane DAC Series 2024-RPL1X Class C                                | 5,26 %  | 26.01.2065            | 6.630.054         | 0,14                         |
| 2.200.000   | Kinbane DAC Series 2024-RPL2X Class C                                | 5,43 %  | 24.01.2063            | 2.286.358         | 0,05                         |
| 2.780.000   | Kinbane DAC Series 2024-RPL2X Class D                                | 6,03 %  | 24.01.2063            | 2.869.139         | 0,06                         |
| 6.700.000   | Miltonia Mortgage Finance SRL Series 1 Class B                       | 3,94 %  | 28.04.2062            | 6.925.591         | 0,15                         |
| 2.700.000   | Noria DE 2024 Series 2024-DE1 Class D                                | 4,50 %  | 25.02.2043            | 2.803.449         | 0,06                         |
| 3.200.000   | Pepper Iberia Consumer 2024 Series 2024-1 Class B                    | 4,15 %  | 25.04.2037            | 3.319.376         | 0,07                         |
| 1.900.000   | Quarzo SRL Series 2024-1 Class C                                     | 5,19 %  | 15.06.2041            | 1.989.070         | 0,04                         |
| 770.000   | Shamrock Residential DAC Series 2024-1X Class C                      | 5,09 %  | 24.12.2078            | 791.143           | 0,02                         |
| 2.580.000   | Shamrock Residential DAC Series 2024-1X Class D                      | 5,89 %  | 24.12.2078            | 2.660.925         | 0,06                         |
| 1.723.000   | Thunder Logistics DAC Series 2024-1X Class C                         | 6,01 %  | 17.11.2036            | 1.799.701         | 0,04                         |
| 2.980.000   | Thunder Logistics DAC Series 2024-1X Class D                         | 5,26 %  | 17.11.2036            | 3.108.977         | 0,07                         |
| <b>Euro insgesamt</b>   |  |         |                       | <b>51.687.434</b> | <b>1,11</b>                  |
| <b>Britisches Pfund</b>   |  |         |                       |                   |                              |
| 6.807.000   | Vantage Data Centers Jersey Borrower Spv Ltd Series 2024-1A Class A2 | 6,17 %  | 28.05.2039            | 8.682.511         | 0,19                         |
| <b>Britisches Pfund insgesamt</b>   |  |         |                       | <b>8.682.511</b>  | <b>0,19</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>  |  |         |                       |                   |                              |
| 7.150.000   | 1211 Avenue of the Americas Trust 2015-1211 Class A1A2               | 3,90 %  | 10.08.2035            | 7.057.585         | 0,15                         |
| 2.684.000   | 1211 Avenue of the Americas Trust 2015-1211 Class C                  | 4,14 %  | 10.08.2035            | 2.638.015         | 0,06                         |
| 2.000.000   | 1988 CLO 5 Ltd Series 2024-5X Class D1                               | 7,60 %  | 15.07.2037            | 2.041.850         | 0,04                         |
| 1.000.000   | 1988 CLO 5 Ltd Series 2024-5X Class E                                | 10,60 % | 15.07.2037            | 1.030.606         | 0,02                         |
| 2.370.900   | 321 Henderson Receivables I LLC Series 2007-1A Class A1              | 4,71 %  | 15.03.2042            | 2.249.490         | 0,05                         |
| 953.000   | ADMT 2024-NQM6 Class A1  | 5,67 %  | 25.01.2070            | 953.590           | 0,02                         |
| 7.442.000   | ADMT 2024-NQM6 Class A3  | 6,07 %  | 25.01.2070            | 7.447.857         | 0,16                         |
| 5.264.000   | ADMT 2024-NQM6 Class M1  | 6,57 %  | 25.01.2070            | 5.257.067         | 0,11                         |
| 2.000.000   | AGL CLO 9 Ltd Series 2020-9X Class DR                                | 7,84 %  | 20.04.2037            | 2.048.068         | 0,04                         |
| 2.000.000   | Bain Capital CLO 2024-1 Ltd Series 2024-1X Class E                   | 11,11 % | 16.04.2037            | 2.065.952         | 0,05                         |
| 7.000.000   | Bain Capital Credit CLO 2024-2 Ltd Series 2024-2X Class A1           | 5,82 %  | 15.07.2037            | 7.045.745         | 0,15                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag  | Wertpapierbezeichnung  | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|---|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 25,57 % (31. Dezember 2023: 10,45 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>  |  |         |                       |                  |                              |
| 1.000.000   | Bain Capital Credit CLO 2024-2 Ltd Series 2024-2X Class D1                 | 8,00 %  | 15.07.2037            | 1.026.181        | 0,02                         |
| 1.700.000   | Ballyrock CLO 14 Ltd Series 2020-14X Class A1AR                            | 5,67 %  | 20.07.2037            | 1.710.990        | 0,04                         |
| 3.884.128   | BANK 2017-BNK4 Class A3  | 3,36 %  | 15.05.2050            | 3.764.299        | 0,08                         |
| 7.381.000   | BANK 2017-BNK9 Class A4  | 3,54 %  | 15.11.2054            | 7.092.319        | 0,15                         |
| 5.882.500   | Bank of America Merrill Lynch Commercial Mortgage Trust 2017-BNK3 Class A4 | 3,57 %  | 15.02.2050            | 5.720.619        | 0,12                         |
| 5.220.000   | Benchmark 2018-B8 Mortgage Trust Class B                                   | 4,73 %  | 15.01.2052            | 4.834.791        | 0,10                         |
| 4.375.104   | BRAVO 2024-NQM6 Class A1   | 5,41 %  | 01.08.2064            | 4.358.344        | 0,09                         |
| 4.354.782   | BRAVO 2024-NQM6 Class A3   | 5,71 %  | 01.08.2064            | 4.333.440        | 0,09                         |
| 7.960.000   | BXP Trust 2017-GM Class C  | 3,42 %  | 13.06.2039            | 7.477.288        | 0,16                         |
| 5.200.000   | BXP Trust 2017-GM Class D  | 3,42 %  | 13.06.2039            | 4.835.950        | 0,10                         |
| 2.000.000   | Canyon CLO 2023-2 Ltd Series 2023-2X Class D                               | 7,90 %  | 15.05.2037            | 2.048.433        | 0,04                         |
| 1.500.000   | Canyon CLO 2023-2 Ltd Series 2023-2X Class E                               | 10,95 % | 15.05.2037            | 1.560.096        | 0,03                         |
| 885.007   | Carlyle Global Market Strategies CLO 2014-5 Ltd Series 2014-5X Class A1RR  | 5,70 %  | 15.07.2031            | 885.516          | 0,02                         |
| 3.412.000   | CD 2016-CD2 Mortgage Trust Class A4  | 3,53 %  | 10.11.2049            | 3.273.103        | 0,07                         |
| 11.097.001  | Chase Home Lending Mortgage Trust 2024-10 Class A4A                        | 5,50 %  | 25.10.2055            | 11.005.862       | 0,24                         |
| 8.119.000   | Chase Home Lending Mortgage Trust Series 2024-11 Class A4                  | 6,00 %  | 25.11.2055            | 8.161.703        | 0,18                         |
| 1.188.000   | Chase Home Lending Mortgage Trust Series 2024-11 Class A9                  | 6,30 %  | 25.11.2055            | 1.187.900        | 0,03                         |
| 2.750.000   | Chase Home Lending Mortgage Trust Series 2024-11 Class A9A                 | 6,00 %  | 25.11.2055            | 2.742.932        | 0,06                         |
| 1.916.166   | Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-375P Class A                      | 3,25 %  | 10.05.2035            | 1.883.226        | 0,04                         |
| 2.044.000   | Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-375P Class C                      | 3,52 %  | 10.05.2035            | 1.979.358        | 0,04                         |
| 970.000   | Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P8 Class C                        | 4,25 %  | 15.09.2050            | 829.554          | 0,02                         |
| 3.337.220   | COLT 2024-2 Mortgage Loan Trust Class A1                                   | 6,13 %  | 25.04.2069            | 3.357.701        | 0,07                         |
| 2.228.429   | COLT 2024-2 Mortgage Loan Trust Class A2                                   | 6,33 %  | 25.04.2069            | 2.239.814        | 0,05                         |
| 1.782.075   | COLT 2024-2 Mortgage Loan Trust Class A3                                   | 6,43 %  | 25.04.2069            | 1.791.870        | 0,04                         |
| 6.978.076   | COLT 2024-INV2 Mortgage Loan Trust Class A1                                | 6,42 %  | 25.05.2069            | 7.061.040        | 0,15                         |
| 1.345.425   | COMM 2012-CCRE4 Mortgage Trust Class A3                                    | 2,85 %  | 15.10.2045            | 1.251.680        | 0,03                         |
| 3.652.000   | COMM 2013-CCRE8 Mortgage Trust Class D                                     | 3,52 %  | 10.06.2046            | 3.598.401        | 0,08                         |
| 1.340.000   | COMM 2013-CCRE8 Mortgage Trust Class E                                     | 4,00 %  | 10.06.2046            | 1.314.374        | 0,03                         |
| 97.667  | COMM 2014-UBS3 Mortgage Trust Class XA                                     | 0,44 %  | 10.06.2047            | 1                | 0,00                         |
| 629.000   | COMM 2015-CCRE24 Mortgage Trust Class B                                    | 4,35 %  | 10.08.2048            | 614.658          | 0,01                         |
| 1.779.360   | COMM 2017-COR2 Mortgage Trust Class ASB                                    | 3,32 %  | 10.09.2050            | 1.743.491        | 0,04                         |
| 4.340.000   | Connecticut Avenue Securities Trust 2020-R01 Class 1B1                     | 7,93 %  | 25.01.2040            | 4.498.795        | 0,10                         |
| 6.400.000   | Connecticut Avenue Securities Trust 2020-R02 Class 2B1                     | 7,68 %  | 25.01.2040            | 6.560.253        | 0,14                         |
| 7.801.348   | Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01 Class 1B1                     | 7,67 %  | 25.10.2041            | 8.025.534        | 0,17                         |
| 8.554.000   | Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R03 Class 1B1                     | 7,32 %  | 25.12.2041            | 8.766.242        | 0,19                         |
| 7.538.000   | Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R01 Class 1B1                     | 7,72 %  | 25.12.2041            | 7.778.372        | 0,17                         |
| 3.725.000   | Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R01 Class 1M2                     | 6,47 %  | 25.12.2041            | 3.780.699        | 0,08                         |
| 12.371.000  | Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R02 Class 2B1                     | 9,07 %  | 25.01.2042            | 13.077.425       | 0,28                         |
| 1.855.652   | Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R02 Class 2M2                     | 7,57 %  | 25.01.2042            | 1.905.766        | 0,04                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag  | Wertpapierbezeichnung                                  | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|---|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 25,57 % (31. Dezember 2023: 10,45 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>  |  |         |                       |                  |                              |
| 8.544.000   | Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R03 Class 1M2 | 8,07 %  | 25.03.2042            | 8.978.956        | 0,19                         |
| 4.728.819   | Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R04 Class 1M2 | 7,67 %  | 25.03.2042            | 4.920.614        | 0,11                         |
| 7.838.000   | Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R08 Class 1B1 | 10,17 % | 25.07.2042            | 8.569.590        | 0,19                         |
| 609.000   | Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R08 Class 1M2 | 8,17 %  | 25.07.2042            | 642.936          | 0,01                         |
| 4.889.000   | Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R09 Class 2M2 | 9,31 %  | 25.09.2042            | 5.309.247        | 0,12                         |
| 9.258.320   | Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R02 Class 1B1 | 10,12 % | 25.01.2043            | 10.176.079       | 0,22                         |
| 5.075.000   | Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R04 Class 1B1 | 9,91 %  | 25.05.2043            | 5.588.968        | 0,12                         |
| 7.490.000   | Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R05 Class 1B1 | 9,31 %  | 25.06.2043            | 8.172.724        | 0,18                         |
| 6.910.000   | Connecticut Avenue Securities Trust 2024-R01 Class 1B1 | 7,27 %  | 25.01.2044            | 7.098.398        | 0,15                         |
| 6.553.000   | Connecticut Avenue Securities Trust 2024-R01 Class 1M2 | 6,37 %  | 25.01.2044            | 6.625.526        | 0,14                         |
| 2.583.000   | Cross 2024-H8 Mortgage Trust Class A1                  | 5,55 %  | 25.12.2069            | 2.588.062        | 0,06                         |
| 2.050.000   | Cross 2024-H8 Mortgage Trust Class A3                  | 5,96 %  | 25.12.2069            | 2.054.064        | 0,04                         |
| 1.115.000   | Cross 2024-H8 Mortgage Trust Class M1                  | 6,32 %  | 25.12.2069            | 1.116.880        | 0,02                         |
| 4.500.000   | CSAIL 2016-C7 Commercial Mortgage Trust Class A5       | 3,50 %  | 15.11.2049            | 4.345.494        | 0,09                         |
| 11.366.000  | CSAIL 2018-CX11 Commercial Mortgage Trust Class A5     | 4,03 %  | 15.04.2051            | 11.053.544       | 0,24                         |
| 1.465.000   | DBJPM 16-C1 Mortgage Trust Class A4                    | 3,28 %  | 10.05.2049            | 1.431.173        | 0,03                         |
| 2.800.593   | EFMT 2024-INV2 Class A3                                | 5,44 %  | 25.10.2069            | 2.769.855        | 0,06                         |
| 2.850.000   | EFMT 2024-INV2 Class M1                                | 5,73 %  | 25.10.2069            | 2.775.243        | 0,06                         |
| 7.409.000   | Eleven Madison Trust 2015-11MD Mortgage Trust Class A  | 3,55 %  | 10.09.2035            | 7.254.539        | 0,16                         |
| 1.130.000   | Eleven Madison Trust 2015-11MD Mortgage Trust Class D  | 3,55 %  | 10.09.2035            | 1.075.682        | 0,02                         |
| 3.818.105   | Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 1M2     | 7,03 %  | 25.01.2031            | 3.903.488        | 0,08                         |
| 8.000.000   | Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 2B1     | 7,87 %  | 25.11.2041            | 8.269.082        | 0,18                         |
| 843.836   | Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 2M2     | 6,88 %  | 25.08.2030            | 861.231          | 0,02                         |
| 2.899.280   | Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 2M2     | 7,23 %  | 25.12.2030            | 2.979.122        | 0,06                         |
| 3.163.740   | Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 2M2     | 7,65 %  | 25.02.2030            | 3.276.734        | 0,07                         |
| 3.542.454   | Fannie Mae Interest Strip Class C24                    | 4,00 %  | 25.08.2043            | 659.455          | 0,01                         |
| 2.367.697   | Fannie Mae Interest Strip Class C26                    | 4,00 %  | 25.10.2041            | 409.820          | 0,01                         |
| 10.755.647  | Fannie Mae Interest Strip Class C29                    | 3,37 %  | 25.05.2053            | 1.625.507        | 0,04                         |
| 5.353.945   | Fannie Mae REMICS Class AI                             | 3,50 %  | 25.11.2051            | 935.181          | 0,02                         |
| 24.534.251  | Fannie Mae REMICS Class DF                             | 5,57 %  | 25.10.2054            | 24.204.405       | 0,52                         |
| 19.685.962  | Fannie Mae REMICS Class FA                             | 5,67 %  | 25.03.2054            | 19.705.483       | 0,43                         |
| 23.546.796  | Fannie Mae REMICS Class FA                             | 5,67 %  | 25.10.2054            | 23.224.977       | 0,50                         |
| 2.677.246   | Fannie Mae REMICS Class FA                             | 5,87 %  | 25.07.2054            | 2.685.600        | 0,06                         |
| 19.266.978  | Fannie Mae REMICS Class FC                             | 5,52 %  | 25.10.2054            | 19.119.289       | 0,41                         |
| 7.362.453   | Fannie Mae REMICS Class FD                             | 5,57 %  | 25.03.2053            | 7.304.898        | 0,16                         |
| 14.239.558  | Fannie Mae REMICS Class FJ                             | 5,82 %  | 25.09.2054            | 14.253.787       | 0,31                         |
| 1.500.962   | Fannie Mae REMICS Class SB                             | 1,42 %  | 25.03.2046            | 100.996          | 0,00                         |
| 2.410.253   | Fannie Mae REMICS Class SN                             | 1,42 %  | 25.07.2049            | 219.688          | 0,01                         |
| 2.695.613   | Fannie Mae REMICS Class ST                             | 1,42 %  | 25.12.2044            | 294.630          | 0,01                         |
| 2.000.000   | Flatiron CLO 25 Ltd Series 2024-2A Class D             | 7,12 %  | 17.10.2037            | 2.041.261        | 0,04                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag  | Wertpapierbezeichnung  | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|---|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 25,57 % (31. Dezember 2023: 10,45 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>  |  |         |                       |                  |                              |
| 1.661.858   | Freddie Mac REMICS Class BI  | 4,50 %  | 25.02.2050            | 364.224          | 0,01                         |
| 7.756.531   | Freddie Mac REMICS Class DI  | 4,00 %  | 25.10.2048            | 1.538.955        | 0,03                         |
| 1.582.257   | Freddie Mac REMICS Class EC  | 1,50 %  | 25.02.2049            | 1.229.524        | 0,03                         |
| 8.502.962   | Freddie Mac REMICS Class EI  | 4,50 %  | 25.05.2050            | 1.717.862        | 0,04                         |
| 19.692.415  | Freddie Mac REMICS Class FA  | 5,77 %  | 25.09.2054            | 19.644.604       | 0,42                         |
| 10.827.124  | Freddie Mac REMICS Class FH  | 5,72 %  | 25.11.2054            | 10.772.643       | 0,23                         |
| 12.616.175  | Freddie Mac REMICS Class FJ  | 5,67 %  | 25.08.2054            | 12.628.073       | 0,27                         |
| 11.399.171  | Freddie Mac REMICS Class HI  | 3,50 %  | 25.07.2051            | 2.181.136        | 0,05                         |
| 7.384.416   | Freddie Mac REMICS Class IO  | 4,50 %  | 25.05.2050            | 1.470.794        | 0,03                         |
| 1.484.934   | Freddie Mac REMICS Class LI  | 4,00 %  | 25.12.2048            | 293.015          | 0,01                         |
| 944.403   | Freddie Mac REMICS Class SA  | 1,29 %  | 15.10.2046            | 110.160          | 0,00                         |
| 1.349.161   | Freddie Mac REMICS Class SA  | 1,44 %  | 15.03.2045            | 137.330          | 0,00                         |
| 10.000.000  | Freddie Mac Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-2 Class M2 | 4,00 %  | 25.08.2056            | 9.435.605        | 0,20                         |
| 8.581.000   | Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA6 Class B1                       | 7,97 %  | 25.10.2041            | 8.867.032        | 0,19                         |
| 8.092.000   | Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA7 Class B1                       | 8,22 %  | 25.11.2041            | 8.420.244        | 0,18                         |
| 8.045.000   | Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-HQA4 Class B1                       | 8,32 %  | 25.12.2041            | 8.321.817        | 0,18                         |
| 10.317.000  | Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA1 Class M2                       | 7,07 %  | 25.01.2042            | 10.515.369       | 0,23                         |
| 6.654.000   | Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA2 Class B1                       | 9,32 %  | 25.02.2042            | 7.004.130        | 0,15                         |
| 6.991.000   | Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA2 Class M2                       | 8,32 %  | 25.02.2042            | 7.339.982        | 0,16                         |
| 6.304.000   | Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA3 Class B1                       | 10,22 % | 25.04.2042            | 6.770.289        | 0,15                         |
| 8.965.162   | Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA3 Class M1B                      | 7,47 %  | 25.04.2042            | 9.293.325        | 0,20                         |
| 4.026.000   | Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA3 Class M2                       | 8,92 %  | 25.04.2042            | 4.294.612        | 0,09                         |
| 3.507.000   | Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA4 Class M1B                      | 7,92 %  | 25.05.2042            | 3.672.365        | 0,08                         |
| 6.250.000   | Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA4 Class M2                       | 9,82 %  | 25.05.2042            | 6.792.175        | 0,15                         |
| 963.000   | Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA5 Class M1B                      | 9,23 %  | 25.06.2042            | 1.033.721        | 0,02                         |
| 10.174.000  | Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA5 Class M2                       | 11,48 % | 25.06.2042            | 11.445.756       | 0,25                         |
| 8.300.000   | Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA6 Class M2                       | 10,32 % | 25.09.2042            | 9.227.465        | 0,20                         |
| 6.850.000   | Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-HQA1 Class B1                       | 11,57 % | 25.03.2042            | 7.527.069        | 0,16                         |
| 2.373.000   | Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-HQA1 Class M1B                      | 8,07 %  | 25.03.2042            | 2.482.578        | 0,05                         |
| 10.911.000  | Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-HQA1 Class M2                       | 9,82 %  | 25.03.2042            | 11.767.898       | 0,25                         |
| 2.635.000   | Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-HQA3 Class M1B                      | 8,12 %  | 25.08.2042            | 2.773.029        | 0,06                         |
| 5.320.000   | Freddie Mac STACR REMIC Trust 2024-DNA1 Class M2                       | 6,52 %  | 25.02.2044            | 5.396.837        | 0,12                         |
| 4.526.000   | Freddie Mac STACR REMIC Trust 2024-DNA3 Class M2                       | 6,02 %  | 25.10.2044            | 4.547.280        | 0,10                         |
| 6.172.000   | Freddie Mac STACR REMIC Trust 2024-HQA1 Class M2                       | 6,57 %  | 25.03.2044            | 6.273.315        | 0,14                         |
| 2.000.000   | GoldenTree Loan Management US CLO 19 Ltd Series 2024-19X Class D       | 7,69 %  | 20.04.2037            | 2.028.096        | 0,04                         |
| 1.500.000   | GoldenTree Loan Management US CLO 19 Ltd Series 2024-19X Class E       | 10,29 % | 20.04.2037            | 1.534.558        | 0,03                         |
| 1.000.000   | GoldenTree Loan Management US CLO 9 Ltd Series 2021-9X Class DR        | 7,64 %  | 20.04.2037            | 1.019.344        | 0,02                         |
| 1.500.000   | GoldenTree Loan Management US CLO 9 Ltd Series 2021-9X Class ER        | 10,59 % | 20.04.2037            | 1.541.864        | 0,03                         |
| 4.023.246   | Government National Mortgage Association Class AB                      | 1,00 %  | 20.07.2050            | 3.016.587        | 0,07                         |
| 8.641.162   | Government National Mortgage Association Class CI                      | 2,00 %  | 20.10.2050            | 1.040.185        | 0,02                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag  | Wertpapierbezeichnung  | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|---|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 25,57 % (31. Dezember 2023: 10,45 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>  |  |         |                       |                  |                              |
| 9.298.592   | Government National Mortgage Association Class F                       | 5,60 %  | 20.06.2054            | 9.314.730        | 0,20                         |
| 9.187.097   | Government National Mortgage Association Class F                       | 5,86 %  | 20.04.2054            | 9.190.146        | 0,20                         |
| 8.475.877   | Government National Mortgage Association Class FA                      | 5,75 %  | 20.04.2054            | 8.494.834        | 0,18                         |
| 8.161.269   | Government National Mortgage Association Class FL                      | 5,75 %  | 20.08.2053            | 8.217.482        | 0,18                         |
| 2.977.589   | Government National Mortgage Association Class HE                      | 2,00 %  | 20.06.2051            | 2.407.151        | 0,05                         |
| 11.749.250  | Government National Mortgage Association Class IE                      | 3,50 %  | 20.08.2051            | 2.247.818        | 0,05                         |
| 8.382.493   | Government National Mortgage Association Class IG                      | 3,50 %  | 20.10.2051            | 1.325.124        | 0,03                         |
| 3.407.347   | Government National Mortgage Association Class KA                      | 1,00 %  | 20.08.2050            | 2.558.782        | 0,06                         |
| 3.030.827   | Government National Mortgage Association Class NC                      | 1,50 %  | 20.07.2051            | 2.441.215        | 0,05                         |
| 8.890.897   | Government National Mortgage Association Class PI                      | 3,50 %  | 20.02.2052            | 1.181.437        | 0,03                         |
| 3.290.145   | Government National Mortgage Association Class WK                      | 1,00 %  | 20.06.2050            | 2.450.008        | 0,05                         |
| 167.241   | GS Mortgage Securities Trust 2014-GC26 Class XA                        | 0,47 %  | 10.11.2047            | 2                | 0,00                         |
| 8.539.289   | GS Mortgage Securities Trust 2015-GC30 Class XA                        | 0,68 %  | 10.05.2050            | 780              | 0,00                         |
| 2.583.000   | GS Mortgage Securities Trust 2015-GS1 Class AS                         | 4,04 %  | 10.11.2048            | 2.437.728        | 0,05                         |
| 1.250.000   | GS Mortgage Securities Trust 2016-GS2 Class B                          | 3,76 %  | 10.05.2049            | 1.213.497        | 0,03                         |
| 4.764.000   | GS Mortgage Securities Trust 2016-GS2 Class C                          | 4,70 %  | 10.05.2049            | 4.591.167        | 0,10                         |
| 2.514.000   | GS Mortgage Securities Trust 2016-GS4 Class B                          | 3,85 %  | 10.11.2049            | 2.272.715        | 0,05                         |
| 2.921.000   | GS Mortgage Securities Trust 2017-GS5 Class A4                         | 3,67 %  | 10.03.2050            | 2.811.304        | 0,06                         |
| 2.973.000   | GS Mortgage Securities Trust 2017-GS6 Class B                          | 3,87 %  | 10.05.2050            | 2.548.411        | 0,06                         |
| 1.895.129   | Hilton Grand Vacations Trust 2018-A Class A                            | 3,54 %  | 25.02.2032            | 1.884.983        | 0,04                         |
| 1.748.000   | Hilton USA Trust 2016-HHV Class C                                      | 4,19 %  | 05.11.2038            | 1.699.286        | 0,04                         |
| 1.000.000   | HPS Loan Management 2023-17 Ltd Series 2023-17X Class A                | 6,19 %  | 23.04.2036            | 1.004.679        | 0,02                         |
| 8.440.000   | Hudson Yards 2016-10HY Mortgage Trust Class A                          | 2,84 %  | 10.08.2038            | 8.123.638        | 0,18                         |
| 1.800.000   | Hudson Yards 2016-10HY Mortgage Trust Class C                          | 2,98 %  | 10.08.2038            | 1.716.636        | 0,04                         |
| 500.000   | Hudson Yards 2016-10HY Mortgage Trust Class E                          | 2,98 %  | 10.08.2038            | 466.047          | 0,01                         |
| 1.000.000   | Invesco US CLO 2023-1 Ltd Series 2023-1X Class DR                      | 8,14 %  | 22.04.2037            | 1.024.361        | 0,02                         |
| 2.000.000   | Invesco US CLO 2023-1 Ltd Series 2023-1X Class ER                      | 11,19 % | 22.04.2037            | 2.080.902        | 0,05                         |
| 2.000.000   | Invesco US CLO 2024-1 Ltd Series 2024-1RX Class D1R                    | 8,05 %  | 15.04.2037            | 2.048.523        | 0,04                         |
| 2.000.000   | Invesco US CLO 2024-1 Ltd Series 2024-1RX Class ER                     | 11,70 % | 15.04.2037            | 2.049.647        | 0,04                         |
| 2.000.000   | Invesco US CLO 2024-2 Ltd Series 2024-2X Class D                       | 7,90 %  | 15.07.2037            | 2.048.509        | 0,04                         |
| 2.000.000   | Invesco US CLO 2024-2 Ltd Series 2024-2X Class E                       | 10,95 % | 15.07.2037            | 2.077.595        | 0,05                         |
| 10.394.000  | JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2016-NINE Class A | 2,85 %  | 06.09.2038            | 9.998.868        | 0,22                         |
| 2.500.000   | JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2016-NINE Class B | 2,85 %  | 06.09.2038            | 2.388.130        | 0,05                         |
| 3.445.673   | JP Morgan Mortgage Trust 2023-HE3 Class A1                             | 6,20 %  | 25.05.2054            | 3.477.223        | 0,08                         |
| 4.135.000   | JP Morgan Mortgage Trust 2023-HE3 Class M1                             | 6,70 %  | 25.05.2054            | 4.179.142        | 0,09                         |
| 321.000   | JP Morgan Mortgage Trust 2023-HE3 Class M2                             | 7,10 %  | 25.05.2054            | 325.639          | 0,01                         |
| 2.509.429   | JP Morgan Mortgage Trust 2024-HE1 Class A1                             | 6,10 %  | 25.08.2054            | 2.525.540        | 0,06                         |
| 1.358.000   | JP Morgan Mortgage Trust 2024-HE1 Class M1                             | 6,60 %  | 25.08.2054            | 1.365.630        | 0,03                         |
| 1.032.000   | JP Morgan Mortgage Trust 2024-HE1 Class M2                             | 7,00 %  | 25.08.2054            | 1.040.287        | 0,02                         |
| 8.468.663   | JP Morgan Mortgage Trust 2024-HE2 Class A1                             | 5,80 %  | 20.10.2054            | 8.493.809        | 0,18                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag  | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|---|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 25,57 % (31. Dezember 2023: 10,45 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>  |   |         |                       |                  |                              |
| 2.249.000   | JP Morgan Mortgage Trust 2024-HE2 Class M1                          | 6,30 %  | 20.10.2054            | 2.259.786        | 0,05                         |
| 3.900.000   | JPMCC Commercial Mortgage Securities Trust 2017-JP7 Class A5        | 3,45 %  | 15.09.2050            | 3.730.211        | 0,08                         |
| 1.113.000   | JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust 2017-C7 Class A5         | 3,41 %  | 15.10.2050            | 1.055.945        | 0,02                         |
| 7.000.000   | Katayma CLO II Ltd Series 2024-2X Class A1                          | 5,94 %  | 20.04.2037            | 7.031.697        | 0,15                         |
| 3.000.000   | Katayma CLO II Ltd Series 2024-2X Class D                           | 8,79 %  | 20.04.2037            | 3.077.053        | 0,07                         |
| 106.191   | Laurel Road Prime Student Loan Trust 2017-B Class BFX               | 3,02 %  | 25.08.2042            | 105.742          | 0,00                         |
| 2.433.000   | MetroNet Infrastructure Issuer LLC Series 2022-1A Class A2          | 6,35 %  | 20.10.2052            | 2.478.237        | 0,05                         |
| 4.005.000   | MetroNet Infrastructure Issuer LLC Series 2024-1A Class A2          | 6,23 %  | 20.04.2054            | 4.090.371        | 0,09                         |
| 3.809.000   | MetroNet Infrastructure Issuer LLC Series 2024-1A Class B           | 7,59 %  | 20.04.2054            | 3.921.958        | 0,09                         |
| 1.200.000   | Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2017-C33 Class C | 4,56 %  | 15.05.2050            | 1.129.103        | 0,02                         |
| 2.236.500   | Morgan Stanley Capital I Trust 2016-UBS12 Class ASB                 | 3,44 %  | 15.12.2049            | 2.212.436        | 0,05                         |
| 2.726.000   | Morgan Stanley Capital I Trust 2017-H1 Class C                      | 4,28 %  | 15.06.2050            | 2.435.627        | 0,05                         |
| 3.866.000   | Morgan Stanley Capital I Trust 2018-H3 Class C                      | 4,85 %  | 15.07.2051            | 3.589.210        | 0,08                         |
| 5.000.000   | Morgan Stanley Capital I Trust 2018-H4 Class A4                     | 4,31 %  | 15.12.2051            | 4.849.342        | 0,11                         |
| 2.340.000   | Morgan Stanley Capital I Trust 2018-H4 Class C                      | 5,05 %  | 15.12.2051            | 2.094.311        | 0,05                         |
| 6.125.000   | Morgan Stanley Capital I Trust 2018-L1 Class AS                     | 4,64 %  | 15.10.2051            | 5.937.748        | 0,13                         |
| 3.127.510   | Morgan Stanley Residential Mortgage Loan Trust 2024-NQM3 Class A3   | 5,40 %  | 25.07.2069            | 3.101.582        | 0,07                         |
| 1.824.000   | Morgan Stanley Residential Mortgage Loan Trust 2024-NQM3 Class M1   | 5,61 %  | 25.07.2069            | 1.789.369        | 0,04                         |
| 6.490.000   | Morgan Stanley Residential Mortgage Loan Trust 2024-NQM5 Class A1   | 5,65 %  | 25.10.2069            | 6.499.200        | 0,14                         |
| 2.100.000   | Morgan Stanley Residential Mortgage Loan Trust 2024-NQM5 Class A3   | 6,00 %  | 25.10.2069            | 2.103.298        | 0,05                         |
| 1.175.000   | Morgan Stanley Residential Mortgage Loan Trust 2024-NQM5 Class M1   | 6,52 %  | 25.10.2069            | 1.177.191        | 0,03                         |
| 310.000   | Navient Student Loan Trust 2018-EA Class B                          | 4,44 %  | 15.12.2059            | 298.700          | 0,01                         |
| 3.221.927   | New Residential Mortgage Loan Trust 2017-2 Class B1                 | 4,50 %  | 25.03.2057            | 3.155.428        | 0,07                         |
| 7.856.704   | New Residential Mortgage Loan Trust 2017-3 Class A1                 | 4,00 %  | 25.04.2057            | 7.519.752        | 0,16                         |
| 8.518.471   | New Residential Mortgage Loan Trust 2017-4 Class A1                 | 4,00 %  | 25.05.2057            | 8.087.357        | 0,17                         |
| 6.764.330   | New Residential Mortgage Loan Trust 2024-RPL1 Class A               | 3,80 %  | 25.01.2064            | 6.296.407        | 0,14                         |
| 11.970.000  | New Residential Mortgage Loan Trust 2024-RTL2 Class A1              | 5,44 %  | 25.09.2039            | 11.817.596       | 0,26                         |
| 6.653.124   | NRM FNT1 Excess LLC Series 2024-FNT1 Class A                        | 7,40 %  | 25.11.2031            | 6.698.590        | 0,15                         |
| 2.409.424   | NYMT Loan Trust 2024-INV1 Class A1                                  | 5,38 %  | 25.06.2069            | 2.395.941        | 0,05                         |
| 4.750.150   | NYMT Loan Trust 2024-INV1 Class A3                                  | 5,83 %  | 25.06.2069            | 4.723.474        | 0,10                         |
| 2.000.000   | Oaktree CLO 2024-25 Ltd Series 2024-25X Class D                     | 7,94 %  | 20.04.2037            | 2.048.499        | 0,04                         |
| 1.500.000   | Oaktree CLO 2024-25 Ltd Series 2024-25X Class E                     | 10,88 % | 20.04.2037            | 1.553.069        | 0,03                         |
| 1.000.000   | Oaktree CLO 2024-26 Ltd Series 2024-26X Class D1                    | 7,74 %  | 20.04.2037            | 1.024.126        | 0,02                         |
| 2.000.000   | Oaktree CLO 2024-26 Ltd Series 2024-26X Class E                     | 10,79 % | 20.04.2037            | 2.061.949        | 0,05                         |
| 3.360.031   | OBX Trust Series 2023-NQM7 Class A1                                 | 6,84 %  | 25.04.2063            | 3.410.379        | 0,07                         |
| 4.142.000   | OBX Trust Series 2024-NQM14 Class M1                                | 5,58 %  | 25.09.2064            | 4.040.991        | 0,09                         |
| 7.241.971   | OBX Trust Series 2024-NQM4 Class A1                                 | 6,07 %  | 25.01.2064            | 7.284.147        | 0,16                         |
| 3.402.648   | OBX Trust Series 2024-NQM6 Class A1                                 | 6,45 %  | 25.02.2064            | 3.439.186        | 0,07                         |
| 3.522.381   | OBX Trust Series 2024-NQM6 Class A3                                 | 6,85 %  | 25.02.2064            | 3.561.935        | 0,08                         |
| 1.000.000   | Ocean Trails CLO XV Ltd Series 2024-15X Class D1                    | 9,00 %  | 15.01.2037            | 1.029.660        | 0,02                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag  | Wertpapierbezeichnung  | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|---|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 25,57 % (31. Dezember 2023: 10,45 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>  |  |         |                       |                  |                              |
| 1.000.000   | Ocean Trails CLO XV Ltd Series 2024-15X Class E              | 12,13 % | 15.01.2037            | 1.043.222        | 0,02                         |
| 1.633.249   | OCP CLO 2014-5 Ltd Class A1R                                 | 5,96 %  | 26.04.2031            | 1.636.150        | 0,04                         |
| 220.883   | Octagon Investment Partners 35 Ltd Series 2018-1X Class A1A  | 5,61 %  | 20.01.2031            | 221.204          | 0,01                         |
| 1.000.000   | OHA Credit Funding 17 Ltd Series 2024-17X Class D1           | 7,59 %  | 20.04.2037            | 1.013.502        | 0,02                         |
| 7.000.000   | OHA Credit Funding 18 Ltd Series 2024-18X Class A1           | 5,79 %  | 20.04.2037            | 7.034.665        | 0,15                         |
| 2.000.000   | OHA Credit Funding 18 Ltd Series 2024-18X Class D1           | 7,74 %  | 20.04.2037            | 2.048.361        | 0,04                         |
| 2.000.000   | OHA Credit Funding 18 Ltd Series 2024-18X Class E            | 10,69 % | 20.04.2037            | 2.058.836        | 0,04                         |
| 4.633.230   | One Market Plaza Trust 2017-1MKT Class A                     | 3,61 %  | 10.02.2032            | 4.334.573        | 0,09                         |
| 2.496.000   | One Market Plaza Trust 2017-1MKT Class B                     | 3,85 %  | 10.02.2032            | 2.250.074        | 0,05                         |
| 3.925.000   | One Market Plaza Trust 2017-1MKT Class D                     | 4,15 %  | 10.02.2032            | 3.414.076        | 0,07                         |
| 2.723.184   | OneMain Financial Issuance Trust 2022-2 Class A              | 4,89 %  | 14.10.2034            | 2.725.181        | 0,06                         |
| 2.000.000   | Peebles Park CLO Ltd Series 2024-1X Class D                  | 7,79 %  | 21.04.2037            | 2.048.229        | 0,04                         |
| 2.000.000   | Regatta XXVII Funding Ltd Series 2024-1X Class D             | 8,00 %  | 26.04.2037            | 2.048.560        | 0,04                         |
| 1.000.000   | RR 28 Ltd Series 2024-28RX Class DR                          | 11,30 % | 15.04.2037            | 1.029.959        | 0,02                         |
| 8.970.000   | Shops at Crystals Trust 2016-CSTL Class A                    | 3,13 %  | 05.07.2036            | 8.687.700        | 0,19                         |
| 995.000   | Shops at Crystals Trust 2016-CSTL Class D                    | 3,73 %  | 05.07.2036            | 958.210          | 0,02                         |
| 2.279.781   | SoFi Professional Loan Program 2017-D LLC Class A2FX         | 2,65 %  | 25.09.2040            | 2.238.900        | 0,05                         |
| 834.109   | SoFi Professional Loan Program 2017-E LLC Class B            | 3,49 %  | 26.11.2040            | 818.945          | 0,02                         |
| 900.000   | SoFi Professional Loan Program 2017-F LLC Class BFX          | 3,62 %  | 25.01.2041            | 839.284          | 0,02                         |
| 1.790.024   | SoFi Professional Loan Program 2018-A LLC Class A2B          | 2,95 %  | 25.02.2042            | 1.774.967        | 0,04                         |
| 3.000.000   | SoFi Professional Loan Program 2018-A LLC Class B            | 3,61 %  | 25.02.2042            | 2.799.079        | 0,06                         |
| 878.582   | SoFi Professional Loan Program 2018-B Trust Class A2FX       | 3,34 %  | 25.08.2047            | 870.995          | 0,02                         |
| 73.071  | SoFi Professional Loan Program 2018-C Trust Class A2FX       | 3,59 %  | 25.01.2048            | 71.966           | 0,00                         |
| 158.656   | SoFi Professional Loan Program 2018-D Trust Class A2FX       | 3,60 %  | 25.02.2048            | 156.190          | 0,00                         |
| 650.000   | SoFi Professional Loan Program 2018-D Trust Class BFX        | 4,14 %  | 25.02.2048            | 605.146          | 0,01                         |
| 7.000.000   | Symphony CLO 41 Ltd Series 2024-41X Class A1                 | 5,64 %  | 20.07.2037            | 7.019.076        | 0,15                         |
| 2.000.000   | Symphony CLO 42 Ltd Series 2024-42X Class D                  | 7,80 %  | 17.04.2037            | 2.048.339        | 0,04                         |
| 2.250.000   | Symphony CLO 42 Ltd Series 2024-42X Class E                  | 11,05 % | 17.04.2037            | 2.330.335        | 0,05                         |
| 7.000.000   | Symphony CLO 43 Ltd Series 2024-43X Class A1                 | 5,82 %  | 15.04.2037            | 7.067.698        | 0,15                         |
| 2.000.000   | Symphony CLO 43 Ltd Series 2024-43X Class D1                 | 8,10 %  | 15.04.2037            | 2.048.941        | 0,04                         |
| 2.500.000   | Symphony CLO 43 Ltd Series 2024-43X Class E                  | 11,05 % | 15.04.2037            | 2.601.970        | 0,06                         |
| 5.666.250   | Taco Bell Funding LLC Series 2016-1A Class A23               | 4,97 %  | 25.05.2046            | 5.659.594        | 0,12                         |
| 4.334.828   | Taco Bell Funding LLC Series 2018-1A Class A2II              | 4,94 %  | 25.11.2048            | 4.265.748        | 0,09                         |
| 2.151.000   | Trafigura Securitisation Finance Plc Series 2024-1A Class A2 | 5,98 %  | 15.11.2027            | 2.181.794        | 0,05                         |
| 4.108.000   | Trafigura Securitisation Finance Plc Series 2024-1A Class B  | 7,29 %  | 15.11.2027            | 4.126.408        | 0,09                         |
| 1.000.000   | Trestles CLO 2017-1 Ltd Series 2017-1A Class A1RR            | 6,09 %  | 25.07.2037            | 1.008.666        | 0,02                         |
| 6.000.000   | Trestles CLO 2017-1 Ltd Series 2017-1X Class A1RR            | 5,76 %  | 25.07.2037            | 6.051.998        | 0,13                         |
| 7.000.000   | Trestles CLO VII Ltd Series 2024-7X Class A1                 | 6,20 %  | 25.10.2037            | 7.022.502        | 0,15                         |
| 7.000.000   | Trinitas CLO XXIII Ltd Series 2023-23X Class A               | 6,09 %  | 20.10.2036            | 7.032.851        | 0,15                         |
| 1.250.000   | Trinitas CLO XXIV Ltd Series 2024-24X Class D1               | 8,40 %  | 25.04.2037            | 1.281.799        | 0,03                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag  | Wertpapierbezeichnung                                    | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$     | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|---|--|---------|-----------------------|----------------------|------------------------------|
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 25,57 % (31. Dezember 2023: 10,45 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                      |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>  |  |         |                       |                      |                              |
| 1.750.000   | Trinitas CLO XXIX Ltd Series 2024-29X Class D1           | 7,69 %  | 23.07.2037            | 1.779.432            | 0,04                         |
| 1.000.000   | Trinitas CLO XXVIII Ltd Series 2024-28X Class D          | 8,30 %  | 25.04.2037            | 1.025.242            | 0,02                         |
| 1.840.528   | Verus Securitization Trust 2023-7 Class A1               | 7,07 %  | 25.10.2068            | 1.873.434            | 0,04                         |
| 7.010.345   | Verus Securitization Trust 2024-3 Class A1               | 6,34 %  | 25.04.2069            | 7.075.211            | 0,15                         |
| 3.708.376   | Verus Securitization Trust 2024-4 Class A1               | 6,22 %  | 25.06.2069            | 3.739.199            | 0,08                         |
| 2.713.456   | Verus Securitization Trust 2024-4 Class A3               | 6,67 %  | 25.06.2069            | 2.737.664            | 0,06                         |
| 6.299.908   | Verus Securitization Trust 2024-5 Class A1               | 6,19 %  | 25.06.2069            | 6.348.631            | 0,14                         |
| 4.794.385   | Verus Securitization Trust 2024-5 Class A2               | 6,45 %  | 25.06.2069            | 4.829.746            | 0,10                         |
| 5.412.384   | Verus Securitization Trust 2024-7 Class A1               | 5,10 %  | 25.09.2069            | 5.374.876            | 0,12                         |
| 4.445.014   | Verus Securitization Trust 2024-7 Class A3               | 5,40 %  | 25.09.2069            | 4.398.327            | 0,10                         |
| 4.345.000   | Verus Securitization Trust 2024-8 Class M1               | 5,99 %  | 25.10.2069            | 4.299.663            | 0,09                         |
| 6.296.334   | Volofin Finance DAC Series 2024-1A Class A               | 5,94 %  | 15.06.2037            | 6.316.397            | 0,14                         |
| 2.599.012   | Volofin Finance DAC Series 2024-1A Class B               | 6,21 %  | 15.06.2037            | 2.602.103            | 0,06                         |
| 2.839.256   | Voya CLO 2014-1 Ltd Series 2014-1X Class AAR2            | 5,54 %  | 18.04.2031            | 2.844.427            | 0,06                         |
| 3.320.000   | Wellington Management CLO 1 Ltd Series 2023-1X Class A   | 6,09 %  | 20.10.2036            | 3.344.371            | 0,07                         |
| 2.000.000   | Wellington Management CLO 2 Ltd Series 2024-2X Class D   | 8,19 %  | 20.04.2037            | 2.054.507            | 0,04                         |
| 1.625.000   | Wellington Management CLO 2 Ltd Series 2024-2X Class E   | 11,19 % | 20.04.2037            | 1.697.550            | 0,04                         |
| 1.941.000   | Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS4 Class C  | 4,67 %  | 15.12.2048            | 1.876.060            | 0,04                         |
| 5.470.000   | Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-C37 Class A5  | 3,79 %  | 15.12.2049            | 5.353.859            | 0,12                         |
| 1.455.000   | Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-LC25 Class A4 | 3,64 %  | 15.12.2059            | 1.418.501            | 0,03                         |
| 4.644.000   | Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-NXS6 Class B  | 3,81 %  | 15.11.2049            | 4.422.777            | 0,10                         |
| 1.000.000   | Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-NXS6 Class C  | 4,39 %  | 15.11.2049            | 934.155              | 0,02                         |
| 4.610.000   | Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C39 Class B   | 4,03 %  | 15.09.2050            | 4.304.438            | 0,09                         |
| 2.118.000   | Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C39 Class C   | 4,12 %  | 15.09.2050            | 1.918.639            | 0,04                         |
| 995.000   | Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-C44 Class A5  | 4,21 %  | 15.05.2051            | 965.167              | 0,02                         |
| 425.000   | Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-C47 Class C   | 4,92 %  | 15.09.2061            | 397.530              | 0,01                         |
| 1.000.000   | Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-C48 Class A5  | 4,30 %  | 15.01.2052            | 973.044              | 0,02                         |
| 3.200.000   | Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-C48 Class C   | 5,13 %  | 15.01.2052            | 2.910.204            | 0,06                         |
| 345.864   | WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C21 Class XA        | 0,50 %  | 15.08.2047            | 686                  | 0,00                         |
| 1.903.276   | WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C22 Class XA        | 0,27 %  | 15.09.2057            | 19                   | 0,00                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>  |  |         |                       | <b>1.125.138.460</b> | <b>24,27</b>                 |
| <b>Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) insgesamt **</b>                                       |  |         |                       | <b>1.185.508.405</b> | <b>25,57</b>                 |
| <b>Unternehmensanleihen 25,00 % (31. Dezember 2023: 26,53 %)</b>  |  |         |                       |                      |                              |
| <b>Euro</b>   |  |         |                       |                      |                              |
| 179.000   | 888 Acquisitions Ltd**                                   | 7,56 %  | 15.07.2027            | 182.145              | 0,00                         |
| 1.768.000   | A2A SpA*   | 5,00 %  | 31.12.2149            | 1.899.183            | 0,04                         |
| 800.000   | Abertis Infraestructuras Finance BV*                     | 3,25 %  | 31.12.2149            | 826.907              | 0,02                         |
| 800.000   | Abertis Infraestructuras Finance BV*                     | 4,87 %  | 31.12.2149            | 852.321              | 0,02                         |
| 1.300.000   | Accor SA*  | 4,88 %  | 31.12.2149            | 1.372.063            | 0,03                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                     | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 25,00 % (31. Dezember 2023: 26,53 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |   |         |                       |                  |                              |
| 400.000  | Accor SA*                                 | 7,25 %  | 31.12.2149            | 461.367          | 0,01                         |
| 1.381.000  | AccorInvest Group SA*                     | 5,50 %  | 15.11.2031            | 1.468.467        | 0,03                         |
| 895.000  | Ahlstrom Holding 3 Oy*                    | 3,63 %  | 04.02.2028            | 917.177          | 0,02                         |
| 1.000.000  | Air France-KLM*                           | 4,63 %  | 23.05.2029            | 1.069.184        | 0,02                         |
| 1.020.000  | Allwyn International AS**                 | 3,88 %  | 15.02.2027            | 1.059.041        | 0,02                         |
| 1.394.000  | Almaviva-The Italian Innovation Co SpA*   | 5,00 %  | 30.10.2030            | 1.475.270        | 0,03                         |
| 884.000  | Altice France SA**                        | 4,13 %  | 15.01.2029            | 695.788          | 0,01                         |
| 100.000  | Altice France SA**                        | 4,25 %  | 15.10.2029            | 78.682           | 0,00                         |
| 983.000  | Amber Finco Plc*                          | 6,63 %  | 15.07.2029            | 1.080.050        | 0,02                         |
| 2.800.000  | APA Infrastructure Ltd*                   | 7,13 %  | 09.11.2083            | 3.202.352        | 0,07                         |
| 469.000  | Aramark International Finance Sarl*       | 3,13 %  | 01.04.2025            | 486.864          | 0,01                         |
| 725.000  | Arena Luxembourg Finance Sarl*            | 1,88 %  | 01.02.2028            | 719.393          | 0,02                         |
| 471.000  | ASK Chemicals Deutschland Holding GmbH**  | 10,00 % | 15.11.2029            | 482.583          | 0,01                         |
| 344.000  | Assemblin Caverion Group AB**             | 6,25 %  | 01.07.2030            | 373.663          | 0,01                         |
| 6.743.000  | AusNet Services Holdings Pty Ltd*         | 1,63 %  | 11.03.2081            | 6.768.646        | 0,15                         |
| 520.000  | Avantor Funding Inc*                      | 3,88 %  | 15.07.2028            | 539.015          | 0,01                         |
| 1.035.000  | Balder Finland OYJ*                       | 1,38 %  | 24.05.2030            | 943.546          | 0,02                         |
| 3.330.000  | Banjay Entertainment SAS**                | 7,00 %  | 01.05.2029            | 3.646.493        | 0,08                         |
| 2.700.000  | Bayer AG*                                 | 5,38 %  | 25.03.2082            | 2.746.379        | 0,06                         |
| 200.000  | Bayer AG*                                 | 5,50 %  | 13.09.2054            | 207.907          | 0,00                         |
| 1.460.000  | BCP V Modular Services Finance II Plc**   | 4,75 %  | 30.11.2028            | 1.489.294        | 0,03                         |
| 365.000  | BCP V Modular Services Finance Plc**      | 6,75 %  | 30.11.2029            | 343.744          | 0,01                         |
| 633.000  | BE Semiconductor Industries NV**          | 4,50 %  | 15.07.2031            | 685.275          | 0,01                         |
| 360.000  | Belden Inc*                               | 3,38 %  | 15.07.2031            | 362.281          | 0,01                         |
| 510.000  | Belden Inc*                               | 3,88 %  | 15.03.2028            | 531.632          | 0,01                         |
| 1.668.000  | Benteler International AG*                | 9,38 %  | 15.05.2028            | 1.826.978        | 0,04                         |
| 821.000  | Bertrand Franchise Finance SAS*           | 6,50 %  | 18.07.2030            | 893.763          | 0,02                         |
| 540.000  | Bertrand Franchise Finance SAS*           | 6,96 %  | 18.07.2030            | 564.790          | 0,01                         |
| 3.619.000  | Birkenstock Financing Sarl*               | 5,25 %  | 30.04.2029            | 3.812.666        | 0,08                         |
| 810.000  | Boels Topholding BV**                     | 5,75 %  | 15.05.2030            | 879.419          | 0,02                         |
| 4.700.000  | BP Capital Markets Plc*                   | 3,25 %  | 31.12.2149            | 4.866.850        | 0,10                         |
| 2.581.000  | British Telecommunications Plc*           | 5,13 %  | 03.10.2054            | 2.784.889        | 0,06                         |
| 1.007.000  | Bubbles Bidco SpA**                       | 6,50 %  | 30.09.2031            | 1.052.575        | 0,02                         |
| 1.126.000  | Castello BC Bidco SpA**                   | 7,51 %  | 14.11.2031            | 1.176.210        | 0,03                         |
| 1.495.000  | Castellum AB*                             | 3,13 %  | 31.12.2149            | 1.494.498        | 0,03                         |
| 1.243.000  | CECONOMY AG*                              | 6,25 %  | 15.07.2029            | 1.336.561        | 0,03                         |
| 3.059.000  | Cheplapharm Arzneimittel GmbH**           | 4,38 %  | 15.01.2028            | 2.952.659        | 0,06                         |
| 1.115.000  | Cirsa Finance International Sarl*         | 6,50 %  | 15.03.2029            | 1.224.231        | 0,03                         |
| 2.017.000  | Cirsa Finance International Sarl*         | 7,88 %  | 31.07.2028            | 2.219.176        | 0,05                         |
| 200.000  | Clarios Global LP/Clarios US Finance Co** | 4,38 %  | 15.05.2026            | 207.971          | 0,00                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                 | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 25,00 % (31. Dezember 2023: 26,53 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |   |         |                       |                  |                              |
| 2.690.000  | Constellium SE <sup>*</sup>                           | 5,38 %  | 15.08.2032            | 2.839.817        | 0,06                         |
| 1.045.000  | CPI Property Group SA <sup>*</sup>                    | 1,75 %  | 14.01.2030            | 914.964          | 0,02                         |
| 1.065.000  | CPI Property Group SA <sup>*</sup>                    | 4,88 %  | 31.12.2149            | 1.070.056        | 0,02                         |
| 771.000  | CPI Property Group SA <sup>*</sup>                    | 6,00 %  | 27.01.2032            | 805.202          | 0,02                         |
| 2.130.000  | CPI Property Group SA <sup>*</sup>                    | 7,00 %  | 07.05.2029            | 2.351.338        | 0,05                         |
| 1.632.000  | CT Investment GmbH <sup>*</sup>                       | 6,38 %  | 15.04.2030            | 1.768.221        | 0,04                         |
| 535.000  | Ctec II GmbH <sup>**</sup>                            | 5,25 %  | 15.02.2030            | 513.882          | 0,01                         |
| 1.335.000  | Cullinan Holdco Scsp <sup>**</sup>                    | 4,63 %  | 15.10.2026            | 1.305.808        | 0,03                         |
| 1.006.000  | Dana Financing Luxembourg Sarl <sup>*</sup>           | 8,50 %  | 15.07.2031            | 1.143.163        | 0,02                         |
| 848.000  | Dufry One BV <sup>*</sup>                             | 3,38 %  | 15.04.2028            | 876.087          | 0,02                         |
| 815.000  | Dufry One BV <sup>**</sup>                            | 4,75 %  | 18.04.2031            | 877.614          | 0,02                         |
| 1.200.000  | EDP SA <sup>*</sup>                                   | 4,75 %  | 29.05.2054            | 1.276.771        | 0,03                         |
| 1.100.000  | EDP SA <sup>*</sup>                                   | 5,94 %  | 23.04.2083            | 1.201.983        | 0,03                         |
| 3.800.000  | Electricite de France SA <sup>*</sup>                 | 2,63 %  | 31.12.2149            | 3.726.230        | 0,08                         |
| 2.000.000  | Electricite de France SA <sup>*</sup>                 | 2,88 %  | 31.12.2149            | 2.034.385        | 0,04                         |
| 800.000  | Electricite de France SA <sup>*</sup>                 | 5,63 %  | 31.12.2149            | 859.299          | 0,02                         |
| 3.200.000  | Electricite de France SA <sup>*</sup>                 | 7,50 %  | 31.12.2149            | 3.669.391        | 0,08                         |
| 1.900.000  | Elia Group SA <sup>*</sup>                            | 5,85 %  | 31.12.2149            | 2.073.547        | 0,04                         |
| 1.300.000  | ELM BV for Firmenich International SA <sup>*</sup>    | 3,75 %  | 31.12.2149            | 1.350.000        | 0,03                         |
| 1.044.000  | EMRLD Borrower LP/Emerald Co-Issuer Inc <sup>**</sup> | 6,38 %  | 15.12.2030            | 1.147.598        | 0,02                         |
| 3.000.000  | EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG <sup>*</sup>       | 1,88 %  | 29.06.2080            | 3.045.209        | 0,07                         |
| 3.000.000  | Enel SpA <sup>*</sup>                                 | 3,38 %  | 31.12.2149            | 3.102.049        | 0,07                         |
| 3.100.000  | Enel SpA <sup>*</sup>                                 | 6,38 %  | 31.12.2149            | 3.457.798        | 0,07                         |
| 373.000  | Energia Group Roi Financeco DAC <sup>**</sup>         | 6,88 %  | 31.07.2028            | 406.023          | 0,01                         |
| 1.885.000  | Energizer Gamma Acquisition BV <sup>**</sup>          | 3,50 %  | 30.06.2029            | 1.887.394        | 0,04                         |
| 1.615.000  | Ephios Subco 3 Sarl <sup>**</sup>                     | 7,88 %  | 31.01.2031            | 1.828.833        | 0,04                         |
| 1.285.000  | Eroski S Coop <sup>*</sup>                            | 10,63 % | 30.04.2029            | 1.453.700        | 0,03                         |
| 1.580.000  | Eurofins Scientific SE <sup>*</sup>                   | 6,75 %  | 31.12.2149            | 1.727.123        | 0,04                         |
| 3.824.000  | Fastighets AB Balder <sup>*</sup>                     | 2,87 %  | 02.06.2081            | 3.870.658        | 0,08                         |
| 2.687.000  | Fedrigoni SpA <sup>**</sup>                           | 6,13 %  | 15.06.2031            | 2.805.874        | 0,06                         |
| 2.612.000  | Flora Food Management BV <sup>**</sup>                | 6,88 %  | 02.07.2029            | 2.832.447        | 0,06                         |
| 1.292.000  | Flutter Treasury DAC <sup>*</sup>                     | 5,00 %  | 29.04.2029            | 1.400.434        | 0,03                         |
| 783.000  | Fnac Darty SA <sup>*</sup>                            | 6,00 %  | 01.04.2029            | 852.486          | 0,02                         |
| 430.000  | Food Service Project SA <sup>*</sup>                  | 5,50 %  | 21.01.2027            | 452.111          | 0,01                         |
| 380.000  | Forvia SE <sup>*</sup>                                | 2,38 %  | 15.06.2029            | 354.568          | 0,01                         |
| 704.000  | Forvia SE <sup>*</sup>                                | 2,75 %  | 15.02.2027            | 704.349          | 0,02                         |
| 700.000  | Forvia SE <sup>*</sup>                                | 3,13 %  | 15.06.2026            | 719.024          | 0,02                         |
| 913.000  | Forvia SE <sup>*</sup>                                | 5,50 %  | 15.06.2031            | 945.995          | 0,02                         |
| 1.651.000  | Fressnapf Holding SE <sup>**</sup>                    | 5,25 %  | 31.10.2031            | 1.768.753        | 0,04                         |
| 660.000  | Goldstory SAS <sup>*</sup>                            | 6,75 %  | 01.02.2030            | 717.250          | 0,02                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 25,00 % (31. Dezember 2023: 26,53 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |   |         |                       |                  |                              |
| 725.000  | Grifols SA <sup>*</sup>   | 2,25 %  | 15.11.2027            | 719.631          | 0,02                         |
| 1.147.000  | Grifols SA <sup>*</sup>   | 3,88 %  | 15.10.2028            | 1.077.316        | 0,02                         |
| 1.330.000  | Grifols SA <sup>*</sup>   | 7,50 %  | 01.05.2030            | 1.447.517        | 0,03                         |
| 996.000  | Gruenthal GmbH**  | 4,63 %  | 15.11.2031            | 1.047.166        | 0,02                         |
| 400.000  | Grupo Antolin-Irausa SA <sup>*</sup>                                  | 10,38 % | 30.01.2030            | 352.232          | 0,01                         |
| 2.835.000  | Guala Closures SpA <sup>*</sup>                                       | 3,25 %  | 15.06.2028            | 2.842.160        | 0,06                         |
| 200.000  | Heimstaden Bostad AB <sup>*</sup>                                     | 2,63 %  | 31.12.2149            | 192.862          | 0,00                         |
| 790.000  | Heimstaden Bostad AB <sup>*</sup>                                     | 3,00 %  | 31.12.2149            | 752.945          | 0,02                         |
| 2.350.000  | Heimstaden Bostad AB <sup>*</sup>                                     | 6,25 %  | 31.12.2149            | 2.455.204        | 0,05                         |
| 500.000  | Heimstaden Bostad Treasury BV <sup>*</sup>                            | 0,63 %  | 24.07.2025            | 511.731          | 0,01                         |
| 1.460.000  | Heimstaden Bostad Treasury BV <sup>*</sup>                            | 1,63 %  | 13.10.2031            | 1.291.533        | 0,03                         |
| 1.387.000  | Holding d'Infrastructures des Metiers de l'Environnement <sup>*</sup> | 4,88 %  | 24.10.2029            | 1.480.256        | 0,03                         |
| 500.000  | House of HR Group BV**  | 9,00 %  | 03.11.2029            | 518.783          | 0,01                         |
| 485.000  | HT Troplast GmbH**  | 9,38 %  | 15.07.2028            | 535.190          | 0,01                         |
| 965.000  | IHO Verwaltungs GmbH <sup>*</sup>                                     | 7,00 %  | 15.11.2031            | 1.026.099        | 0,02                         |
| 815.000  | IHO Verwaltungs GmbH <sup>*</sup>                                     | 8,75 %  | 15.05.2028            | 894.568          | 0,02                         |
| 568.000  | Iliad Holding SASU**  | 5,38 %  | 15.04.2030            | 606.613          | 0,01                         |
| 3.222.000  | Iliad Holding SASU**  | 5,63 %  | 15.10.2028            | 3.428.545        | 0,07                         |
| 2.025.000  | Iliad Holding SASU <sup>*</sup>                                       | 6,88 %  | 15.04.2031            | 2.258.871        | 0,05                         |
| 1.635.000  | INEOS Quattro Finance 2 Plc <sup>*</sup>                              | 8,50 %  | 15.03.2029            | 1.819.973        | 0,04                         |
| 1.108.000  | Jaguar Land Rover Automotive Plc <sup>*</sup>                         | 4,50 %  | 15.07.2028            | 1.160.086        | 0,03                         |
| 476.000  | Kapla Holding SAS <sup>*</sup>  | 6,39 %  | 31.07.2030            | 496.610          | 0,01                         |
| 946.000  | Koninklijke KPN NV <sup>*</sup>                                       | 4,88 %  | 31.12.2149            | 1.021.264        | 0,02                         |
| 185.000  | Koninklijke KPN NV <sup>*</sup>                                       | 6,00 %  | 31.12.2149            | 204.486          | 0,00                         |
| 100.000  | Kronos International Inc**  | 3,75 %  | 15.09.2025            | 103.279          | 0,00                         |
| 870.000  | Kronos International Inc**  | 9,50 %  | 15.03.2029            | 993.745          | 0,02                         |
| 186.292  | LHMC Finco 2 Sarl <sup>*</sup>  | 7,25 %  | 02.10.2025            | 193.923          | 0,00                         |
| 3.960.000  | Lorca Telecom Bondco SA <sup>*</sup>                                  | 4,00 %  | 18.09.2027            | 4.121.083        | 0,09                         |
| 822.000  | Lottomatica Group SpA**   | 5,38 %  | 01.06.2030            | 887.647          | 0,02                         |
| 300.000  | Loxam SAS <sup>*</sup>  | 5,75 %  | 15.07.2027            | 311.384          | 0,01                         |
| 200.000  | Loxam SAS <sup>*</sup>  | 6,38 %  | 15.05.2028            | 216.461          | 0,00                         |
| 480.000  | Loxam SAS <sup>*</sup>  | 6,38 %  | 31.05.2029            | 526.352          | 0,01                         |
| 950.000  | Lune Holdings Sarl**  | 5,63 %  | 15.11.2028            | 751.333          | 0,02                         |
| 737.000  | Metlen Energy & Metals SA <sup>*</sup>                                | 4,00 %  | 17.10.2029            | 781.807          | 0,02                         |
| 507.000  | Motel One GmbH**  | 7,75 %  | 02.04.2031            | 567.002          | 0,01                         |
| 2.977.000  | Motion Finco Sarl <sup>*</sup>  | 7,38 %  | 15.06.2030            | 3.143.305        | 0,07                         |
| 545.000  | Multiversity SpA <sup>*</sup>   | 7,30 %  | 30.10.2028            | 569.975          | 0,01                         |
| 2.700.000  | Naturgy Finance Iberia SA <sup>*</sup>                                | 2,37 %  | 31.12.2149            | 2.728.786        | 0,06                         |
| 823.000  | Neinor Homes SA <sup>*</sup>  | 5,88 %  | 15.02.2030            | 892.542          | 0,02                         |
| 350.000  | Neopharmed Gentili SpA <sup>*</sup>                                   | 7,13 %  | 08.04.2030            | 386.083          | 0,01                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                    | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 25,00 % (31. Dezember 2023: 26,53 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                  |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |  |        |                       |                  |                              |
| 700.000  | Nexans SA*                               | 4,13 % | 29.05.2029            | 745.347          | 0,02                         |
| 500.000  | Nexans SA*                               | 4,25 % | 11.03.2030            | 531.626          | 0,01                         |
| 1.500.000  | NGG Finance Plc*                         | 2,13 % | 05.09.2082            | 1.499.158        | 0,03                         |
| 882.000  | Nidda Healthcare Holding GmbH**          | 5,63 % | 21.02.2030            | 946.638          | 0,02                         |
| 325.674  | Nidda Healthcare Holding GmbH**          | 7,50 % | 21.08.2026            | 349.038          | 0,01                         |
| 700.000  | Odido Group Holding BV**                 | 5,50 % | 15.01.2030            | 722.681          | 0,02                         |
| 2.735.000  | Odido Holding BV**                       | 3,75 % | 15.01.2029            | 2.809.315        | 0,06                         |
| 350.000  | OEG Finance Plc**                        | 7,25 % | 27.09.2029            | 380.556          | 0,01                         |
| 1.532.000  | Olympus Water US Holding Corp*           | 3,88 % | 01.10.2028            | 1.554.408        | 0,03                         |
| 1.805.000  | Olympus Water US Holding Corp**          | 9,63 % | 15.11.2028            | 1.999.748        | 0,04                         |
| 3.924.000  | Optics Bidco SpA*                        | 7,88 % | 31.07.2028            | 4.600.661        | 0,10                         |
| 1.219.000  | Orsted AS*                               | 5,13 % | 14.03.3024            | 1.308.411        | 0,03                         |
| 2.105.000  | Orsted AS*                               | 5,25 % | 08.12.3022            | 2.266.099        | 0,05                         |
| 2.134.000  | Pachelbel Bidco SpA**                    | 7,13 % | 17.05.2031            | 2.372.862        | 0,05                         |
| 930.000  | Petroleos Mexicanos*                     | 4,75 % | 26.02.2029            | 890.775          | 0,02                         |
| 1.972.000  | PEU Finance Plc*                         | 7,25 % | 01.07.2028            | 2.148.660        | 0,05                         |
| 389.000  | Picard Groupe SAS**                      | 6,38 % | 01.07.2029            | 420.754          | 0,01                         |
| 1.712.000  | PLT VII Finance Sarl*                    | 6,00 % | 15.06.2031            | 1.871.459        | 0,04                         |
| 1.446.000  | Primo Water Holdings Inc**               | 3,88 % | 31.10.2028            | 1.473.442        | 0,03                         |
| 1.860.000  | ProGroup AG*                             | 5,38 % | 15.04.2031            | 1.886.845        | 0,04                         |
| 1.700.000  | Proximus SADP*                           | 4,75 % | 31.12.2149            | 1.762.550        | 0,04                         |
| 812.000  | Q-Park Holding I BV*                     | 5,13 % | 01.03.2029            | 871.311          | 0,02                         |
| 1.160.000  | Rakuten Group Inc*                       | 4,25 % | 31.12.2149            | 1.128.929        | 0,02                         |
| 821.000  | RAY Financing LLC*                       | 6,50 % | 15.07.2031            | 892.534          | 0,02                         |
| 3.000.000  | Repsol International Finance BV*         | 3,75 % | 31.12.2149            | 3.119.861        | 0,07                         |
| 2.000.000  | Repsol International Finance BV*         | 4,25 % | 31.12.2149            | 2.112.913        | 0,05                         |
| 1.400.000  | Roquette Freres SA*                      | 5,49 % | 31.12.2149            | 1.483.898        | 0,03                         |
| 1.780.000  | Rossini Sarl*                            | 6,56 % | 31.12.2029            | 1.880.054        | 0,04                         |
| 917.000  | Rossini Sarl*                            | 6,75 % | 31.12.2029            | 1.008.639        | 0,02                         |
| 976.000  | Sammontana Italia SpA**                  | 6,97 % | 15.10.2031            | 1.020.754        | 0,02                         |
| 1.200.000  | Schaeffler AG*                           | 4,50 % | 28.03.2030            | 1.254.001        | 0,03                         |
| 200.000  | Schaeffler AG*                           | 4,75 % | 14.08.2029            | 212.940          | 0,00                         |
| 2.359.000  | Southern Co*                             | 1,88 % | 15.09.2081            | 2.300.976        | 0,05                         |
| 2.000.000  | SSE Plc*                                 | 4,00 % | 31.12.2149            | 2.088.528        | 0,05                         |
| 874.000  | Stedin Holding NV*                       | 1,50 % | 31.12.2149            | 868.826          | 0,02                         |
| 862.000  | Summer BC Holdco B Sarl**                | 5,75 % | 31.10.2026            | 895.056          | 0,02                         |
| 3.000.000  | Syensqo SA*                              | 2,50 % | 31.12.2149            | 3.076.125        | 0,07                         |
| 1.365.000  | Synthomer Plc*                           | 7,38 % | 02.05.2029            | 1.482.215        | 0,03                         |
| 1.378.582  | Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH** | 6,00 % | 30.07.2026            | 1.435.957        | 0,03                         |
| 422.000  | Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH** | 5,38 % | 15.07.2029            | 453.067          | 0,01                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                      | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 25,00 % (31. Dezember 2023: 26,53 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                  |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |  |        |                       |                  |                              |
| 3.595.000  | Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH REGS <sup>*</sup>   | 5,38 % | 15.07.2029            | 3.869.877        | 0,08                         |
| 1.705.000  | Telecom Italia SpA <sup>*</sup>                            | 7,88 % | 31.07.2028            | 2.004.590        | 0,04                         |
| 1.500.000  | Telefonica Europe BV <sup>*</sup>                          | 5,75 % | 31.12.2149            | 1.669.744        | 0,04                         |
| 1.300.000  | Telefonica Europe BV <sup>*</sup>                          | 6,14 % | 31.12.2149            | 1.459.738        | 0,03                         |
| 800.000  | Telefonica Europe BV <sup>*</sup>                          | 6,75 % | 31.12.2149            | 932.940          | 0,02                         |
| 500.000  | Telefonica Europe BV <sup>*</sup>                          | 7,13 % | 31.12.2149            | 572.916          | 0,01                         |
| 1.583.000  | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV <sup>*</sup> | 3,75 % | 09.05.2027            | 1.657.031        | 0,04                         |
| 3.705.000  | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV <sup>*</sup> | 4,38 % | 09.05.2030            | 3.948.840        | 0,09                         |
| 981.000  | TI Automotive Finance Plc <sup>**</sup>                    | 3,75 % | 15.04.2029            | 1.012.704        | 0,02                         |
| 6.265.000  | TK Elevator Midco GmbH <sup>**</sup>                       | 4,38 % | 15.07.2027            | 6.503.505        | 0,14                         |
| 1.400.000  | Transportes Aereos Portugueses SA <sup>*</sup>             | 5,13 % | 15.11.2029            | 1.489.106        | 0,03                         |
| 679.000  | TUI Cruises GmbH <sup>**</sup>                             | 5,00 % | 15.05.2030            | 716.687          | 0,02                         |
| 915.000  | UGI International LLC <sup>**</sup>                        | 2,50 % | 01.12.2029            | 886.370          | 0,02                         |
| 5.700.000  | Unibail-Rodamco-Westfield SE <sup>*</sup>                  | 7,25 % | 31.12.2149            | 6.479.459        | 0,14                         |
| 690.000  | United Group BV <sup>**</sup>                              | 4,63 % | 15.08.2028            | 711.479          | 0,02                         |
| 1.830.000  | United Group BV <sup>**</sup>                              | 5,25 % | 01.02.2030            | 1.886.672        | 0,04                         |
| 715.000  | United Group BV <sup>**</sup>                              | 6,50 % | 31.10.2031            | 757.148          | 0,02                         |
| 835.000  | United Group BV <sup>**</sup>                              | 6,75 % | 15.02.2031            | 896.994          | 0,02                         |
| 2.740.000  | UPCB Finance VII Ltd <sup>*</sup>                          | 3,63 % | 15.06.2029            | 2.821.907        | 0,06                         |
| 800.000  | Valeo SE <sup>*</sup>                                      | 4,50 % | 11.04.2030            | 830.651          | 0,02                         |
| 700.000  | Valeo SE <sup>*</sup>                                      | 5,88 % | 12.04.2029            | 775.820          | 0,02                         |
| 3.800.000  | Vattenfall AB <sup>*</sup>                                 | 3,00 % | 19.03.2077            | 3.879.221        | 0,08                         |
| 3.000.000  | Veolia Environnement SA <sup>*</sup>                       | 2,25 % | 31.12.2149            | 3.059.902        | 0,07                         |
| 1.500.000  | Veolia Environnement SA <sup>*</sup>                       | 2,50 % | 31.12.2149            | 1.457.105        | 0,03                         |
| 2.900.000  | Veolia Environnement SA <sup>*</sup>                       | 5,99 % | 31.12.2149            | 3.223.463        | 0,07                         |
| 1.735.000  | Verisure Holding AB <sup>*</sup>                           | 3,25 % | 15.02.2027            | 1.778.345        | 0,04                         |
| 3.571.000  | Verisure Midholding AB <sup>*</sup>                        | 5,25 % | 15.02.2029            | 3.718.868        | 0,08                         |
| 1.377.000  | VF Corp <sup>*</sup>                                       | 4,25 % | 07.03.2029            | 1.431.224        | 0,03                         |
| 1.975.000  | Vmed O2 UK Financing I Plc <sup>**</sup>                   | 5,63 % | 15.04.2032            | 2.091.753        | 0,05                         |
| 2.100.000  | Vodafone Group Plc <sup>*</sup>                            | 6,50 % | 30.08.2084            | 2.400.703        | 0,05                         |
| 3.100.000  | Volkswagen International Finance NV <sup>*</sup>           | 3,75 % | 31.12.2149            | 3.115.273        | 0,07                         |
| 700.000  | Volkswagen International Finance NV <sup>*</sup>           | 3,88 % | 31.12.2149            | 678.133          | 0,01                         |
| 400.000  | Volkswagen International Finance NV <sup>*</sup>           | 4,38 % | 31.12.2149            | 383.239          | 0,01                         |
| 3.800.000  | Volkswagen International Finance NV <sup>*</sup>           | 4,63 % | 31.12.2149            | 3.944.462        | 0,09                         |
| 1.270.000  | Walgreens Boots Alliance Inc <sup>*</sup>                  | 2,13 % | 20.11.2026            | 1.271.655        | 0,03                         |
| 1.200.000  | Wintershall Dea Finance 2 BV <sup>*</sup>                  | 3,00 % | 31.12.2149            | 1.155.618        | 0,02                         |
| 1.042.000  | Zegona Finance Plc <sup>*</sup>                            | 6,75 % | 15.07.2029            | 1.153.062        | 0,02                         |
| 3.000.000  | ZF Europe Finance BV <sup>*</sup>                          | 3,00 % | 23.10.2029            | 2.801.517        | 0,06                         |
| 400.000  | ZF Finance GmbH <sup>*</sup>                               | 3,75 % | 21.09.2028            | 394.851          | 0,01                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 25,00 % (31. Dezember 2023: 26,53 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                    |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |   |         |                       |                    |                              |
| 3.977.000  | Ziggo Bond Co BV <sup>†</sup>   | 3,38 %  | 28.02.2030            | 3.769.595          | 0,08                         |
| <b>Euro insgesamt</b>  |   |         |                       | <b>319.433.514</b> | <b>6,89</b>                  |
| <b>Britisches Pfund</b>  |   |         |                       |                    |                              |
| 439.000  | 888 Acquisitions Ltd <sup>†</sup>   | 10,75 % | 15.05.2030            | 550.792            | 0,01                         |
| 323.021  | AA Bond Co Ltd <sup>†</sup>   | 6,50 %  | 31.01.2026            | 405.563            | 0,01                         |
| 179.000  | AA Bond Co Ltd <sup>†</sup>   | 6,85 %  | 31.07.2031            | 229.411            | 0,01                         |
| 1.538.000  | AA Bond Co Ltd <sup>†</sup>   | 8,45 %  | 31.01.2028            | 2.034.550          | 0,04                         |
| 63.029   | AA Bond Co Ltd 144A <sup>†</sup>  | 6,50 %  | 31.01.2026            | 79.134             | 0,00                         |
| 898.000  | Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl <sup>†</sup> | 4,88 %  | 01.06.2028            | 1.045.952          | 0,02                         |
| 556.000  | B&M European Value Retail SA <sup>†</sup>   | 6,50 %  | 27.11.2031            | 692.483            | 0,01                         |
| 1.985.000  | B&M European Value Retail SA <sup>†</sup>   | 8,13 %  | 15.11.2030            | 2.657.238          | 0,06                         |
| 2.056.000  | Bellis Acquisition Co Plc <sup>**</sup>   | 8,13 %  | 14.05.2030            | 2.503.325          | 0,05                         |
| 510.000  | Bellis Finco Plc <sup>**</sup>  | 4,00 %  | 16.02.2027            | 605.191            | 0,01                         |
| 1.294.000  | Boost Newco Borrower LLC/GTCR W Dutch Finance Sub BV <sup>**</sup>                        | 8,50 %  | 15.01.2031            | 1.737.640          | 0,04                         |
| 1.500.000  | BP Capital Markets Plc <sup>†</sup>   | 4,25 %  | 31.12.2149            | 1.819.894          | 0,04                         |
| 3.721.000  | British Telecommunications Plc <sup>†</sup>   | 8,38 %  | 20.12.2083            | 4.998.043          | 0,11                         |
| 400.000  | Co-operative Group Holdings 2011 Ltd <sup>†</sup>   | 7,50 %  | 08.07.2026            | 514.436            | 0,01                         |
| 2.245.000  | CPUK Finance Ltd <sup>**</sup>  | 6,50 %  | 28.08.2026            | 2.815.363          | 0,06                         |
| 1.085.000  | Deuce Finco Plc <sup>**</sup>   | 5,50 %  | 15.06.2027            | 1.334.463          | 0,03                         |
| 582.000  | Edge Finco Plc <sup>**</sup>  | 8,13 %  | 15.08.2031            | 748.391            | 0,02                         |
| 500.000  | Iceland Bondco Plc <sup>**</sup>  | 10,88 % | 15.12.2027            | 673.165            | 0,01                         |
| 874.000  | Kier Group Plc <sup>†</sup>   | 9,00 %  | 15.02.2029            | 1.156.661          | 0,03                         |
| 767.000  | Maison Finco Plc <sup>**</sup>  | 6,00 %  | 31.10.2027            | 949.789            | 0,02                         |
| 2.060.000  | Market Bidco Finco Plc <sup>**</sup>  | 5,50 %  | 04.11.2027            | 2.473.844          | 0,05                         |
| 3.715.000  | Miller Homes Group Finco Plc <sup>**</sup>  | 7,00 %  | 15.05.2029            | 4.546.506          | 0,10                         |
| 878.000  | Mobico Group Plc <sup>†</sup>   | 4,25 %  | 31.12.2149            | 1.055.766          | 0,02                         |
| 4.780.000  | NGG Finance Plc <sup>†</sup>  | 5,63 %  | 18.06.2073            | 6.000.737          | 0,13                         |
| 708.000  | Ocado Group Plc <sup>†</sup>  | 10,50 % | 08.08.2029            | 903.156            | 0,02                         |
| 793.000  | Pinnacle Bidco Plc <sup>†</sup>   | 10,00 % | 11.10.2028            | 1.060.471          | 0,02                         |
| 610.000  | RAC Bond Co Plc <sup>**</sup>   | 5,25 %  | 04.11.2027            | 742.287            | 0,02                         |
| 489.000  | Sherwood Financing Plc <sup>†</sup>   | 9,63 %  | 15.12.2029            | 613.955            | 0,01                         |
| 768.000  | TVL Finance Plc <sup>**</sup>   | 10,25 % | 28.04.2028            | 1.000.437          | 0,02                         |
| 1.700.000  | Vattenfall AB <sup>†</sup>  | 6,88 %  | 17.08.2083            | 2.185.880          | 0,05                         |
| 359.000  | Virgin Media O2 Vendor Financing Notes V DAC <sup>†</sup>                                 | 7,88 %  | 15.03.2032            | 449.381            | 0,01                         |
| 2.212.000  | Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC <sup>**</sup>                                 | 4,88 %  | 15.07.2028            | 2.590.239          | 0,06                         |
| 1.909.000  | Vodafone Group Plc <sup>†</sup>   | 4,88 %  | 03.10.2078            | 2.398.195          | 0,05                         |
| <b>Britisches Pfund insgesamt</b>  |   |         |                       | <b>53.572.338</b>  | <b>1,15</b>                  |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung  | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 25,00 % (31. Dezember 2023: 26,53 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 800.000  | 1011778 BC ULC/New Red Finance Inc**   | 4,38 %  | 15.01.2028            | 764.863          | 0,02                         |
| 1.850.000  | 3R Lux Sarl**  | 9,75 %  | 05.02.2031            | 1.914.282        | 0,04                         |
| 4.300.000  | ABN AMRO Bank NV**   | 5,52 %  | 03.12.2035            | 4.208.459        | 0,09                         |
| 630.000  | Acrisure LLC/Acrisure Finance Inc**  | 7,50 %  | 06.11.2030            | 649.382          | 0,01                         |
| 1.260.000  | Acrisure LLC/Acrisure Finance Inc**  | 8,25 %  | 01.02.2029            | 1.306.010        | 0,03                         |
| 1.395.000  | Ahead DB Holdings LLC**  | 6,63 %  | 01.05.2028            | 1.368.849        | 0,03                         |
| 995.000  | Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC**              | 5,88 %  | 15.02.2028            | 991.716          | 0,02                         |
| 235.000  | Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**                 | 6,50 %  | 01.10.2031            | 232.973          | 0,01                         |
| 740.000  | Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**                 | 6,75 %  | 15.10.2027            | 734.628          | 0,02                         |
| 1.020.000  | Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**                 | 6,75 %  | 15.04.2028            | 1.025.846        | 0,02                         |
| 560.000  | Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**                 | 7,00 %  | 15.01.2031            | 562.800          | 0,01                         |
| 50.000   | Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**                 | 7,38 %  | 01.10.2032            | 50.523           | 0,00                         |
| 1.420.000  | Allied Universal Holdco LLC**  | 7,88 %  | 15.02.2031            | 1.453.129        | 0,03                         |
| 1.215.000  | Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp**                    | 6,00 %  | 01.06.2029            | 1.108.362        | 0,02                         |
| 25.000   | Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl** | 4,63 %  | 01.06.2028            | 23.571           | 0,00                         |
| 1.275.000  | Allwyn Entertainment Financing UK Plc**  | 7,88 %  | 30.04.2029            | 1.315.284        | 0,03                         |
| 3.703.000  | Ally Financial Inc**   | 4,70 %  | 31.12.2149            | 3.245.436        | 0,07                         |
| 2.200.000  | Ally Financial Inc**   | 5,54 %  | 17.01.2031            | 2.169.836        | 0,05                         |
| 1.740.000  | Alpha Generation LLC**   | 6,75 %  | 15.10.2032            | 1.723.122        | 0,04                         |
| 570.000  | Altice France SA**   | 5,50 %  | 15.01.2028            | 422.438          | 0,01                         |
| 830.000  | Ambipar Lux Sarl**   | 9,88 %  | 06.02.2031            | 829.205          | 0,02                         |
| 220.000  | Amentum Holdings Inc**   | 7,25 %  | 01.08.2032            | 221.918          | 0,01                         |
| 1.300.000  | American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd**                              | 5,75 %  | 20.04.2029            | 1.290.220        | 0,03                         |
| 4.505.000  | American Electric Power Co Inc**   | 7,05 %  | 15.12.2054            | 4.678.734        | 0,10                         |
| 1.250.000  | American Express Co**  | 3,55 %  | 31.12.2149            | 1.204.599        | 0,03                         |
| 13.740.000   | American Tower Trust #1 <sup>†</sup>   | 3,65 %  | 23.03.2028            | 13.107.838       | 0,28                         |
| 2.670.000  | Amgen Inc**  | 5,75 %  | 02.03.2063            | 2.562.931        | 0,06                         |
| 1.470.000  | AmWINS Group Inc**   | 4,88 %  | 30.06.2029            | 1.387.126        | 0,03                         |
| 390.000  | AmWINS Group Inc**   | 6,38 %  | 15.02.2029            | 392.635          | 0,01                         |
| 1.580.000  | Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp**                   | 6,63 %  | 01.02.2032            | 1.592.597        | 0,03                         |
| 4.745.000  | Aon North America Inc*   | 5,75 %  | 01.03.2054            | 4.631.597        | 0,10                         |
| 1.190.000  | Archrock Partners LP/Archrock Partners Finance Corp**                          | 6,63 %  | 01.09.2032            | 1.189.644        | 0,03                         |
| 1.015.000  | Arcosa Inc**   | 6,88 %  | 15.08.2032            | 1.032.524        | 0,02                         |
| 1.375.000  | Arsenal AIC Parent LLC**   | 11,50 % | 01.10.2031            | 1.540.043        | 0,03                         |
| 2.380.000  | Arthur J Gallagher & Co*   | 5,55 %  | 15.02.2055            | 2.287.183        | 0,05                         |
| 725.000  | Asbury Automotive Group Inc**  | 5,00 %  | 15.02.2032            | 662.153          | 0,01                         |
| 875.000  | Ascension Health**   | 3,11 %  | 15.11.2039            | 663.411          | 0,01                         |
| 1.910.000  | Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**                         | 5,88 %  | 30.06.2029            | 1.861.974        | 0,04                         |
| 305.000  | Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**                         | 6,63 %  | 15.10.2032            | 303.462          | 0,01                         |
| 390.000  | Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**                         | 8,25 %  | 31.12.2028            | 398.434          | 0,01                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung  | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 25,00 % (31. Dezember 2023: 26,53 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 1.120.000  | ASGN Inc**   | 4,63 %  | 15.05.2028            | 1.064.694        | 0,02                         |
| 110.000  | AssuredPartners Inc**  | 5,63 %  | 15.01.2029            | 111.339          | 0,00                         |
| 615.000  | AssuredPartners Inc**  | 7,50 %  | 15.02.2032            | 662.447          | 0,01                         |
| 15.550.000   | AT&T Inc**   | 3,50 %  | 15.09.2053            | 10.480.376       | 0,23                         |
| 2.295.000  | AthenaHealth Group Inc**   | 6,50 %  | 15.02.2030            | 2.183.316        | 0,05                         |
| 417.000  | Australia & New Zealand Banking Group Ltd*   | 6,75 %  | 31.12.2149            | 423.686          | 0,01                         |
| 475.000  | Avient Corp**  | 6,25 %  | 01.11.2031            | 469.052          | 0,01                         |
| 1.790.000  | Avient Corp**  | 7,13 %  | 01.08.2030            | 1.836.144        | 0,04                         |
| 535.000  | Azorra Finance Ltd**   | 7,75 %  | 15.04.2030            | 532.425          | 0,01                         |
| 2.515.000  | BAE Systems Plc*   | 5,30 %  | 26.03.2034            | 2.509.023        | 0,05                         |
| 365.000  | Baldwin Insurance Group Holdings LLC/Baldwin Insurance Group Holdings Finance**    | 7,13 %  | 15.05.2031            | 372.927          | 0,01                         |
| 1.000.000  | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA*  | 6,50 %  | 31.12.2149            | 998.552          | 0,02                         |
| 800.000  | Banco do Brasil SA**   | 8,75 %  | 31.12.2149            | 802.154          | 0,02                         |
| 3.120.000  | Banco Mercantil del Norte SA**   | 8,75 %  | 31.12.2149            | 3.111.261        | 0,07                         |
| 415.000  | Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand** | 5,62 %  | 10.12.2029            | 413.962          | 0,01                         |
| 755.000  | Bangkok Bank PCL**   | 5,65 %  | 05.07.2034            | 765.639          | 0,02                         |
| 213.000  | Bank of America Corp**   | 4,30 %  | 31.12.2149            | 212.054          | 0,00                         |
| 1.440.000  | Bank of America Corp**   | 4,38 %  | 31.12.2149            | 1.390.093        | 0,03                         |
| 2.305.000  | Bank of America Corp**   | 4,95 %  | 22.07.2028            | 2.310.262        | 0,05                         |
| 6.410.000  | Bank of New York Mellon Corp**   | 3,75 %  | 31.12.2149            | 6.073.955        | 0,13                         |
| 990.000  | Banque Federative du Credit Mutuel SA 144A**                                       | 5,09 %  | 23.01.2027            | 992.416          | 0,02                         |
| 1.760.000  | Barclays Plc*  | 4,38 %  | 31.12.2149            | 1.587.230        | 0,03                         |
| 225.000  | Barclays Plc*  | 6,13 %  | 31.12.2149            | 224.752          | 0,01                         |
| 1.740.000  | Barclays Plc*  | 8,00 %  | 31.12.2149            | 1.804.509        | 0,04                         |
| 1.530.000  | Barclays Plc*  | 9,63 %  | 31.12.2149            | 1.687.393        | 0,04                         |
| 690.000  | Bath & Body Works Inc**  | 6,63 %  | 01.10.2030            | 697.883          | 0,02                         |
| 490.000  | Bath & Body Works Inc*   | 6,75 %  | 01.07.2036            | 498.637          | 0,01                         |
| 1.170.000  | Bausch & Lomb Corp**   | 8,38 %  | 01.10.2028            | 1.212.412        | 0,03                         |
| 1.710.000  | BCPE Empire Holdings Inc**   | 7,63 %  | 01.05.2027            | 1.705.902        | 0,04                         |
| 750.000  | Beazer Homes USA Inc*  | 5,88 %  | 15.10.2027            | 740.894          | 0,02                         |
| 565.000  | Beazer Homes USA Inc**   | 7,50 %  | 15.03.2031            | 574.507          | 0,01                         |
| 2.110.000  | Benteler International AG**  | 10,50 % | 15.05.2028            | 2.220.268        | 0,05                         |
| 860.000  | Block Inc**  | 6,50 %  | 15.05.2032            | 869.377          | 0,02                         |
| 235.000  | BNP Paribas SA*  | 4,50 %  | 31.12.2149            | 198.873          | 0,00                         |
| 270.000  | BNP Paribas SA**   | 4,63 %  | 31.12.2149            | 228.254          | 0,01                         |
| 464.000  | BNP Paribas SA*  | 7,38 %  | 31.12.2149            | 467.616          | 0,01                         |
| 470.000  | BNP Paribas SA**   | 9,25 %  | 31.12.2149            | 502.809          | 0,01                         |
| 890.000  | BNP Paribas SA REG S*  | 4,63 %  | 31.12.2149            | 838.245          | 0,02                         |
| 1.395.000  | Bombardier Inc**   | 7,00 %  | 01.06.2032            | 1.420.823        | 0,03                         |
| 935.000  | Bombardier Inc**   | 7,25 %  | 01.07.2031            | 965.412          | 0,02                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 25,00 % (31. Dezember 2023: 26,53 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 1.250.000  | Bonanza RE Ltd**  | 9,78 %  | 19.12.2027            | 1.250.000        | 0,03                         |
| 1.460.000  | Boost Newco Borrower LLC**  | 7,50 %  | 15.01.2031            | 1.531.766        | 0,03                         |
| 195.049  | Borr IHC Ltd/Borr Finance LLC**   | 10,38 % | 15.11.2030            | 194.754          | 0,00                         |
| 1.420.000  | BPCE SA**   | 3,65 %  | 14.01.2037            | 1.188.884        | 0,03                         |
| 2.335.000  | BPCE SA**   | 5,94 %  | 30.05.2035            | 2.315.453        | 0,05                         |
| 2.160.000  | BPCE SA**   | 7,00 %  | 19.10.2034            | 2.302.983        | 0,05                         |
| 2.160.000  | BPCE SA 144A**  | 7,00 %  | 19.10.2034            | 2.302.983        | 0,05                         |
| 1.750.000  | Bridge Street Re Ltd**  | 8,28 %  | 07.01.2028            | 1.750.000        | 0,04                         |
| 3.500.000  | Brixmor Operating Partnership LP*   | 5,75 %  | 15.02.2035            | 3.536.713        | 0,08                         |
| 11.595.000   | Broadcom Inc**  | 3,14 %  | 15.11.2035            | 9.474.212        | 0,20                         |
| 1.185.000  | BroadStreet Partners Inc**  | 5,88 %  | 15.04.2029            | 1.152.521        | 0,03                         |
| 230.000  | C&W Senior Finance Ltd**  | 6,88 %  | 15.09.2027            | 228.187          | 0,01                         |
| 365.000  | Calderys Financing II LLC**   | 11,75 % | 01.06.2028            | 371.599          | 0,01                         |
| 235.000  | Calderys Financing LLC**  | 11,25 % | 01.06.2028            | 251.836          | 0,01                         |
| 812.000  | Calpine Corp**  | 4,63 %  | 01.02.2029            | 767.210          | 0,02                         |
| 1.044.000  | Calpine Corp**  | 5,00 %  | 01.02.2031            | 982.503          | 0,02                         |
| 210.000  | Calpine Corp**  | 5,13 %  | 15.03.2028            | 203.829          | 0,00                         |
| 835.000  | Camelot Return Merger Sub Inc**   | 8,75 %  | 01.08.2028            | 801.047          | 0,02                         |
| 640.000  | Capital One Financial Corp**  | 5,70 %  | 01.02.2030            | 648.980          | 0,01                         |
| 540.000  | Carnival Corp**   | 6,00 %  | 01.05.2029            | 539.136          | 0,01                         |
| 710.000  | Carnival Holdings Bermuda Ltd**   | 10,38 % | 01.05.2028            | 756.943          | 0,02                         |
| 119.502  | Carvana Co**  | 9,00 %  | 01.12.2028            | 127.713          | 0,00                         |
| 345.000  | Carvana Co**  | 13,00 % | 01.06.2030            | 379.145          | 0,01                         |
| 1.020.000  | Carvana Co**  | 14,00 % | 01.06.2031            | 1.223.982        | 0,03                         |
| 255.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                | 4,25 %  | 01.02.2031            | 222.550          | 0,01                         |
| 730.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                | 4,25 %  | 15.01.2034            | 593.085          | 0,01                         |
| 945.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                | 4,50 %  | 15.08.2030            | 849.353          | 0,02                         |
| 2.305.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                | 4,50 %  | 01.05.2032            | 1.985.337        | 0,04                         |
| 190.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                | 4,50 %  | 01.06.2033            | 160.078          | 0,00                         |
| 1.310.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                | 4,75 %  | 01.03.2030            | 1.197.761        | 0,03                         |
| 640.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                | 5,00 %  | 01.02.2028            | 617.433          | 0,01                         |
| 720.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                | 5,38 %  | 01.06.2029            | 689.242          | 0,02                         |
| 485.000  | CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**                                | 6,38 %  | 01.09.2029            | 481.392          | 0,01                         |
| 605.000  | Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co/Magnum Management Corp/Millennium Op** | 5,25 %  | 15.07.2029            | 581.989          | 0,01                         |
| 725.000  | Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co/Magnum Management Corp/Millennium Op*  | 5,38 %  | 15.04.2027            | 717.838          | 0,02                         |
| 970.000  | Celulosa Arauco y Constitucion SA**   | 4,20 %  | 29.01.2030            | 901.376          | 0,02                         |
| 3.330.000  | Cemex SAB de CV**   | 9,13 %  | 31.12.2149            | 3.437.193        | 0,07                         |
| 8.950.000  | CenterPoint Energy Inc**  | 6,70 %  | 15.05.2055            | 8.922.840        | 0,19                         |
| 2.000.000  | Champions Financing Inc**   | 8,75 %  | 15.02.2029            | 1.952.319        | 0,04                         |
| 3.803.000  | Charles Schwab Corp**   | 4,00 %  | 31.12.2149            | 3.682.996        | 0,08                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 25,00 % (31. Dezember 2023: 26,53 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 1.655.000  | Charles Schwab Corp**   | 5,00 %  | 31.12.2149            | 1.610.749        | 0,04                         |
| 2.804.000  | Charles Schwab Corp Series H**  | 4,00 %  | 31.12.2149            | 2.424.201        | 0,05                         |
| 775.000  | Chart Industries Inc**  | 7,50 %  | 01.01.2030            | 806.719          | 0,02                         |
| 160.000  | Chart Industries Inc**  | 9,50 %  | 01.01.2031            | 172.122          | 0,00                         |
| 4.360.000  | Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital** | 3,90 %  | 01.06.2052            | 2.808.047        | 0,06                         |
| 1.990.000  | Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital** | 4,80 %  | 01.03.2050            | 1.496.907        | 0,03                         |
| 260.000  | CHS/Community Health Systems Inc**  | 10,88 % | 15.01.2032            | 268.574          | 0,01                         |
| 1.110.000  | Churchill Downs Inc**   | 6,75 %  | 01.05.2031            | 1.123.393        | 0,02                         |
| 4.191.000  | Citigroup Inc**   | 3,88 %  | 31.12.2149            | 4.079.604        | 0,09                         |
| 1.650.000  | Citigroup Inc**   | 4,15 %  | 31.12.2149            | 1.573.179        | 0,03                         |
| 2.930.000  | Citigroup Inc**   | 7,00 %  | 31.12.2149            | 3.097.230        | 0,07                         |
| 2.425.000  | Citigroup Inc**   | 7,13 %  | 31.12.2149            | 2.476.113        | 0,05                         |
| 294.000  | Citizens Financial Group Inc**  | 7,85 %  | 31.12.2149            | 294.565          | 0,01                         |
| 393.000  | Citizens Financial Group Inc**  | 8,01 %  | 31.12.2149            | 392.111          | 0,01                         |
| 385.000  | Civitas Resources Inc**   | 8,38 %  | 01.07.2028            | 400.330          | 0,01                         |
| 525.000  | Civitas Resources Inc**   | 8,63 %  | 01.11.2030            | 550.282          | 0,01                         |
| 2.775.000  | Clear Channel Outdoor Holdings Inc**  | 5,13 %  | 15.08.2027            | 2.674.290        | 0,06                         |
| 550.000  | Cleveland-Cliffs Inc**  | 6,88 %  | 01.11.2029            | 544.731          | 0,01                         |
| 1.520.000  | Cleveland-Cliffs Inc**  | 7,00 %  | 15.03.2032            | 1.494.708        | 0,03                         |
| 840.000  | Cleveland-Cliffs Inc**  | 7,38 %  | 01.05.2033            | 826.045          | 0,02                         |
| 1.235.000  | Cloud Software Group Inc**  | 6,50 %  | 31.03.2029            | 1.213.743        | 0,03                         |
| 340.000  | Cloud Software Group Inc**  | 8,25 %  | 30.06.2032            | 350.878          | 0,01                         |
| 215.000  | Cloud Software Group Inc**  | 9,00 %  | 30.09.2029            | 218.557          | 0,00                         |
| 671.000  | Comision Federal de Electricidad**  | 3,88 %  | 26.07.2033            | 541.380          | 0,01                         |
| 1.110.000  | Comision Federal de Electricidad**  | 5,70 %  | 24.01.2030            | 1.066.432        | 0,02                         |
| 1.110.000  | Comision Federal de Electricidad**  | 6,45 %  | 24.01.2035            | 1.048.913        | 0,02                         |
| 4.600.000  | Commerzbank AG*   | 7,50 %  | 31.12.2149            | 4.607.792        | 0,10                         |
| 845.000  | CommonSpirit Health**   | 4,19 %  | 01.10.2049            | 662.790          | 0,01                         |
| 770.000  | CommScope LLC**   | 9,50 %  | 15.12.2031            | 799.137          | 0,02                         |
| 285.000  | Community Health Systems Inc**  | 5,63 %  | 15.03.2027            | 273.837          | 0,01                         |
| 390.000  | Community Health Systems Inc**  | 6,00 %  | 15.01.2029            | 349.632          | 0,01                         |
| 1.945.000  | Comstock Resources Inc**  | 6,75 %  | 01.03.2029            | 1.897.994        | 0,04                         |
| 890.000  | Consolidated Communications Inc**   | 6,50 %  | 01.10.2028            | 858.510          | 0,02                         |
| 1.155.000  | Constellation Energy Generation LLC**   | 6,50 %  | 01.10.2053            | 1.224.935        | 0,03                         |
| 210.000  | Cornerstone Building Brands Inc**   | 6,13 %  | 15.01.2029            | 167.777          | 0,00                         |
| 575.000  | Cornerstone Building Brands Inc**   | 9,50 %  | 15.08.2029            | 560.342          | 0,01                         |
| 1.350.000  | Corp Nacional del Cobre de Chile*   | 3,15 %  | 14.01.2030            | 1.202.519        | 0,03                         |
| 400.000  | Corp Nacional del Cobre de Chile**  | 6,44 %  | 26.01.2036            | 408.475          | 0,01                         |
| 400.000  | Cosan Luxembourg SA**   | 7,25 %  | 27.06.2031            | 393.192          | 0,01                         |
| 409.000  | Coty Inc**  | 5,00 %  | 15.04.2026            | 408.501          | 0,01                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                    | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 25,00 % (31. Dezember 2023: 26,53 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 1.545.000  | Cougar JV Subsidiary LLC**               | 8,00 %  | 15.05.2032            | 1.605.256        | 0,03                         |
| 565.000  | Country Garden Holdings Co Ltd**         | 4,80 %  | 06.08.2030            | 59.862           | 0,00                         |
| 2.175.000  | CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC** | 5,50 %  | 15.06.2031            | 2.079.099        | 0,05                         |
| 245.000  | CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC** | 7,50 %  | 15.12.2033            | 257.822          | 0,01                         |
| 520.000  | Crescent Energy Finance LLC**            | 7,38 %  | 15.01.2033            | 505.494          | 0,01                         |
| 40.000   | Crescent Energy Finance LLC**            | 7,63 %  | 01.04.2032            | 39.831           | 0,00                         |
| 1.639.000  | Crown Castle Towers LLC†                 | 3,66 %  | 15.05.2025            | 1.630.637        | 0,04                         |
| 3.857.000  | Crown Castle Towers LLC**                | 4,24 %  | 15.07.2028            | 3.716.470        | 0,08                         |
| 345.000  | CSC Holdings LLC**                       | 4,13 %  | 01.12.2030            | 249.114          | 0,01                         |
| 415.000  | CSC Holdings LLC**                       | 4,63 %  | 01.12.2030            | 217.305          | 0,00                         |
| 195.000  | CSC Holdings LLC**                       | 5,00 %  | 15.11.2031            | 101.768          | 0,00                         |
| 245.000  | CSC Holdings LLC**                       | 5,38 %  | 01.02.2028            | 211.630          | 0,00                         |
| 310.000  | CSC Holdings LLC**                       | 5,50 %  | 15.04.2027            | 277.797          | 0,01                         |
| 435.000  | CSC Holdings LLC**                       | 5,75 %  | 15.01.2030            | 247.957          | 0,01                         |
| 195.000  | CSC Holdings LLC**                       | 6,50 %  | 01.02.2029            | 164.444          | 0,00                         |
| 205.000  | CSC Holdings LLC**                       | 7,50 %  | 01.04.2028            | 141.356          | 0,00                         |
| 275.000  | CSC Holdings LLC**                       | 11,25 % | 15.05.2028            | 271.724          | 0,01                         |
| 655.000  | CSC Holdings LLC**                       | 11,75 % | 31.01.2029            | 647.272          | 0,01                         |
| 1.290.000  | CSN Inova Ventures**                     | 6,75 %  | 28.01.2028            | 1.207.842        | 0,03                         |
| 735.000  | Cushman & Wakefield US Borrower LLC**    | 6,75 %  | 15.05.2028            | 736.355          | 0,02                         |
| 6.355.000  | CVS Health Corp**                        | 7,00 %  | 10.03.2055            | 6.392.210        | 0,14                         |
| 635.000  | Dealer Tire LLC/DT Issuer LLC**          | 8,00 %  | 01.02.2028            | 624.455          | 0,01                         |
| 5.780.000  | Deutsche Bank AG**                       | 5,40 %  | 11.09.2035            | 5.480.114        | 0,12                         |
| 4.400.000  | Deutsche Bank AG**                       | 6,00 %  | 31.12.2149            | 4.321.086        | 0,09                         |
| 5.490.000  | Diamondback Energy Inc**                 | 5,75 %  | 18.04.2054            | 5.156.579        | 0,11                         |
| 2.645.000  | Diamondback Energy Inc†                  | 6,25 %  | 15.03.2053            | 2.641.023        | 0,06                         |
| 385.000  | DISH DBS Corp**                          | 5,13 %  | 01.06.2029            | 248.186          | 0,01                         |
| 510.000  | DISH Network Corp**                      | 11,75 % | 15.11.2027            | 540.802          | 0,01                         |
| 565.000  | Dominion Energy Inc**                    | 4,35 %  | 31.12.2149            | 549.902          | 0,01                         |
| 6.835.000  | Dominion Energy Inc**                    | 6,63 %  | 15.05.2055            | 6.965.986        | 0,15                         |
| 155.000  | DT Midstream Inc**                       | 4,13 %  | 15.06.2029            | 144.860          | 0,00                         |
| 280.000  | DT Midstream Inc**                       | 4,38 %  | 15.06.2031            | 255.680          | 0,01                         |
| 2.770.000  | Duke Energy Corp**                       | 6,45 %  | 01.09.2054            | 2.810.573        | 0,06                         |
| 1.875.000  | Eastern Energy Gas Holdings LLC†         | 5,65 %  | 15.10.2054            | 1.770.371        | 0,04                         |
| 1.940.000  | Ecopetrol SA**                           | 4,63 %  | 02.11.2031            | 1.610.356        | 0,03                         |
| 2.500.000  | Ecopetrol SA**                           | 5,88 %  | 28.05.2045            | 1.724.239        | 0,04                         |
| 830.000  | Ecopetrol SA†                            | 8,38 %  | 19.01.2036            | 801.135          | 0,02                         |
| 1.000.000  | Ecopetrol SA†                            | 8,88 %  | 13.01.2033            | 1.019.768        | 0,02                         |
| 2.535.000  | Edison International**                   | 5,00 %  | 31.12.2149            | 2.477.270        | 0,05                         |
| 1.865.000  | Electricite de France SA**               | 9,13 %  | 31.12.2149            | 2.108.297        | 0,05                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung  | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 25,00 % (31. Dezember 2023: 26,53 %) (Fortsetzung)</b> |  |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |        |                       |                  |                              |
| 355.000  | Ellucian Holdings Inc**  | 6,50 % | 01.12.2029            | 356.038          | 0,01                         |
| 870.000  | Emirates NBD Bank PJSC*  | 6,13 % | 31.12.2149            | 869.782          | 0,02                         |
| 235.000  | EMRLD Borrower LP/Emerald Co-Issuer Inc**                          | 6,75 % | 15.07.2031            | 237.005          | 0,01                         |
| 1.600.000  | Enbridge Inc**   | 8,25 % | 15.01.2084            | 1.677.019        | 0,04                         |
| 6.750.000  | Energy Transfer LP*  | 5,95 % | 15.05.2054            | 6.529.765        | 0,14                         |
| 3.135.000  | EOG Resources Inc*   | 5,65 % | 01.12.2054            | 3.072.867        | 0,07                         |
| 345.000  | EQM Midstream Partners LP**  | 7,50 % | 01.06.2030            | 368.373          | 0,01                         |
| 4.105.000  | Evergy Inc**   | 6,65 % | 01.06.2055            | 4.114.089        | 0,09                         |
| 415.000  | FIEMEX Energia - Banco Actinver SA Institucion de Banca Multiple** | 7,25 % | 31.01.2041            | 406.990          | 0,01                         |
| 1.055.000  | Fifth Third Bancorp**  | 1,71 % | 01.11.2027            | 996.419          | 0,02                         |
| 3.570.000  | Fifth Third Bancorp**  | 4,34 % | 25.04.2033            | 3.318.024        | 0,07                         |
| 531.000  | Fifth Third Bancorp**  | 7,62 % | 31.12.2149            | 532.401          | 0,01                         |
| 300.000  | FMG Resources August 2006 Pty Ltd**                                | 4,38 % | 01.04.2031            | 270.312          | 0,01                         |
| 150.000  | FMG Resources August 2006 Pty Ltd**                                | 4,50 % | 15.09.2027            | 145.272          | 0,00                         |
| 1.115.000  | FMG Resources August 2006 Pty Ltd**                                | 6,13 % | 15.04.2032            | 1.102.377        | 0,02                         |
| 805.000  | Focus Financial Partners LLC**                                     | 6,75 % | 15.09.2031            | 802.687          | 0,02                         |
| 670.000  | Fortrea Holdings Inc**   | 7,50 % | 01.07.2030            | 671.949          | 0,01                         |
| 2.535.000  | Fortress Intermediate 3 Inc**                                      | 7,50 % | 01.06.2031            | 2.588.035        | 0,06                         |
| 2.030.000  | Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC**           | 7,00 % | 15.06.2032            | 2.072.488        | 0,04                         |
| 5.100.000  | Foundry JV Holdco LLC**  | 6,25 % | 25.01.2035            | 5.139.090        | 0,11                         |
| 1.250.000  | Four Lakes Re Ltd**  | 9,78 % | 07.01.2028            | 1.250.000        | 0,03                         |
| 2.650.000  | Fox Corp**   | 6,50 % | 13.10.2033            | 2.793.892        | 0,06                         |
| 170.000  | Freedom Mortgage Corp**  | 6,63 % | 15.01.2027            | 170.207          | 0,00                         |
| 160.000  | Freedom Mortgage Holdings LLC**                                    | 9,13 % | 15.05.2031            | 165.171          | 0,00                         |
| 165.000  | Freedom Mortgage Holdings LLC**                                    | 9,25 % | 01.02.2029            | 170.438          | 0,00                         |
| 420.000  | Frontier Communications Holdings LLC**                             | 5,00 % | 01.05.2028            | 410.911          | 0,01                         |
| 285.000  | Frontier Communications Holdings LLC**                             | 5,88 % | 15.10.2027            | 284.316          | 0,01                         |
| 290.000  | Frontier Communications Holdings LLC**                             | 5,88 % | 01.11.2029            | 288.642          | 0,01                         |
| 175.000  | Frontier Communications Holdings LLC**                             | 8,75 % | 15.05.2030            | 185.099          | 0,00                         |
| 1.660.000  | FS Luxembourg Sarl*  | 8,88 % | 12.02.2031            | 1.685.563        | 0,04                         |
| 10.090.000   | GA Global Funding Trust**  | 5,20 % | 09.12.2031            | 9.845.482        | 0,21                         |
| 990.000  | Garda World Security Corp**  | 7,75 % | 15.02.2028            | 1.022.449        | 0,02                         |
| 1.525.000  | Garda World Security Corp**  | 8,25 % | 01.08.2032            | 1.551.640        | 0,03                         |
| 1.085.000  | Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp*                     | 7,75 % | 01.02.2028            | 1.087.333        | 0,02                         |
| 113.000  | Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp*                     | 7,88 % | 15.05.2032            | 110.770          | 0,00                         |
| 81.000   | Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp*                     | 8,00 % | 15.01.2027            | 82.488           | 0,00                         |
| 2.580.000  | Geopark Ltd**  | 5,50 % | 17.01.2027            | 2.477.245        | 0,05                         |
| 845.000  | Georgetown University**  | 2,94 % | 01.04.2050            | 546.824          | 0,01                         |
| 465.000  | Global Aircraft Leasing Co Ltd**                                   | 8,75 % | 01.09.2027            | 474.831          | 0,01                         |
| 4.945.000  | Global Atlantic Finance Co**                                       | 7,95 % | 15.10.2054            | 5.184.847        | 0,11                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 25,00 % (31. Dezember 2023: 26,53 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 695.000  | Goat Holdco LLC**   | 6,75 %  | 01.02.2032            | 688.978          | 0,02                         |
| 460.000  | Goldman Sachs Group Inc**   | 3,65 %  | 31.12.2149            | 440.635          | 0,01                         |
| 570.000  | Goldman Sachs Group Inc**   | 3,80 %  | 31.12.2149            | 551.084          | 0,01                         |
| 565.000  | Goldman Sachs Group Inc**   | 4,13 %  | 31.12.2149            | 540.692          | 0,01                         |
| 3.170.000  | Goldman Sachs Group Inc**   | 6,13 %  | 31.12.2149            | 3.137.077        | 0,07                         |
| 2.600.000  | Goldman Sachs Group Inc**   | 7,50 %  | 31.12.2149            | 2.718.858        | 0,06                         |
| 2.170.000  | Goodyear Tire & Rubber Co**   | 5,00 %  | 15.07.2029            | 1.994.976        | 0,04                         |
| 1.665.000  | Gran Tierra Energy Inc**  | 9,50 %  | 15.10.2029            | 1.552.696        | 0,03                         |
| 725.000  | Group 1 Automotive Inc**  | 6,38 %  | 15.01.2030            | 728.261          | 0,02                         |
| 590.000  | Grupo Aval Ltd*   | 4,38 %  | 04.02.2030            | 520.136          | 0,01                         |
| 1.210.000  | Harvest Midstream I LP**  | 7,50 %  | 01.09.2028            | 1.221.817        | 0,03                         |
| 2.335.000  | HCA Inc*  | 5,45 %  | 01.04.2031            | 2.331.161        | 0,05                         |
| 2.755.000  | HCA Inc*  | 5,50 %  | 01.06.2033            | 2.726.732        | 0,06                         |
| 310.000  | Heartland Dental LLC/Heartland Dental Finance Corp**                        | 10,50 % | 30.04.2028            | 329.052          | 0,01                         |
| 1.500.000  | Herbie Re Ltd**   | 11,53 % | 08.01.2029            | 1.501.772        | 0,03                         |
| 1.000.000  | Herbie Re Ltd**   | 15,03 % | 08.01.2029            | 1.002.411        | 0,02                         |
| 1.610.000  | Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co**                                    | 6,88 %  | 15.05.2034            | 1.506.668        | 0,03                         |
| 830.000  | Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co**                                    | 8,38 %  | 01.11.2033            | 848.055          | 0,02                         |
| 180.000  | Hillenbrand Inc*  | 3,75 %  | 01.03.2031            | 157.481          | 0,00                         |
| 810.000  | Hillenbrand Inc*  | 6,25 %  | 15.02.2029            | 810.486          | 0,02                         |
| 1.155.000  | Howard Midstream Energy Partners LLC**                                      | 7,38 %  | 15.07.2032            | 1.174.533        | 0,03                         |
| 210.000  | Howden UK Refinance Plc/Howden UK Refinance 2 Plc/Howden US Refinance LLC** | 7,25 %  | 15.02.2031            | 213.640          | 0,00                         |
| 315.000  | Howden UK Refinance Plc/Howden UK Refinance 2 Plc/Howden US Refinance LLC** | 8,13 %  | 15.02.2032            | 322.044          | 0,01                         |
| 630.000  | HSBC Holdings Plc*  | 4,00 %  | 31.12.2149            | 615.915          | 0,01                         |
| 560.000  | HSBC Holdings Plc**   | 4,70 %  | 31.12.2149            | 494.843          | 0,01                         |
| 781.000  | HSBC Holdings Plc**   | 6,38 %  | 31.12.2149            | 782.136          | 0,02                         |
| 980.000  | HSBC Holdings Plc**   | 8,00 %  | 31.12.2149            | 1.030.529        | 0,02                         |
| 3.015.000  | HUB International Ltd**   | 7,25 %  | 15.06.2030            | 3.092.848        | 0,07                         |
| 280.000  | HUB International Ltd**   | 7,38 %  | 31.01.2032            | 284.558          | 0,01                         |
| 585.000  | Hudbay Minerals Inc**   | 4,50 %  | 01.04.2026            | 577.169          | 0,01                         |
| 620.000  | Hudbay Minerals Inc**   | 6,13 %  | 01.04.2029            | 623.005          | 0,01                         |
| 1.461.000  | Huntington Bancshares Inc**   | 4,45 %  | 31.12.2149            | 1.399.504        | 0,03                         |
| 284.000  | Huntington Bancshares Inc**   | 5,63 %  | 31.12.2149            | 278.589          | 0,01                         |
| 2.580.000  | Huntington Bancshares Inc**   | 5,71 %  | 02.02.2035            | 2.576.332        | 0,06                         |
| 565.000  | Iliad Holding SASU**  | 7,00 %  | 15.10.2028            | 573.032          | 0,01                         |
| 165.000  | Iliad Holding SASU**  | 7,00 %  | 15.04.2032            | 166.041          | 0,00                         |
| 1.625.000  | Imola Merger Corp**   | 4,75 %  | 15.05.2029            | 1.542.321        | 0,03                         |
| 745.000  | INEOS Finance Plc*  | 6,75 %  | 15.05.2028            | 753.059          | 0,02                         |
| 1.020.000  | INEOS Finance Plc**   | 7,50 %  | 15.04.2029            | 1.045.369        | 0,02                         |
| 2.358.000  | ING Groep NV**  | 3,88 %  | 31.12.2149            | 2.147.722        | 0,05                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                      | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 25,00 % (31. Dezember 2023: 26,53 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 6.010.000  | ING Groep NV**   | 4,25 %  | 31.12.2149            | 4.895.017        | 0,11                         |
| 1.202.000  | ING Groep NV*  | 5,75 %  | 31.12.2149            | 1.187.150        | 0,03                         |
| 970.000  | Ingersoll Rand Inc*  | 5,70 %  | 14.08.2033            | 993.042          | 0,02                         |
| 1.170.000  | Intel Corp**   | 3,25 %  | 15.11.2049            | 699.022          | 0,02                         |
| 5.130.000  | Intel Corp**   | 4,75 %  | 25.03.2050            | 3.970.244        | 0,09                         |
| 1.735.000  | Intel Corp**   | 4,90 %  | 05.08.2052            | 1.370.940        | 0,03                         |
| 1.545.000  | Intel Corp**   | 5,70 %  | 10.02.2053            | 1.367.377        | 0,03                         |
| 1.685.000  | Intesa Sanpaolo SpA**                                      | 7,78 %  | 20.06.2054            | 1.804.001        | 0,04                         |
| 495.000  | Intesa Sanpaolo SpA 144A**                                 | 7,78 %  | 20.06.2054            | 529.258          | 0,01                         |
| 790.000  | Iron Mountain Inc**  | 5,25 %  | 15.03.2028            | 773.350          | 0,02                         |
| 520.000  | Iron Mountain Inc**  | 5,63 %  | 15.07.2032            | 497.125          | 0,01                         |
| 275.000  | Iron Mountain Information Management Services Inc**        | 5,00 %  | 15.07.2032            | 253.389          | 0,01                         |
| 615.000  | ITT Holdings LLC**   | 6,50 %  | 01.08.2029            | 563.607          | 0,01                         |
| 535.000  | Jane Street Group/JSJ Finance Inc**                        | 6,13 %  | 01.11.2032            | 530.400          | 0,01                         |
| 1.090.000  | JBS USA Holding Lux Sarl/JBS USA Food Co/JBS Lux Co Sarl** | 6,50 %  | 01.12.2052            | 1.109.496        | 0,02                         |
| 1.330.000  | JELD-WEN Inc**   | 4,88 %  | 15.12.2027            | 1.265.150        | 0,03                         |
| 600.000  | JELD-WEN Inc**   | 7,00 %  | 01.09.2032            | 557.610          | 0,01                         |
| 3.455.000  | JPMorgan Chase & Co**                                      | 2,18 %  | 01.06.2028            | 3.245.985        | 0,07                         |
| 3.415.000  | JPMorgan Chase & Co**                                      | 3,33 %  | 22.04.2052            | 2.337.215        | 0,05                         |
| 936.000  | JPMorgan Chase & Co**                                      | 4,60 %  | 31.12.2149            | 934.162          | 0,02                         |
| 6.000.000  | JPMorgan Chase & Co**                                      | 6,88 %  | 31.12.2149            | 6.280.430        | 0,14                         |
| 1.670.000  | Kaiser Aluminum Corp**                                     | 4,63 %  | 01.03.2028            | 1.572.062        | 0,03                         |
| 3.130.000  | KazMunayGas National Co JSC*                               | 5,75 %  | 19.04.2047            | 2.707.498        | 0,06                         |
| 490.000  | KazMunayGas National Co JSC*                               | 6,38 %  | 24.10.2048            | 456.270          | 0,01                         |
| 700.000  | KB Home*   | 4,00 %  | 15.06.2031            | 618.583          | 0,01                         |
| 445.000  | KB Home**  | 7,25 %  | 15.07.2030            | 456.788          | 0,01                         |
| 2.850.000  | Kinder Morgan Inc*   | 5,55 %  | 01.06.2045            | 2.667.279        | 0,06                         |
| 1.400.000  | Kinetik Holdings LP**                                      | 5,88 %  | 15.06.2030            | 1.379.069        | 0,03                         |
| 1.765.000  | Las Vegas Sands Corp*                                      | 6,20 %  | 15.08.2034            | 1.775.873        | 0,04                         |
| 155.000  | Level 3 Financing Inc**                                    | 3,75 %  | 15.07.2029            | 122.837          | 0,00                         |
| 120.000  | Level 3 Financing Inc**                                    | 4,50 %  | 01.04.2030            | 100.098          | 0,00                         |
| 340.000  | Level 3 Financing Inc**                                    | 4,88 %  | 15.06.2029            | 297.500          | 0,01                         |
| 475.000  | Level 3 Financing Inc**                                    | 10,50 % | 15.05.2030            | 519.650          | 0,01                         |
| 235.000  | Level 3 Financing Inc**                                    | 10,75 % | 15.12.2030            | 263.353          | 0,01                         |
| 161.383  | Level 3 Financing Inc**                                    | 11,00 % | 15.11.2029            | 181.745          | 0,00                         |
| 485.000  | Liberty Mutual Group Inc**                                 | 4,13 %  | 15.12.2051            | 461.807          | 0,01                         |
| 1.280.000  | LifePoint Health Inc**                                     | 9,88 %  | 15.08.2030            | 1.382.665        | 0,03                         |
| 610.000  | LifePoint Health Inc**                                     | 10,00 % | 01.06.2032            | 620.978          | 0,01                         |
| 875.000  | Light & Wonder International Inc**                         | 7,25 %  | 15.11.2029            | 893.994          | 0,02                         |
| 2.887.000  | Lightning Power LLC**                                      | 7,25 %  | 15.08.2032            | 2.976.838        | 0,06                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                     | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 25,00 % (31. Dezember 2023: 26,53 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 6.385.000  | Lloyds Banking Group Plc*                                 | 5,59 %  | 26.11.2035            | 6.333.768        | 0,14                         |
| 110.000  | Lloyds Banking Group Plc**                                | 7,50 %  | 31.12.2149            | 111.140          | 0,00                         |
| 1.315.000  | Lloyds Banking Group Plc**                                | 8,00 %  | 31.12.2149            | 1.368.456        | 0,03                         |
| 1.000.000  | Logistics Re Ltd**  | 10,28 % | 21.12.2027            | 1.015.400        | 0,02                         |
| 255.000  | Lumen Technologies Inc**                                  | 4,13 %  | 15.04.2029            | 231.329          | 0,01                         |
| 5.835.000  | M&T Bank Corp**   | 3,50 %  | 31.12.2149            | 5.552.497        | 0,12                         |
| 1.475.000  | M&T Bank Corp**   | 6,08 %  | 13.03.2032            | 1.512.504        | 0,03                         |
| 225.000  | Macy's Retail Holdings LLC*                               | 4,50 %  | 15.12.2034            | 187.664          | 0,00                         |
| 145.000  | Macy's Retail Holdings LLC*                               | 5,13 %  | 15.01.2042            | 108.944          | 0,00                         |
| 555.000  | Macy's Retail Holdings LLC**                              | 5,88 %  | 15.03.2030            | 533.182          | 0,01                         |
| 1.220.000  | Madison IAQ LLC**   | 5,88 %  | 30.06.2029            | 1.153.308        | 0,03                         |
| 255.000  | Magnera Corp**  | 7,25 %  | 15.11.2031            | 249.259          | 0,01                         |
| 580.000  | Manitowoc Co Inc**  | 9,25 %  | 01.10.2031            | 595.238          | 0,01                         |
| 5.515.000  | Marvell Technology Inc**                                  | 5,95 %  | 15.09.2033            | 5.728.262        | 0,12                         |
| 535.000  | Masterbrand Inc**   | 7,00 %  | 15.07.2032            | 539.356          | 0,01                         |
| 2.495.000  | Mauser Packaging Solutions Holding Co**                   | 9,25 %  | 15.04.2027            | 2.535.334        | 0,05                         |
| 520.000  | McAfee Corp**   | 7,38 %  | 15.02.2030            | 505.696          | 0,01                         |
| 645.000  | McGraw-Hill Education Inc**                               | 5,75 %  | 01.08.2028            | 630.477          | 0,01                         |
| 115.000  | McGraw-Hill Education Inc**                               | 7,38 %  | 01.09.2031            | 117.839          | 0,00                         |
| 1.115.000  | McGraw-Hill Education Inc**                               | 8,00 %  | 01.08.2029            | 1.116.395        | 0,02                         |
| 200.000  | Medco Bell Pte Ltd**                                      | 6,38 %  | 30.01.2027            | 200.049          | 0,00                         |
| 525.000  | Medco Bell Pte Ltd 144A**                                 | 6,38 %  | 30.01.2027            | 525.128          | 0,01                         |
| 1.065.000  | Medline Borrower LP**                                     | 3,88 %  | 01.04.2029            | 987.156          | 0,02                         |
| 1.350.000  | Medline Borrower LP**                                     | 5,25 %  | 01.10.2029            | 1.304.119        | 0,03                         |
| 915.000  | Melco Resorts Finance Ltd**                               | 5,63 %  | 17.07.2027            | 886.401          | 0,02                         |
| 530.000  | Merlin Entertainments Group US Holdings Inc**             | 7,38 %  | 15.02.2031            | 513.389          | 0,01                         |
| 215.000  | Metinvest BV**  | 7,65 %  | 01.10.2027            | 157.153          | 0,00                         |
| 900.000  | Metinvest BV**  | 7,75 %  | 17.10.2029            | 634.653          | 0,01                         |
| 575.000  | MGM Resorts International*                                | 6,13 %  | 15.09.2029            | 574.720          | 0,01                         |
| 810.000  | Midcontinent Communications**                             | 8,00 %  | 15.08.2032            | 832.987          | 0,02                         |
| 1.605.000  | Midwest Gaming Borrower LLC/Midwest Gaming Finance Corp** | 4,88 %  | 01.05.2029            | 1.514.239        | 0,03                         |
| 2.605.000  | Minerva Luxembourg SA**                                   | 8,88 %  | 13.09.2033            | 2.705.227        | 0,06                         |
| 1.075.000  | MIWD Holdco II LLC/MIWD Finance Corp**                    | 5,50 %  | 01.02.2030            | 1.018.105        | 0,02                         |
| 1.560.000  | Mizuho Financial Group Inc*                               | 1,55 %  | 09.07.2027            | 1.485.396        | 0,03                         |
| 1.285.000  | Molina Healthcare Inc**                                   | 3,88 %  | 15.11.2030            | 1.144.806        | 0,02                         |
| 170.000  | Molina Healthcare Inc**                                   | 6,25 %  | 15.01.2033            | 168.173          | 0,00                         |
| 1.750.000  | Mona Lisa Re Ltd**  | 12,28 % | 08.01.2029            | 1.750.000        | 0,04                         |
| 3.680.000  | Morgan Stanley**  | 5,25 %  | 21.04.2034            | 3.625.074        | 0,08                         |
| 2.085.000  | Morgan Stanley**  | 5,47 %  | 18.01.2035            | 2.074.362        | 0,05                         |
| 945.000  | Movida Europe SA**  | 7,85 %  | 11.04.2029            | 833.794          | 0,02                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung  | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 25,00 % (31. Dezember 2023: 26,53 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 248.193  | MV24 Capital BV*   | 6,75 %  | 01.06.2034            | 235.565          | 0,01                         |
| 1.000.000  | Mystic Re IV Ltd**   | 8,28 %  | 10.01.2028            | 1.000.000        | 0,02                         |
| 1.100.000  | Mystic Re IV Ltd**   | 14,53 % | 10.01.2028            | 1.100.000        | 0,02                         |
| 2.840.000  | Nationstar Mortgage Holdings Inc**   | 6,50 %  | 01.08.2029            | 2.838.128        | 0,06                         |
| 4.335.000  | Nationwide Building Society*   | 4,13 %  | 18.10.2032            | 4.165.125        | 0,09                         |
| 5.580.000  | NatWest Group Plc*   | 3,03 %  | 28.11.2035            | 4.827.609        | 0,10                         |
| 4.670.000  | NatWest Group Plc*   | 4,60 %  | 31.12.2149            | 3.978.448        | 0,09                         |
| 525.000  | NatWest Group Plc*   | 6,00 %  | 31.12.2149            | 523.477          | 0,01                         |
| 4.165.000  | NatWest Group Plc*   | 8,13 %  | 31.12.2149            | 4.446.250        | 0,10                         |
| 275.000  | NCL Corp Ltd**   | 5,88 %  | 15.03.2026            | 274.829          | 0,01                         |
| 555.000  | NCL Corp Ltd**   | 5,88 %  | 15.02.2027            | 553.669          | 0,01                         |
| 425.000  | Neptune Bidco US Inc**   | 9,29 %  | 15.04.2029            | 395.772          | 0,01                         |
| 235.000  | New Fortress Energy Inc**  | 6,50 %  | 30.09.2026            | 226.365          | 0,01                         |
| 1.035.000  | Noble Finance II LLC**   | 8,00 %  | 15.04.2030            | 1.046.366        | 0,02                         |
| 1.690.000  | Nordea Bank Abp**  | 3,75 %  | 31.12.2149            | 1.470.347        | 0,03                         |
| 190.000  | Northriver Midstream Finance LP**  | 6,75 %  | 15.07.2032            | 191.307          | 0,00                         |
| 590.000  | NOVA Chemicals Corp**  | 8,50 %  | 15.11.2028            | 625.701          | 0,01                         |
| 610.000  | NRG Energy Inc**   | 3,38 %  | 15.02.2029            | 553.995          | 0,01                         |
| 840.000  | NRG Energy Inc**   | 5,75 %  | 15.07.2029            | 820.780          | 0,02                         |
| 675.000  | NRG Energy Inc**   | 6,00 %  | 01.02.2033            | 656.114          | 0,01                         |
| 1.245.000  | NRG Energy Inc**   | 10,25 % | 31.12.2149            | 1.376.390        | 0,03                         |
| 530.000  | Olympus Water US Holding Corp**  | 4,25 %  | 01.10.2028            | 495.730          | 0,01                         |
| 190.000  | Olympus Water US Holding Corp**  | 6,25 %  | 01.10.2029            | 181.703          | 0,00                         |
| 1.345.000  | Olympus Water US Holding Corp**  | 7,25 %  | 15.06.2031            | 1.372.014        | 0,03                         |
| 590.000  | Olympus Water US Holding Corp**  | 9,75 %  | 15.11.2028            | 626.737          | 0,01                         |
| 1.050.000  | OneMain Finance Corp*  | 6,63 %  | 15.01.2028            | 1.063.818        | 0,02                         |
| 1.925.000  | OneMain Finance Corp*  | 7,13 %  | 15.11.2031            | 1.963.371        | 0,04                         |
| 725.000  | Optics Bidco SpA**   | 6,00 %  | 30.09.2034            | 699.653          | 0,02                         |
| 1.830.000  | Oracle Corp*   | 3,95 %  | 25.03.2051            | 1.357.000        | 0,03                         |
| 1.075.000  | Oztel Holdings SPC Ltd*  | 6,63 %  | 24.04.2028            | 1.110.147        | 0,02                         |
| 1.775.094  | Pacific Gas & Electric Co**  | 4,95 %  | 01.07.2050            | 1.543.538        | 0,03                         |
| 45.000   | Pactiv Evergreen Group Issuer Inc/Pactiv Evergreen Group Issuer LLC**          | 4,00 %  | 15.10.2027            | 44.664           | 0,00                         |
| 2.030.000  | Pactiv Evergreen Group Issuer LLC/Pactiv Evergreen Group Issuer Inc**          | 4,38 %  | 15.10.2028            | 2.030.276        | 0,04                         |
| 915.000  | Panther Escrow Issuer LLC**  | 7,13 %  | 01.06.2031            | 925.142          | 0,02                         |
| 1.515.000  | Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/PK Finance Co-Issuer** | 5,88 %  | 01.10.2028            | 1.481.694        | 0,03                         |
| 615.000  | Pebblebrook Hotel LP/PEB Finance Corp**  | 6,38 %  | 15.10.2029            | 609.345          | 0,01                         |
| 1.265.000  | Penn Entertainment Inc**   | 4,13 %  | 01.07.2029            | 1.135.617        | 0,02                         |
| 1.120.000  | PennyMac Financial Services Inc**  | 5,75 %  | 15.09.2031            | 1.067.920        | 0,02                         |
| 1.790.000  | Performance Food Group Inc**   | 5,50 %  | 15.10.2027            | 1.776.722        | 0,04                         |
| 370.000  | Performance Food Group Inc**   | 6,13 %  | 15.09.2032            | 370.446          | 0,01                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                    | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 25,00 % (31. Dezember 2023: 26,53 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 460.000  | Periama Holdings LLC**                                   | 5,95 %  | 19.04.2026            | 459.734          | 0,01                         |
| 725.000  | Perrigo Finance Unlimited Co*                            | 6,13 %  | 30.09.2032            | 709.841          | 0,02                         |
| 420.000  | Pertamina Persero PT*                                    | 6,45 %  | 30.05.2044            | 433.272          | 0,01                         |
| 830.000  | Petrobras Global Finance BV*                             | 6,00 %  | 13.01.2035            | 765.494          | 0,02                         |
| 970.000  | Petrobras Global Finance BV*                             | 6,50 %  | 03.07.2033            | 950.256          | 0,02                         |
| 762.400  | Petroleos de Venezuela SA*                               | 5,38 %  | 12.04.2027            | 83.102           | 0,00                         |
| 4.488.565  | Petroleos de Venezuela SA*                               | 6,00 %  | 16.05.2024            | 471.476          | 0,01                         |
| 2.302.978  | Petroleos de Venezuela SA**                              | 6,00 %  | 15.11.2026            | 241.903          | 0,01                         |
| 810.000  | Petroleos Mexicanos**                                    | 6,35 %  | 12.02.2048            | 532.752          | 0,01                         |
| 1.460.000  | Petroleos Mexicanos**                                    | 6,75 %  | 21.09.2047            | 1.004.798        | 0,02                         |
| 2.000.000  | Petroleos Mexicanos**                                    | 6,95 %  | 28.01.2060            | 1.374.779        | 0,03                         |
| 3.045.000  | Petroleos Mexicanos**                                    | 7,69 %  | 23.01.2050            | 2.299.614        | 0,05                         |
| 815.000  | PetSmart Inc/PetSmart Finance Corp**                     | 4,75 %  | 15.02.2028            | 769.894          | 0,02                         |
| 485.000  | PetSmart Inc/PetSmart Finance Corp**                     | 7,75 %  | 15.02.2029            | 469.420          | 0,01                         |
| 3.990.000  | Pine Street Trust III**                                  | 6,22 %  | 15.05.2054            | 4.031.431        | 0,09                         |
| 7.783.000  | PNC Financial Services Group Inc**                       | 3,40 %  | 31.12.2149            | 7.324.503        | 0,16                         |
| 685.000  | PNC Financial Services Group Inc**                       | 6,25 %  | 31.12.2149            | 693.161          | 0,02                         |
| 2.530.000  | PNC Financial Services Group Inc**                       | 6,88 %  | 20.10.2034            | 2.762.737        | 0,06                         |
| 300.000  | Post Holdings Inc**                                      | 6,25 %  | 15.10.2034            | 292.992          | 0,01                         |
| 1.870.000  | Post Holdings Inc**                                      | 6,38 %  | 01.03.2033            | 1.835.148        | 0,04                         |
| 600.000  | PPL Capital Funding Inc*                                 | 7,25 %  | 30.03.2067            | 601.032          | 0,01                         |
| 415.000  | Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc** | 5,75 %  | 15.04.2026            | 415.141          | 0,01                         |
| 1.070.000  | Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc** | 6,25 %  | 15.01.2028            | 1.065.366        | 0,02                         |
| 475.000  | Provident Funding Associates LP/PFG Finance Corp**       | 9,75 %  | 15.09.2029            | 488.521          | 0,01                         |
| 655.000  | Prudential Financial Inc**                               | 5,13 %  | 01.03.2052            | 624.131          | 0,01                         |
| 1.450.000  | Prudential Financial Inc**                               | 6,50 %  | 15.03.2054            | 1.494.899        | 0,03                         |
| 1.110.000  | Raizen Fuels Finance SA**                                | 6,95 %  | 05.03.2054            | 1.095.706        | 0,02                         |
| 1.095.000  | Rakuten Group Inc**                                      | 9,75 %  | 15.04.2029            | 1.188.814        | 0,03                         |
| 1.250.000  | Recoletos RE DAC**                                       | 9,28 %  | 07.01.2028            | 1.250.000        | 0,03                         |
| 1.000.000  | Residential Reinsurance 2004 Ltd**                       | 9,53 %  | 06.12.2028            | 1.020.550        | 0,02                         |
| 1.000.000  | Residential Reinsurance 2004 Ltd**                       | 11,28 % | 06.12.2028            | 1.028.300        | 0,02                         |
| 1.620.000  | Resideo Funding Inc**                                    | 6,50 %  | 15.07.2032            | 1.624.045        | 0,04                         |
| 775.000  | RHP Hotel Properties LP/RHP Finance Corp**               | 4,50 %  | 15.02.2029            | 733.117          | 0,02                         |
| 560.000  | RHP Hotel Properties LP/RHP Finance Corp**               | 4,75 %  | 15.10.2027            | 542.171          | 0,01                         |
| 620.000  | Ritchie Bros Holdings Inc**                              | 6,75 %  | 15.03.2028            | 634.657          | 0,01                         |
| 1.075.000  | Ritchie Bros Holdings Inc**                              | 7,75 %  | 15.03.2031            | 1.125.515        | 0,02                         |
| 810.000  | RLJ Lodging Trust LP**                                   | 3,75 %  | 01.07.2026            | 788.399          | 0,02                         |
| 1.100.000  | RLJ Lodging Trust LP**                                   | 4,00 %  | 15.09.2029            | 997.716          | 0,02                         |
| 2.170.000  | Rogers Communications Inc**                              | 3,80 %  | 15.03.2032            | 1.952.434        | 0,04                         |
| 375.000  | Royal Caribbean Cruises Ltd**                            | 5,50 %  | 01.04.2028            | 372.463          | 0,01                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung  | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 25,00 % (31. Dezember 2023: 26,53 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 455.000  | Royal Caribbean Cruises Ltd**                                | 5,63 %  | 30.09.2031            | 447.861          | 0,01                         |
| 1.065.000  | Royal Caribbean Cruises Ltd**                                | 6,00 %  | 01.02.2033            | 1.063.238        | 0,02                         |
| 370.000  | Ryan Specialty LLC**   | 5,88 %  | 01.08.2032            | 366.338          | 0,01                         |
| 1.000.000  | Sanders RE II Ltd**  | 8,28 %  | 07.04.2029            | 1.003.682        | 0,02                         |
| 1.000.000  | Sanders RE II Ltd**  | 9,53 %  | 07.04.2029            | 1.005.103        | 0,02                         |
| 1.190.000  | Saudi Arabian Oil Co <sup>†</sup>                            | 5,75 %  | 17.07.2054            | 1.114.993        | 0,02                         |
| 1.355.000  | SBA Tower Trust**  | 2,84 %  | 15.01.2025            | 1.353.623        | 0,03                         |
| 1.735.000  | Scientific Games Holdings LP/Scientific Games US FinCo Inc** | 6,63 %  | 01.03.2030            | 1.661.771        | 0,04                         |
| 930.000  | SeaWorld Parks & Entertainment Inc**                         | 5,25 %  | 15.08.2029            | 888.276          | 0,02                         |
| 2.875.000  | Sempra**   | 6,40 %  | 01.10.2054            | 2.857.824        | 0,06                         |
| 890.000  | Sensata Technologies BV**                                    | 5,88 %  | 01.09.2030            | 871.657          | 0,02                         |
| 340.000  | Service Properties Trust**                                   | 4,75 %  | 01.10.2026            | 321.982          | 0,01                         |
| 220.000  | Service Properties Trust**                                   | 5,25 %  | 15.02.2026            | 214.123          | 0,00                         |
| 295.000  | Service Properties Trust**                                   | 8,63 %  | 15.11.2031            | 308.328          | 0,01                         |
| 760.000  | Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp**                      | 4,75 %  | 15.02.2028            | 728.748          | 0,02                         |
| 1.050.000  | SierraCol Energy Andina LLC**                                | 6,00 %  | 15.06.2028            | 949.265          | 0,02                         |
| 155.000  | Six Flags Entertainment Corp**                               | 5,50 %  | 15.04.2027            | 154.143          | 0,00                         |
| 1.315.000  | Six Flags Entertainment Corp**                               | 7,25 %  | 15.05.2031            | 1.344.460        | 0,03                         |
| 155.000  | Six Flags Entertainment Corp/Six Flags Theme Parks Inc**     | 6,63 %  | 01.05.2032            | 157.220          | 0,00                         |
| 2.000.000  | Skandinaviska Enskilda Banken AB <sup>†</sup>                | 5,13 %  | 31.12.2149            | 1.990.000        | 0,05                         |
| 830.000  | Sociedad Quimica y Minera de Chile SA**                      | 5,50 %  | 10.09.2034            | 787.363          | 0,02                         |
| 10.315.000   | Southern Co**  | 4,00 %  | 15.01.2051            | 10.125.854       | 0,22                         |
| 1.350.000  | SPX FLOW Inc**   | 8,75 %  | 01.04.2030            | 1.384.911        | 0,03                         |
| 605.000  | Standard Industries Inc**                                    | 3,38 %  | 15.01.2031            | 519.229          | 0,01                         |
| 865.000  | Standard Industries Inc**                                    | 4,38 %  | 15.07.2030            | 793.196          | 0,02                         |
| 1.095.000  | Star Holding LLC**   | 8,75 %  | 01.08.2031            | 1.086.317        | 0,02                         |
| 1.130.000  | Star Parent Inc**  | 9,00 %  | 01.10.2030            | 1.175.030        | 0,03                         |
| 955.000  | Starwood Property Trust Inc**                                | 6,50 %  | 01.07.2030            | 956.833          | 0,02                         |
| 505.000  | Starwood Property Trust Inc**                                | 7,25 %  | 01.04.2029            | 518.662          | 0,01                         |
| 2.955.000  | State Street Corp**  | 1,75 %  | 06.02.2026            | 2.945.501        | 0,06                         |
| 1.580.000  | State Street Corp**  | 2,90 %  | 30.03.2026            | 1.572.278        | 0,03                         |
| 2.795.000  | Surgery Center Holdings Inc**                                | 7,25 %  | 15.04.2032            | 2.854.657        | 0,06                         |
| 3.533.000  | Sysco Corp <sup>†</sup>                                      | 6,60 %  | 01.04.2050            | 3.878.761        | 0,08                         |
| 1.005.000  | Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp** | 5,50 %  | 15.01.2028            | 967.474          | 0,02                         |
| 1.080.000  | Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp** | 6,00 %  | 31.12.2030            | 1.023.623        | 0,02                         |
| 175.000  | Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp** | 6,00 %  | 01.09.2031            | 165.344          | 0,00                         |
| 742.130  | Team Health Holdings Inc**                                   | 13,50 % | 30.06.2028            | 820.981          | 0,02                         |
| 530.000  | Tenet Healthcare Corp**                                      | 6,13 %  | 01.10.2028            | 529.491          | 0,01                         |
| 640.000  | Tenet Healthcare Corp**                                      | 6,13 %  | 15.06.2030            | 635.756          | 0,01                         |
| 365.000  | Tenet Healthcare Corp**                                      | 6,75 %  | 15.05.2031            | 369.023          | 0,01                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 25,00 % (31. Dezember 2023: 26,53 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 3.615.000  | The Campbell's Co**   | 5,40 %  | 21.03.2034            | 3.599.206        | 0,08                         |
| 1.750.000  | Titania RE Ltd**  | 10,53 % | 26.11.2027            | 1.746.850        | 0,04                         |
| 1.340.000  | TK Elevator Holdco GmbH**                                     | 7,63 %  | 15.07.2028            | 1.341.715        | 0,03                         |
| 8.155.000  | T-Mobile USA Inc**  | 3,40 %  | 15.10.2052            | 5.444.158        | 0,12                         |
| 1.360.000  | T-Mobile USA Inc**  | 4,50 %  | 15.04.2050            | 1.116.495        | 0,02                         |
| 585.000  | TransDigm Inc*  | 4,63 %  | 15.01.2029            | 548.293          | 0,01                         |
| 220.000  | TransDigm Inc*  | 5,50 %  | 15.11.2027            | 216.360          | 0,00                         |
| 750.000  | TransDigm Inc**   | 6,00 %  | 15.01.2033            | 735.638          | 0,02                         |
| 180.000  | TransDigm Inc**   | 6,38 %  | 01.03.2029            | 180.625          | 0,00                         |
| 510.000  | TransDigm Inc**   | 6,63 %  | 01.03.2032            | 515.241          | 0,01                         |
| 810.000  | TransDigm Inc**   | 6,75 %  | 15.08.2028            | 818.079          | 0,02                         |
| 685.000  | Trident TPI Holdings Inc**                                    | 12,75 % | 31.12.2028            | 756.474          | 0,02                         |
| 690.000  | Trivium Packaging Finance BV*                                 | 5,50 %  | 15.08.2026            | 682.752          | 0,01                         |
| 545.000  | Trivium Packaging Finance BV*                                 | 8,50 %  | 15.08.2027            | 544.779          | 0,01                         |
| 765.000  | Tronox Inc**  | 4,63 %  | 15.03.2029            | 687.502          | 0,02                         |
| 190.000  | Truist Financial Corp**                                       | 5,10 %  | 31.12.2149            | 184.597          | 0,00                         |
| 3.345.000  | Truist Financial Corp**                                       | 5,87 %  | 08.06.2034            | 3.407.006        | 0,07                         |
| 3.390.000  | Truist Financial Corp**                                       | 6,67 %  | 31.12.2149            | 3.380.103        | 0,07                         |
| 1.150.000  | Turkiye Vakiflar Bankasi TAO**                                | 8,99 %  | 05.10.2034            | 1.186.104        | 0,03                         |
| 8.145.000  | Uber Technologies Inc*  | 5,35 %  | 15.09.2054            | 7.581.036        | 0,16                         |
| 200.000  | UBS Group AG*   | 4,38 %  | 31.12.2149            | 172.024          | 0,00                         |
| 620.000  | UBS Group AG**  | 4,88 %  | 31.12.2149            | 592.047          | 0,01                         |
| 1.516.000  | UBS Group AG*   | 6,88 %  | 31.12.2149            | 1.519.964        | 0,03                         |
| 1.130.000  | UBS Group AG*   | 9,25 %  | 31.12.2149            | 1.297.846        | 0,03                         |
| 965.000  | UBS Group AG**  | 9,25 %  | 31.12.2149            | 1.108.236        | 0,02                         |
| 1.895.000  | UKG Inc**   | 6,88 %  | 01.02.2031            | 1.924.576        | 0,04                         |
| 1.465.000  | United Airlines Inc**   | 4,38 %  | 15.04.2026            | 1.441.602        | 0,03                         |
| 520.000  | Uniti Group LP/Uniti Group Finance 2019 Inc/CSL Capital LLC** | 10,50 % | 15.02.2028            | 555.004          | 0,01                         |
| 6.890.000  | US Bancorp**  | 3,70 %  | 31.12.2149            | 6.533.425        | 0,14                         |
| 295.000  | US Foods Inc**  | 5,75 %  | 15.04.2033            | 287.417          | 0,01                         |
| 255.000  | US Foods Inc**  | 6,88 %  | 15.09.2028            | 261.241          | 0,01                         |
| 775.000  | US Foods Inc**  | 7,25 %  | 15.01.2032            | 803.027          | 0,02                         |
| 880.000  | USA Compression Partners LP/USA Compression Finance Corp**    | 7,13 %  | 15.03.2029            | 896.370          | 0,02                         |
| 125.000  | USI Inc**   | 7,50 %  | 15.01.2032            | 129.432          | 0,00                         |
| 480.000  | UWM Holdings LLC**  | 6,63 %  | 01.02.2030            | 477.493          | 0,01                         |
| 1.130.000  | Vale Overseas Ltd*  | 6,40 %  | 28.06.2054            | 1.112.118        | 0,02                         |
| 565.000  | Venture Global LNG Inc**                                      | 7,00 %  | 15.01.2030            | 574.008          | 0,01                         |
| 1.550.000  | Venture Global LNG Inc**                                      | 8,38 %  | 01.06.2031            | 1.618.140        | 0,04                         |
| 200.000  | Venture Global LNG Inc**                                      | 9,88 %  | 01.02.2032            | 219.581          | 0,01                         |
| 1.700.000  | Veritiv Operating Co**  | 10,50 % | 30.11.2030            | 1.832.991        | 0,04                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                    | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$     | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|--|---------|-----------------------|----------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 25,00 % (31. Dezember 2023: 26,53 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                      |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                      |                              |
| 4.245.000  | Verizon Communications Inc**                             | 2,99 %  | 30.10.2056            | 2.520.019            | 0,05                         |
| 2.040.000  | Verizon Communications Inc*                              | 5,50 %  | 23.02.2054            | 1.954.079            | 0,04                         |
| 850.000  | Vibrantz Technologies Inc**                              | 9,00 %  | 15.02.2030            | 781.393              | 0,02                         |
| 2.055.000  | Viking Cruises Ltd**                                     | 9,13 %  | 15.07.2031            | 2.211.909            | 0,05                         |
| 1.055.000  | Virgin Media Secured Finance Plc*                        | 5,50 %  | 15.05.2029            | 990.724              | 0,02                         |
| 2.210.000  | Vistra Corp**  | 7,00 %  | 31.12.2149            | 2.225.067            | 0,05                         |
| 810.000  | Vistra Operations Co LLC**                               | 4,38 %  | 01.05.2029            | 763.362              | 0,02                         |
| 155.000  | Vistra Operations Co LLC**                               | 5,50 %  | 01.09.2026            | 154.639              | 0,00                         |
| 640.000  | Vistra Operations Co LLC**                               | 6,88 %  | 15.04.2032            | 655.915              | 0,01                         |
| 510.000  | Vistra Operations Co LLC**                               | 7,75 %  | 15.10.2031            | 535.498              | 0,01                         |
| 5.460.000  | Vodafone Group Plc**                                     | 4,88 %  | 19.06.2049            | 4.710.197            | 0,10                         |
| 2.720.000  | Vodafone Group Plc**                                     | 5,75 %  | 28.06.2054            | 2.625.882            | 0,06                         |
| 1.800.000  | Vulcan Materials Co*                                     | 5,70 %  | 01.12.2054            | 1.749.398            | 0,04                         |
| 1.945.000  | Wand NewCo 3 Inc**                                       | 7,63 %  | 30.01.2032            | 1.999.740            | 0,04                         |
| 25.595.000   | Warnermedia Holdings Inc**                               | 5,05 %  | 15.03.2042            | 20.562.308           | 0,44                         |
| 8.090.000  | Wells Fargo & Co**                                       | 6,49 %  | 23.10.2034            | 8.602.902            | 0,19                         |
| 2.165.000  | Windsor Holdings III LLC**                               | 8,50 %  | 15.06.2030            | 2.280.743            | 0,05                         |
| 615.000  | Windstream Services LLC/Windstream Escrow Finance Corp** | 8,25 %  | 01.10.2031            | 635.906              | 0,01                         |
| 1.355.000  | WR Grace Holdings LLC**                                  | 5,63 %  | 15.08.2029            | 1.247.729            | 0,03                         |
| 1.350.000  | Wrangler Holdco Corp**                                   | 6,63 %  | 01.04.2032            | 1.375.669            | 0,03                         |
| 2.385.000  | Wyndham Hotels & Resorts Inc**                           | 4,38 %  | 15.08.2028            | 2.276.575            | 0,05                         |
| 660.000  | Wynn Macau Ltd*  | 5,50 %  | 15.01.2026            | 654.049              | 0,01                         |
| 270.000  | XHR LP**   | 4,88 %  | 01.06.2029            | 254.939              | 0,01                         |
| 1.385.000  | XP Inc*  | 6,75 %  | 02.07.2029            | 1.378.090            | 0,03                         |
| 1.355.000  | XPO Inc**  | 7,13 %  | 01.02.2032            | 1.389.309            | 0,03                         |
| 400.000  | Yapi ve Kredi Bankasi AS**                               | 9,74 %  | 31.12.2149            | 412.674              | 0,01                         |
| 955.000  | Zayo Group Holdings Inc**                                | 4,00 %  | 01.03.2027            | 881.746              | 0,02                         |
| 90.000   | ZF North America Capital Inc**                           | 6,75 %  | 23.04.2030            | 86.646               | 0,00                         |
| 585.000  | ZF North America Capital Inc**                           | 6,88 %  | 14.04.2028            | 583.828              | 0,01                         |
| 535.000  | Ziff Davis Inc**   | 4,63 %  | 15.10.2030            | 492.361              | 0,01                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |  |         |                       | <b>786.315.645</b>   | <b>16,96</b>                 |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>  |  |         |                       | <b>1.159.321.497</b> | <b>25,00</b>                 |
| <b>Staatsanleihen 6,84 % (31. Dezember 2023: 8,70 %)</b>                       |  |         |                       |                      |                              |
| <b>Brazilianischer Real</b>  |  |         |                       |                      |                              |
| 31.668.000   | Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F*                | 10,00 % | 01.01.2035            | 3.852.152            | 0,08                         |
| <b>Brazilianischer Real insgesamt</b>  |  |         |                       | <b>3.852.152</b>     | <b>0,08</b>                  |
| <b>Kanadischer Dollar</b>  |  |         |                       |                      |                              |
| 500.000  | Canadian Government Bond*                                | 2,75 %  | 01.12.2055            | 308.922              | 0,01                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                    | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|--|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 6,84 % (31. Dezember 2023: 8,70 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                   |                              |
| <b>Kanadischer Dollar (Fortsetzung)</b>                                |  |         |                       |                   |                              |
| 900.000  | Canadian Government Bond*                | 3,25 %  | 01.12.2034            | 626.992           | 0,01                         |
| 1.300.000  | Canadian Government Bond*                | 3,50 %  | 01.09.2029            | 924.874           | 0,02                         |
| <b>Kanadischer Dollar insgesamt</b>                                    |  |         |                       | <b>1.860.788</b>  | <b>0,04</b>                  |
| <b>Kolumbianischer Peso</b>  |  |         |                       |                   |                              |
| 5.168.900.000  | Colombian TES*                           | 7,00 %  | 30.06.2032            | 917.430           | 0,02                         |
| 5.704.000.000  | Colombian TES*                           | 7,25 %  | 18.10.2034            | 964.889           | 0,02                         |
| 341.300.000  | Colombian TES*                           | 13,25 % | 09.02.2033            | 83.803            | 0,00                         |
| <b>Kolumbianischer Peso insgesamt</b>                                  |  |         |                       | <b>1.966.122</b>  | <b>0,04</b>                  |
| <b>Euro</b>  |  |         |                       |                   |                              |
| 3.000.000  | Autonomous Community of Catalonia*       | 5,48 %  | 11.05.2029            | 3.400.887         | 0,07                         |
| 8.202.000  | Autonomous Community of Catalonia*       | 6,62 %  | 15.02.2033            | 9.714.744         | 0,21                         |
| 2.500.000  | Autonomous Community of Madrid Spain*    | 3,60 %  | 30.04.2033            | 2.696.552         | 0,06                         |
| 4.798.000  | Xunta de Galicia*                        | 3,30 %  | 30.04.2031            | 5.097.559         | 0,11                         |
| <b>Euro insgesamt</b>  |  |         |                       | <b>20.909.742</b> | <b>0,45</b>                  |
| <b>Ungarischer Forint</b>  |  |         |                       |                   |                              |
| 434.490.000  | Hungary Government Bond*                 | 2,25 %  | 22.06.2034            | 779.675           | 0,02                         |
| 995.190.000  | Hungary Government Bond*                 | 3,25 %  | 22.10.2031            | 2.104.851         | 0,04                         |
| <b>Ungarischer Forint insgesamt</b>                                    |  |         |                       | <b>2.884.526</b>  | <b>0,06</b>                  |
| <b>Indonesische Rupiah</b>   |  |         |                       |                   |                              |
| 35.776.000.000   | Indonesia Treasury Bond*                 | 6,63 %  | 15.02.2034            | 2.164.598         | 0,05                         |
| 12.889.000.000   | Indonesia Treasury Bond*                 | 7,00 %  | 15.09.2030            | 794.361           | 0,02                         |
| 11.228.000.000   | Indonesia Treasury Bond*                 | 7,00 %  | 15.02.2033            | 695.963           | 0,01                         |
| <b>Indonesische Rupiah insgesamt</b>                                   |  |         |                       | <b>3.654.922</b>  | <b>0,08</b>                  |
| <b>Mexikanischer Peso</b>  |  |         |                       |                   |                              |
| 84.500.000   | Mexican Bonos*                           | 7,50 %  | 26.05.2033            | 3.437.586         | 0,07                         |
| 27.490.000   | Mexican Bonos*                           | 7,75 %  | 29.05.2031            | 1.180.167         | 0,03                         |
| 148.103.900  | Mexican Bonos*                           | 7,75 %  | 23.11.2034            | 5.963.122         | 0,13                         |
| <b>Mexikanischer Peso insgesamt</b>                                    |  |         |                       | <b>10.580.875</b> | <b>0,23</b>                  |
| <b>Peruanischer Sol</b>  |  |         |                       |                   |                              |
| 271.000  | Peru Government Bond*                    | 5,40 %  | 12.08.2034            | 65.801            | 0,00                         |
| 10.438.000   | Peru Government Bond*                    | 6,15 %  | 12.08.2032            | 2.756.546         | 0,06                         |
| 4.534.000  | Peruvian Government International Bond** | 6,90 %  | 12.08.2037            | 1.198.218         | 0,03                         |
| <b>Peruanischer Sol insgesamt</b>                                      |  |         |                       | <b>4.020.565</b>  | <b>0,09</b>                  |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                     | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 6,84 % (31. Dezember 2023: 8,70 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>Polnischer Zloty</b>  |   |        |                       |                  |                              |
| 2.216.000  | Republic of Poland Government Bond*       | 4,75 % | 25.07.2029            | 521.673          | 0,01                         |
| 1.489.000  | Republic of Poland Government Bond*       | 5,00 % | 25.10.2034            | 339.439          | 0,01                         |
| 7.068.000  | Republic of Poland Government Bond*       | 6,00 % | 25.10.2033            | 1.738.812        | 0,04                         |
| 1.281.000  | Republic of Poland Government Bond*       | 7,50 % | 25.07.2028            | 331.404          | 0,00                         |
| <b>Polnischer Zloty insgesamt</b>                                      |   |        |                       | <b>2.931.328</b> | <b>0,06</b>                  |
| <b>Rumänischer neuer Leu</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 195.000  | Romania Government Bond*                  | 4,75 % | 11.10.2034            | 33.428           | 0,00                         |
| 6.360.000  | Romania Government Bond**                 | 4,85 % | 25.07.2029            | 1.208.441        | 0,03                         |
| 1.695.000  | Romania Government Bond*                  | 7,10 % | 31.07.2034            | 346.242          | 0,01                         |
| 10.790.000   | Romania Government Bond*                  | 8,25 % | 29.09.2032            | 2.369.458        | 0,05                         |
| <b>Rumänischer neuer Leu insgesamt</b>                                 |   |        |                       | <b>3.957.569</b> | <b>0,09</b>                  |
| <b>Südafrikanischer Rand</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 13.157.403   | Republic of South Africa Government Bond* | 8,00 % | 31.01.2030            | 668.683          | 0,01                         |
| 15.379.799   | Republic of South Africa Government Bond* | 8,25 % | 31.03.2032            | 755.281          | 0,02                         |
| 4.946.939  | Republic of South Africa Government Bond* | 8,50 % | 31.01.2037            | 222.797          | 0,01                         |
| 11.193.862   | Republic of South Africa Government Bond* | 8,88 % | 28.02.2035            | 540.781          | 0,01                         |
| <b>Südafrikanischer Rand insgesamt</b>                                 |   |        |                       | <b>2.187.542</b> | <b>0,05</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 585.000  | Angolan Government International Bond*    | 8,00 % | 26.11.2029            | 524.514          | 0,01                         |
| 2.595.000  | Angolan Government International Bond*    | 8,75 % | 14.04.2032            | 2.298.153        | 0,05                         |
| 1.100.000  | Angolan Government International Bond*    | 9,13 % | 26.11.2049            | 884.262          | 0,02                         |
| 2.475.000  | Angolan Government International Bond*    | 9,38 % | 08.05.2048            | 2.036.182        | 0,04                         |
| 1.000.000  | Bahrain Government International Bond*    | 5,63 % | 18.05.2034            | 910.164          | 0,02                         |
| 750.000  | Brazilian Government International Bond*  | 6,00 % | 20.10.2033            | 701.494          | 0,02                         |
| 2.580.000  | Brazilian Government International Bond*  | 6,13 % | 15.03.2034            | 2.412.501        | 0,05                         |
| 400.000  | Brazilian Government International Bond*  | 7,13 % | 13.05.2054            | 370.829          | 0,01                         |
| 485.000  | Colombia Government International Bond*   | 3,00 % | 30.01.2030            | 402.914          | 0,01                         |
| 700.000  | Colombia Government International Bond*   | 3,25 % | 22.04.2032            | 538.125          | 0,01                         |
| 400.000  | Colombia Government International Bond*   | 7,50 % | 02.02.2034            | 394.600          | 0,01                         |
| 1.110.000  | Colombia Government International Bond**  | 8,00 % | 14.11.2035            | 1.118.880        | 0,02                         |
| 555.000  | Colombia Government International Bond*   | 8,38 % | 07.11.2054            | 539.404          | 0,01                         |
| 1.190.000  | Costa Rica Government International Bond* | 7,16 % | 12.03.2045            | 1.228.080        | 0,03                         |
| 1.925.000  | Dominican Republic International Bond*    | 6,85 % | 27.01.2045            | 1.896.125        | 0,04                         |
| 730.000  | Dominican Republic International Bond*    | 7,05 % | 03.02.2031            | 749.345          | 0,02                         |
| 502.330  | Ecuador Government International Bond*    | 5,50 % | 31.07.2035            | 286.556          | 0,01                         |
| 310.120  | Ecuador Government International Bond*    | 6,90 % | 31.07.2030            | 216.739          | 0,00                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 6,84 % (31. Dezember 2023: 8,70 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |        |                       |                  |                              |
| 1.890.000  | Egypt Government International Bond*                    | 8,50 % | 31.01.2047            | 1.470.850        | 0,03                         |
| 200.000  | El Salvador Government International Bond*              | 9,50 % | 15.07.2052            | 209.170          | 0,00                         |
| 1.720.000  | Guatemala Government Bond*                              | 3,70 % | 07.10.2033            | 1.394.705        | 0,03                         |
| 655.000  | Guatemala Government Bond*                              | 6,55 % | 06.02.2037            | 644.520          | 0,01                         |
| 1.815.000  | Indonesia Government International Bond*                | 4,63 % | 15.04.2043            | 1.623.340        | 0,03                         |
| 1.700.000  | Ivory Coast Government International Bond*              | 6,13 % | 15.06.2033            | 1.518.310        | 0,03                         |
| 970.000  | Ivory Coast Government International Bond*              | 8,25 % | 30.01.2037            | 943.470          | 0,02                         |
| 1.890.000  | Mexico Government International Bond*                   | 4,40 % | 12.02.2052            | 1.282.312        | 0,03                         |
| 925.000  | Mexico Government International Bond**                  | 6,00 % | 07.05.2036            | 872.767          | 0,02                         |
| 1.665.000  | Mexico Government International Bond*                   | 6,34 % | 04.05.2053            | 1.487.787        | 0,03                         |
| 300.000  | Mexico Government International Bond**                  | 6,40 % | 07.05.2054            | 269.321          | 0,01                         |
| 485.000  | Mongolia Government International Bond*                 | 5,13 % | 07.04.2026            | 477.604          | 0,01                         |
| 680.000  | Oman Government International Bond*                     | 6,50 % | 08.03.2047            | 674.537          | 0,01                         |
| 1.195.000  | Oman Government International Bond*                     | 7,00 % | 25.01.2051            | 1.254.397        | 0,03                         |
| 825.000  | Panama Government International Bond*                   | 2,25 % | 29.09.2032            | 578.687          | 0,01                         |
| 2.000.000  | Panama Government International Bond*                   | 4,30 % | 29.04.2053            | 1.176.754        | 0,03                         |
| 2.220.000  | Panama Government International Bond*                   | 6,40 % | 14.02.2035            | 2.020.971        | 0,04                         |
| 970.000  | Paraguay Government International Bond*                 | 3,85 % | 28.06.2033            | 841.233          | 0,02                         |
| 815.000  | Paraguay Government International Bond*                 | 4,95 % | 28.04.2031            | 782.196          | 0,02                         |
| 3.045.000  | Paraguay Government International Bond*                 | 5,40 % | 30.03.2050            | 2.589.011        | 0,06                         |
| 635.000  | Qatar Government International Bond*                    | 4,40 % | 16.04.2050            | 539.214          | 0,01                         |
| 1.085.000  | Republic of South Africa Government International Bond* | 5,65 % | 27.09.2047            | 813.199          | 0,02                         |
| 485.000  | Republic of South Africa Government International Bond* | 5,75 % | 30.09.2049            | 364.128          | 0,01                         |
| 1.000.000  | Republic of South Africa Government International Bond* | 5,88 % | 20.04.2032            | 940.456          | 0,02                         |
| 830.000  | Republic of South Africa Government International Bond* | 7,10 % | 19.11.2036            | 809.732          | 0,02                         |
| 3.050.000  | Republic of South Africa Government International Bond* | 7,95 % | 19.11.2054            | 2.928.973        | 0,06                         |
| 1.422.000  | Romanian Government International Bond*                 | 3,00 % | 14.02.2031            | 1.152.581        | 0,02                         |
| 2.000.000  | Romanian Government International Bond*                 | 3,63 % | 27.03.2032            | 1.633.628        | 0,04                         |
| 1.184.000  | Romanian Government International Bond*                 | 4,00 % | 14.02.2051            | 748.472          | 0,02                         |
| 580.000  | Romanian Government International Bond 144A*            | 3,63 % | 27.03.2032            | 473.752          | 0,01                         |
| 630.000  | Romanian Government International Bond 144A*            | 4,00 % | 14.02.2051            | 398.376          | 0,01                         |
| 2.185.000  | Saudi Government International Bond*                    | 3,25 % | 17.11.2051            | 1.382.978        | 0,03                         |
| 580.000  | Saudi Government International Bond*                    | 3,75 % | 21.01.2055            | 385.829          | 0,01                         |
| 46.595   | Ukraine Government International Bond*                  | 0,00 % | 01.02.2030            | 25.566           | 0,00                         |
| 174.121  | Ukraine Government International Bond*                  | 0,00 % | 01.02.2034            | 72.482           | 0,00                         |
| 147.144  | Ukraine Government International Bond*                  | 0,00 % | 01.02.2035            | 87.370           | 0,00                         |
| 122.620  | Ukraine Government International Bond*                  | 0,00 % | 01.02.2036            | 72.324           | 0,00                         |
| 127.951  | Ukraine Government International Bond*                  | 1,75 % | 01.02.2034            | 72.452           | 0,00                         |
| 298.554  | Ukraine Government International Bond*                  | 1,75 % | 01.02.2035            | 164.951          | 0,00                         |
| 426.506  | Ukraine Government International Bond*                  | 1,75 % | 01.02.2036            | 231.557          | 0,00                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                           | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|---|--------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 6,84 % (31. Dezember 2023: 8,70 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |        |                       |                    |                              |
| 41.925.000   | United States Treasury Inflation Indexed Bonds* | 0,13 % | 15.04.2027            | 40.192.719         | 0,87                         |
| 18.530.000   | United States Treasury Note/Bond*               | 1,25 % | 31.03.2028            | 16.833.408         | 0,36                         |
| 28.860.000   | United States Treasury Note/Bond*               | 1,63 % | 15.05.2031            | 24.353.522         | 0,53                         |
| 8.765.000  | United States Treasury Note/Bond*               | 2,25 % | 15.08.2046            | 5.661.076          | 0,12                         |
| 7.870.000  | United States Treasury Note/Bond*               | 2,25 % | 15.02.2052            | 4.773.262          | 0,10                         |
| 2.040.000  | United States Treasury Note/Bond*               | 3,13 % | 15.02.2042            | 1.637.416          | 0,04                         |
| 4.990.000  | United States Treasury Note/Bond*               | 3,13 % | 15.05.2048            | 3.739.200          | 0,08                         |
| 14.580.000   | United States Treasury Note/Bond*               | 3,38 % | 15.05.2033            | 13.402.108         | 0,29                         |
| 1.955.000  | United States Treasury Note/Bond*               | 3,38 % | 15.05.2044            | 1.585.074          | 0,03                         |
| 38.590.000   | United States Treasury Note/Bond*               | 3,75 % | 31.08.2031            | 36.981.281         | 0,80                         |
| 15.000.000   | United States Treasury Note/Bond*               | 4,13 % | 31.07.2031            | 14.704.660         | 0,32                         |
| 5.000.000  | United States Treasury Note/Bond*               | 4,25 % | 30.06.2031            | 4.938.298          | 0,11                         |
| 7.402.900  | United States Treasury Note/Bond*               | 4,38 % | 15.07.2027            | 7.423.053          | 0,16                         |
| 14.734.100   | United States Treasury Note/Bond*               | 4,38 % | 15.05.2034            | 14.512.226         | 0,31                         |
| 7.405.000  | United States Treasury Note/Bond*               | 4,50 % | 15.05.2038            | 7.290.580          | 0,16                         |
| 5.135.000  | United States Treasury Note/Bond*               | 4,63 % | 15.05.2054            | 4.990.759          | 0,11                         |
| 2.210.000  | Uruguay Government International Bond*          | 5,10 % | 18.06.2050            | 2.034.730          | 0,04                         |
| 3.136.300  | Venezuela Government International Bond*        | 8,25 % | 13.10.2024            | 443.002            | 0,01                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |   |        |                       | <b>258.415.203</b> | <b>5,57</b>                  |
| <b>Staatsanleihen insgesamt</b>  |   |        |                       | <b>317.221.334</b> | <b>6,84</b>                  |
| <b>Mortgage-Backed Securities 33,01 % (31. Dezember 2023: 45,47 %)</b> |   |        |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |   |        |                       |                    |                              |
| 4.997.957  | Fannie Mae Pool                                 | 2,50 % | 01.10.2050            | 4.097.345          | 0,09                         |
| 1.156.384  | Fannie Mae Pool                                 | 2,50 % | 01.02.2051            | 944.046            | 0,02                         |
| 3.170.226  | Fannie Mae Pool                                 | 2,50 % | 01.08.2051            | 2.613.579          | 0,06                         |
| 4.459.947  | Fannie Mae Pool                                 | 2,50 % | 01.09.2051            | 3.672.017          | 0,08                         |
| 2.621.184  | Fannie Mae Pool                                 | 2,50 % | 01.10.2051            | 2.140.084          | 0,05                         |
| 3.813.293  | Fannie Mae Pool                                 | 2,50 % | 01.11.2051            | 3.129.899          | 0,07                         |
| 3.173.848  | Fannie Mae Pool                                 | 2,50 % | 01.12.2051            | 2.590.540          | 0,06                         |
| 574.712  | Fannie Mae Pool                                 | 2,50 % | 01.01.2052            | 472.611            | 0,01                         |
| 6.186.686  | Fannie Mae Pool                                 | 2,50 % | 01.02.2052            | 5.085.046          | 0,11                         |
| 2.420.489  | Fannie Mae Pool                                 | 2,50 % | 01.03.2052            | 1.976.644          | 0,04                         |
| 4.870.134  | Fannie Mae Pool                                 | 2,50 % | 01.04.2052            | 3.986.328          | 0,09                         |
| 3.946.315  | Fannie Mae Pool                                 | 2,50 % | 01.05.2052            | 3.224.226          | 0,07                         |
| 7.817.050  | Fannie Mae Pool                                 | 2,50 % | 01.06.2052            | 6.387.725          | 0,14                         |
| 2.623.823  | Fannie Mae Pool                                 | 2,50 % | 01.07.2052            | 2.140.913          | 0,05                         |
| 890.926  | Fannie Mae Pool                                 | 2,50 % | 01.09.2052            | 733.794            | 0,02                         |
| 1.508.107  | Fannie Mae Pool                                 | 2,50 % | 01.05.2053            | 1.235.799          | 0,03                         |
| 2.343.683  | Fannie Mae Pool                                 | 2,50 % | 01.07.2053            | 1.918.461          | 0,04                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|-----------------------|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Mortgage-Backed Securities 33,01 % (31. Dezember 2023: 45,47 %) (Fortsetzung)</b> |                       |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |                       |        |                       |                  |                              |
| 1.926.389  | Fannie Mae Pool       | 3,00 % | 01.06.2050            | 1.654.321        | 0,04                         |
| 1.937.043  | Fannie Mae Pool       | 3,00 % | 01.04.2051            | 1.660.317        | 0,04                         |
| 1.211.472  | Fannie Mae Pool       | 3,00 % | 01.05.2051            | 1.039.911        | 0,02                         |
| 1.133.582  | Fannie Mae Pool       | 3,00 % | 01.07.2051            | 965.389          | 0,02                         |
| 2.031.671  | Fannie Mae Pool       | 3,00 % | 01.08.2051            | 1.740.790        | 0,04                         |
| 2.131.504  | Fannie Mae Pool       | 3,00 % | 01.11.2051            | 1.834.971        | 0,04                         |
| 204.674  | Fannie Mae Pool       | 3,00 % | 01.12.2051            | 174.628          | 0,00                         |
| 1.602.716  | Fannie Mae Pool       | 3,00 % | 01.01.2052            | 1.364.523        | 0,03                         |
| 1.098.183  | Fannie Mae Pool       | 3,00 % | 01.02.2052            | 936.822          | 0,02                         |
| 1.270.551  | Fannie Mae Pool       | 3,00 % | 01.03.2052            | 1.081.135        | 0,02                         |
| 9.602.495  | Fannie Mae Pool       | 3,00 % | 01.04.2052            | 8.169.249        | 0,18                         |
| 1.617.066  | Fannie Mae Pool       | 3,00 % | 01.05.2052            | 1.377.635        | 0,03                         |
| 8.095.193  | Fannie Mae Pool       | 3,00 % | 01.06.2052            | 6.890.940        | 0,15                         |
| 11.477.559   | Fannie Mae Pool       | 3,00 % | 01.07.2052            | 9.773.454        | 0,21                         |
| 2.092.479  | Fannie Mae Pool       | 3,00 % | 01.09.2052            | 1.780.972        | 0,04                         |
| 674.665  | Fannie Mae Pool       | 3,00 % | 01.03.2053            | 574.972          | 0,01                         |
| 1.018.933  | Fannie Mae Pool       | 3,50 % | 01.05.2051            | 910.268          | 0,02                         |
| 716.772  | Fannie Mae Pool       | 3,50 % | 01.12.2051            | 634.950          | 0,01                         |
| 628.658  | Fannie Mae Pool       | 3,50 % | 01.02.2052            | 560.725          | 0,01                         |
| 2.232.659  | Fannie Mae Pool       | 3,50 % | 01.03.2052            | 1.985.182        | 0,04                         |
| 3.506.533  | Fannie Mae Pool       | 3,50 % | 01.04.2052            | 3.128.738        | 0,07                         |
| 2.512.781  | Fannie Mae Pool       | 3,50 % | 01.05.2052            | 2.225.402        | 0,05                         |
| 5.979.668  | Fannie Mae Pool       | 3,50 % | 01.06.2052            | 5.299.622        | 0,11                         |
| 4.573.573  | Fannie Mae Pool       | 3,50 % | 01.07.2052            | 4.055.245        | 0,09                         |
| 2.885.442  | Fannie Mae Pool       | 3,50 % | 01.08.2052            | 2.558.282        | 0,05                         |
| 2.418.337  | Fannie Mae Pool       | 3,50 % | 01.09.2052            | 2.142.435        | 0,05                         |
| 2.039.399  | Fannie Mae Pool       | 3,50 % | 01.10.2052            | 1.806.734        | 0,04                         |
| 2.309.462  | Fannie Mae Pool       | 3,50 % | 01.12.2052            | 2.047.013        | 0,04                         |
| 2.046.024  | Fannie Mae Pool       | 3,50 % | 01.04.2053            | 1.811.599        | 0,04                         |
| 2.662.967  | Fannie Mae Pool       | 3,50 % | 01.05.2053            | 2.357.865        | 0,05                         |
| 1.132.751  | Fannie Mae Pool       | 4,00 % | 01.02.2052            | 1.039.021        | 0,02                         |
| 1.100.511  | Fannie Mae Pool       | 4,00 % | 01.05.2052            | 1.009.110        | 0,02                         |
| 4.344.915  | Fannie Mae Pool       | 4,00 % | 01.06.2052            | 3.983.367        | 0,09                         |
| 8.205.673  | Fannie Mae Pool       | 4,00 % | 01.07.2052            | 7.515.976        | 0,16                         |
| 465.788  | Fannie Mae Pool       | 4,00 % | 01.08.2052            | 426.711          | 0,01                         |
| 1.940.507  | Fannie Mae Pool       | 4,00 % | 01.09.2052            | 1.777.021        | 0,04                         |
| 12.959.401   | Fannie Mae Pool       | 4,00 % | 01.10.2052            | 11.874.538       | 0,26                         |
| 5.518.315  | Fannie Mae Pool       | 4,00 % | 01.12.2052            | 5.053.371        | 0,11                         |
| 6.829.841  | Fannie Mae Pool       | 4,00 % | 01.02.2053            | 6.257.819        | 0,13                         |
| 2.891.287  | Fannie Mae Pool       | 4,00 % | 01.04.2053            | 2.646.450        | 0,06                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|-----------------------|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Mortgage-Backed Securities 33,01 % (31. Dezember 2023: 45,47 %) (Fortsetzung)</b> |                       |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |                       |        |                       |                  |                              |
| 4.549.696  | Fannie Mae Pool       | 4,00 % | 01.07.2053            | 4.167.084        | 0,09                         |
| 5.170.759  | Fannie Mae Pool       | 4,00 % | 01.12.2053            | 4.732.711        | 0,10                         |
| 1.981.875  | Fannie Mae Pool       | 4,50 % | 01.06.2052            | 1.867.942        | 0,04                         |
| 3.727.121  | Fannie Mae Pool       | 4,50 % | 01.07.2052            | 3.513.963        | 0,08                         |
| 5.177.509  | Fannie Mae Pool       | 4,50 % | 01.08.2052            | 4.881.581        | 0,11                         |
| 11.110.009   | Fannie Mae Pool       | 4,50 % | 01.09.2052            | 10.474.997       | 0,23                         |
| 5.671.464  | Fannie Mae Pool       | 4,50 % | 01.10.2052            | 5.347.505        | 0,12                         |
| 4.428.381  | Fannie Mae Pool       | 4,50 % | 01.11.2052            | 4.175.434        | 0,09                         |
| 4.462.560  | Fannie Mae Pool       | 4,50 % | 01.01.2053            | 4.202.302        | 0,09                         |
| 834.161  | Fannie Mae Pool       | 4,50 % | 01.09.2053            | 786.399          | 0,02                         |
| 5.038.573  | Fannie Mae Pool       | 4,50 % | 01.02.2054            | 4.744.149        | 0,10                         |
| 2.483.896  | Fannie Mae Pool       | 5,00 % | 01.08.2052            | 2.406.346        | 0,05                         |
| 5.372.948  | Fannie Mae Pool       | 5,00 % | 01.09.2052            | 5.197.774        | 0,11                         |
| 2.865.352  | Fannie Mae Pool       | 5,00 % | 01.10.2052            | 2.777.222        | 0,06                         |
| 575.179  | Fannie Mae Pool       | 5,00 % | 01.11.2052            | 557.088          | 0,01                         |
| 5.573.479  | Fannie Mae Pool       | 5,00 % | 01.12.2052            | 5.404.559        | 0,12                         |
| 9.084.761  | Fannie Mae Pool       | 5,00 % | 01.01.2053            | 8.799.014        | 0,19                         |
| 4.653.579  | Fannie Mae Pool       | 5,00 % | 01.02.2053            | 4.506.486        | 0,10                         |
| 3.637.491  | Fannie Mae Pool       | 5,00 % | 01.03.2053            | 3.518.916        | 0,08                         |
| 8.659.391  | Fannie Mae Pool       | 5,00 % | 01.04.2053            | 8.364.260        | 0,18                         |
| 4.397.974  | Fannie Mae Pool       | 5,00 % | 01.05.2053            | 4.252.321        | 0,09                         |
| 3.993.079  | Fannie Mae Pool       | 5,00 % | 01.06.2053            | 3.862.820        | 0,08                         |
| 9.979.304  | Fannie Mae Pool       | 5,00 % | 01.07.2053            | 9.648.724        | 0,21                         |
| 10.319.795   | Fannie Mae Pool       | 5,00 % | 01.08.2053            | 9.970.192        | 0,21                         |
| 1.331.407  | Fannie Mae Pool       | 5,00 % | 01.09.2053            | 1.287.400        | 0,03                         |
| 652.142  | Fannie Mae Pool       | 5,00 % | 01.10.2053            | 630.050          | 0,01                         |
| 5.670.800  | Fannie Mae Pool       | 5,00 % | 01.11.2053            | 5.485.703        | 0,12                         |
| 4.053.606  | Fannie Mae Pool       | 5,00 % | 01.02.2054            | 3.915.440        | 0,08                         |
| 5.732.983  | Fannie Mae Pool       | 5,00 % | 01.03.2054            | 5.543.606        | 0,12                         |
| 7.098.480  | Fannie Mae Pool       | 5,00 % | 01.04.2054            | 6.858.979        | 0,15                         |
| 5.484.900  | Fannie Mae Pool       | 5,00 % | 01.05.2054            | 5.297.943        | 0,11                         |
| 1.028.828  | Fannie Mae Pool       | 5,00 % | 01.07.2054            | 993.599          | 0,02                         |
| 769.238  | Fannie Mae Pool       | 5,00 % | 01.08.2054            | 743.707          | 0,02                         |
| 3.225.968  | Fannie Mae Pool       | 5,50 % | 01.12.2052            | 3.193.280        | 0,07                         |
| 3.644.962  | Fannie Mae Pool       | 5,50 % | 01.01.2053            | 3.600.831        | 0,08                         |
| 1.845.214  | Fannie Mae Pool       | 5,50 % | 01.02.2053            | 1.823.460        | 0,04                         |
| 2.974.128  | Fannie Mae Pool       | 5,50 % | 01.03.2053            | 2.941.703        | 0,06                         |
| 3.182.751  | Fannie Mae Pool       | 5,50 % | 01.04.2053            | 3.144.464        | 0,07                         |
| 4.628.771  | Fannie Mae Pool       | 5,50 % | 01.05.2053            | 4.578.653        | 0,10                         |
| 3.057.703  | Fannie Mae Pool       | 5,50 % | 01.06.2053            | 3.021.275        | 0,06                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung    | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|--------------------------|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Mortgage-Backed Securities 33,01 % (31. Dezember 2023: 45,47 %) (Fortsetzung)</b> |                          |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |                          |        |                       |                  |                              |
| 3.423.214  | Fannie Mae Pool          | 5,50 % | 01.07.2053            | 3.384.917        | 0,07                         |
| 10.525.432   | Fannie Mae Pool          | 5,50 % | 01.08.2053            | 10.398.326       | 0,22                         |
| 12.743.051   | Fannie Mae Pool          | 5,50 % | 01.09.2053            | 12.592.233       | 0,27                         |
| 11.786.881   | Fannie Mae Pool          | 5,50 % | 01.10.2053            | 11.643.789       | 0,25                         |
| 3.241.265  | Fannie Mae Pool          | 5,50 % | 01.11.2053            | 3.202.500        | 0,07                         |
| 1.461.412  | Fannie Mae Pool          | 5,50 % | 01.12.2053            | 1.443.722        | 0,03                         |
| 5.572.630  | Fannie Mae Pool          | 5,50 % | 01.01.2054            | 5.504.267        | 0,12                         |
| 3.157.790  | Fannie Mae Pool          | 5,50 % | 01.02.2054            | 3.118.482        | 0,07                         |
| 2.667.479  | Fannie Mae Pool          | 5,50 % | 01.03.2054            | 2.634.275        | 0,06                         |
| 1.366.659  | Fannie Mae Pool          | 5,50 % | 01.04.2054            | 1.349.647        | 0,03                         |
| 6.217.204  | Fannie Mae Pool          | 5,50 % | 01.05.2054            | 6.139.812        | 0,13                         |
| 3.598.275  | Fannie Mae Pool          | 5,50 % | 01.06.2054            | 3.560.255        | 0,08                         |
| 5.407.441  | Fannie Mae Pool          | 5,50 % | 01.07.2054            | 5.344.268        | 0,12                         |
| 9.814.265  | Fannie Mae Pool          | 5,50 % | 01.08.2054            | 9.742.041        | 0,21                         |
| 7.003.125  | Fannie Mae Pool          | 5,50 % | 01.10.2054            | 6.928.053        | 0,15                         |
| 47.455.000   | Fannie Mae Pool          | 5,50 % | 01.01.2055            | 46.833.566       | 1,01                         |
| 2.627.315  | Fannie Mae Pool          | 6,00 % | 01.01.2053            | 2.643.777        | 0,06                         |
| 3.122.449  | Fannie Mae Pool          | 6,00 % | 01.02.2053            | 3.143.336        | 0,07                         |
| 1.154.004  | Fannie Mae Pool          | 6,00 % | 01.04.2053            | 1.160.668        | 0,02                         |
| 2.661.049  | Fannie Mae Pool          | 6,00 % | 01.06.2053            | 2.680.078        | 0,06                         |
| 6.047.049  | Fannie Mae Pool          | 6,00 % | 01.07.2053            | 6.082.384        | 0,13                         |
| 7.901.663  | Fannie Mae Pool          | 6,00 % | 01.08.2053            | 7.949.389        | 0,17                         |
| 5.223.936  | Fannie Mae Pool          | 6,00 % | 01.09.2053            | 5.253.885        | 0,11                         |
| 4.702.995  | Fannie Mae Pool          | 6,00 % | 01.10.2053            | 4.753.203        | 0,10                         |
| 12.274.080   | Fannie Mae Pool          | 6,00 % | 01.11.2053            | 12.344.448       | 0,27                         |
| 10.090.019   | Fannie Mae Pool          | 6,00 % | 01.12.2053            | 10.146.835       | 0,22                         |
| 7.481.124  | Fannie Mae Pool          | 6,00 % | 01.01.2054            | 7.520.953        | 0,16                         |
| 4.468.882  | Fannie Mae Pool          | 6,00 % | 01.02.2054            | 4.492.675        | 0,10                         |
| 10.012.616   | Fannie Mae Pool          | 6,00 % | 01.03.2054            | 10.066.207       | 0,22                         |
| 3.367.452  | Fannie Mae Pool          | 6,00 % | 01.05.2054            | 3.385.396        | 0,07                         |
| 897.761  | Fannie Mae Pool          | 6,00 % | 01.06.2054            | 903.644          | 0,02                         |
| 4.464.662  | Fannie Mae Pool          | 6,00 % | 01.08.2054            | 4.493.260        | 0,10                         |
| 749.109  | Fannie Mae Pool          | 6,00 % | 01.10.2054            | 752.990          | 0,02                         |
| 570.659  | Fannie Mae Pool          | 6,50 % | 01.11.2053            | 582.784          | 0,01                         |
| 1.000.630  | Fannie Mae Pool          | 6,50 % | 01.01.2054            | 1.021.890        | 0,02                         |
| 2.222.851  | Fannie Mae Pool          | 6,50 % | 01.03.2054            | 2.270.081        | 0,05                         |
| 844.040  | Fannie Mae Pool          | 6,50 % | 01.05.2054            | 862.284          | 0,02                         |
| 2.667.083  | Fannie Mae Pool (BU8723) | 3,50 % | 01.06.2052            | 2.363.097        | 0,05                         |
| 663.624  | Fannie Mae Pool (BU8725) | 3,50 % | 01.06.2052            | 590.142          | 0,01                         |
| 1.271.230  | Fannie Mae Pool (BV2623) | 4,50 % | 01.07.2052            | 1.198.526        | 0,03                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung    | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|--------------------------|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Mortgage-Backed Securities 33,01 % (31. Dezember 2023: 45,47 %) (Fortsetzung)</b> |                          |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |                          |        |                       |                  |                              |
| 2.857.661  | Fannie Mae Pool (BV5623) | 3,00 % | 01.06.2052            | 2.431.689        | 0,05                         |
| 3.695.655  | Fannie Mae Pool (BV7773) | 2,50 % | 01.04.2052            | 3.016.853        | 0,06                         |
| 1.059.023  | Fannie Mae Pool (BV7928) | 4,50 % | 01.08.2052            | 998.456          | 0,02                         |
| 1.508.176  | Fannie Mae Pool (BV7959) | 5,00 % | 01.08.2052            | 1.461.440        | 0,03                         |
| 1.447.928  | Fannie Mae Pool (BV8463) | 2,50 % | 01.04.2052            | 1.188.868        | 0,03                         |
| 719.264  | Fannie Mae Pool (BV9913) | 3,50 % | 01.06.2052            | 637.785          | 0,01                         |
| 4.405.063  | Fannie Mae Pool (BW1502) | 4,50 % | 01.07.2052            | 4.153.286        | 0,09                         |
| 2.460.607  | Fannie Mae Pool (BW9903) | 4,50 % | 01.10.2052            | 2.320.403        | 0,05                         |
| 1.471.774  | Fannie Mae Pool (BX3198) | 4,00 % | 01.12.2052            | 1.349.154        | 0,03                         |
| 2.192.794  | Fannie Mae Pool (BX5065) | 5,50 % | 01.01.2053            | 2.167.893        | 0,05                         |
| 1.904.629  | Fannie Mae Pool (BX7768) | 5,00 % | 01.03.2053            | 1.845.748        | 0,04                         |
| 1.934.679  | Fannie Mae Pool (BX8626) | 5,50 % | 01.04.2053            | 1.912.361        | 0,04                         |
| 3.688.823  | Fannie Mae Pool (BY3429) | 5,50 % | 01.06.2053            | 3.645.369        | 0,08                         |
| 1.804.103  | Fannie Mae Pool (BY3520) | 5,50 % | 01.06.2053            | 1.784.510        | 0,04                         |
| 376.202  | Fannie Mae Pool (BY3521) | 5,50 % | 01.06.2053            | 371.763          | 0,01                         |
| 3.650.797  | Fannie Mae Pool (CB2301) | 3,00 % | 01.12.2051            | 3.109.674        | 0,07                         |
| 1.113.109  | Fannie Mae Pool (CB2751) | 2,50 % | 01.02.2052            | 914.421          | 0,02                         |
| 521.032  | Fannie Mae Pool (CB2759) | 3,00 % | 01.02.2052            | 444.265          | 0,01                         |
| 2.014.577  | Fannie Mae Pool (CB3049) | 2,50 % | 01.03.2052            | 1.647.796        | 0,04                         |
| 2.265.971  | Fannie Mae Pool (CB3158) | 2,50 % | 01.03.2052            | 1.866.643        | 0,04                         |
| 580.405  | Fannie Mae Pool (CB3586) | 3,00 % | 01.05.2052            | 496.431          | 0,01                         |
| 2.763.540  | Fannie Mae Pool (CB3600) | 3,50 % | 01.05.2052            | 2.462.773        | 0,05                         |
| 2.524.388  | Fannie Mae Pool (CB3770) | 3,50 % | 01.06.2052            | 2.238.300        | 0,05                         |
| 782.323  | Fannie Mae Pool (CB3780) | 3,50 % | 01.05.2052            | 693.662          | 0,01                         |
| 3.014.037  | Fannie Mae Pool (CB3786) | 4,00 % | 01.06.2052            | 2.760.547        | 0,06                         |
| 2.190.715  | Fannie Mae Pool (CB3897) | 3,50 % | 01.06.2052            | 1.939.725        | 0,04                         |
| 1.263.494  | Fannie Mae Pool (CB3899) | 3,50 % | 01.06.2052            | 1.124.968        | 0,02                         |
| 3.270.539  | Fannie Mae Pool (CB3914) | 4,00 % | 01.06.2052            | 2.998.734        | 0,06                         |
| 262.537  | Fannie Mae Pool (CB4386) | 4,50 % | 01.08.2052            | 247.531          | 0,01                         |
| 427.077  | Fannie Mae Pool (CB4612) | 4,50 % | 01.09.2052            | 402.726          | 0,01                         |
| 3.403.054  | Fannie Mae Pool (CB4613) | 4,50 % | 01.09.2052            | 3.209.562        | 0,07                         |
| 2.262.117  | Fannie Mae Pool (CB4831) | 4,50 % | 01.10.2052            | 2.132.747        | 0,05                         |
| 2.104.305  | Fannie Mae Pool (CB4861) | 5,00 % | 01.10.2052            | 2.038.447        | 0,04                         |
| 4.580.519  | Fannie Mae Pool (CB5592) | 5,50 % | 01.02.2053            | 4.532.394        | 0,10                         |
| 1.609.898  | Fannie Mae Pool (CB5636) | 5,00 % | 01.02.2053            | 1.560.565        | 0,03                         |
| 1.401.509  | Fannie Mae Pool (CB5906) | 5,50 % | 01.03.2053            | 1.386.801        | 0,03                         |
| 4.186.887  | Fannie Mae Pool (CB6031) | 5,00 % | 01.04.2053            | 4.058.585        | 0,09                         |
| 5.999.762  | Fannie Mae Pool (CB6878) | 6,00 % | 01.08.2053            | 6.046.307        | 0,13                         |
| 2.637.386  | Fannie Mae Pool (CB8223) | 6,00 % | 01.03.2054            | 2.670.595        | 0,06                         |
| 1.830.232  | Fannie Mae Pool (DA5987) | 6,00 % | 01.02.2054            | 1.839.999        | 0,04                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung    | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|--------------------------|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Mortgage-Backed Securities 33,01 % (31. Dezember 2023: 45,47 %) (Fortsetzung)</b> |                          |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |                          |        |                       |                  |                              |
| 3.445.515  | Fannie Mae Pool (FM8658) | 2,50 % | 01.09.2051            | 2.813.758        | 0,06                         |
| 1.913.841  | Fannie Mae Pool (FM9846) | 2,50 % | 01.12.2051            | 1.563.852        | 0,03                         |
| 2.184.207  | Fannie Mae Pool (FS1172) | 3,00 % | 01.11.2051            | 1.872.638        | 0,04                         |
| 1.749.946  | Fannie Mae Pool (FS1185) | 3,50 % | 01.04.2052            | 1.551.985        | 0,03                         |
| 3.486.342  | Fannie Mae Pool (FS1381) | 3,00 % | 01.03.2052            | 2.972.628        | 0,06                         |
| 2.171.901  | Fannie Mae Pool (FS1857) | 2,50 % | 01.05.2052            | 1.784.217        | 0,04                         |
| 1.317.256  | Fannie Mae Pool (FS1866) | 3,50 % | 01.05.2052            | 1.170.623        | 0,02                         |
| 3.813.019  | Fannie Mae Pool (FS1921) | 2,50 % | 01.02.2052            | 3.140.519        | 0,07                         |
| 846.303  | Fannie Mae Pool (FS1948) | 4,00 % | 01.05.2052            | 775.340          | 0,02                         |
| 3.005.876  | Fannie Mae Pool (FS2043) | 2,50 % | 01.04.2052            | 2.474.315        | 0,05                         |
| 1.090.685  | Fannie Mae Pool (FS2078) | 3,50 % | 01.06.2052            | 967.073          | 0,02                         |
| 1.910.217  | Fannie Mae Pool (FS2707) | 3,50 % | 01.04.2052            | 1.702.005        | 0,04                         |
| 436.919  | Fannie Mae Pool (FS2805) | 2,50 % | 01.09.2052            | 359.292          | 0,01                         |
| 3.135.479  | Fannie Mae Pool (FS3205) | 2,50 % | 01.04.2052            | 2.579.697        | 0,06                         |
| 6.282.650  | Fannie Mae Pool (FS3213) | 3,50 % | 01.07.2052            | 5.562.832        | 0,12                         |
| 376.886  | Fannie Mae Pool (FS3334) | 3,00 % | 01.04.2052            | 320.873          | 0,01                         |
| 3.580.744  | Fannie Mae Pool (FS3539) | 3,50 % | 01.07.2052            | 3.172.271        | 0,07                         |
| 1.692.772  | Fannie Mae Pool (FS3642) | 5,00 % | 01.11.2052            | 1.639.004        | 0,04                         |
| 1.066.236  | Fannie Mae Pool (FS3662) | 5,00 % | 01.01.2053            | 1.033.573        | 0,02                         |
| 1.087.528  | Fannie Mae Pool (FS3747) | 5,50 % | 01.12.2052            | 1.075.977        | 0,02                         |
| 3.256.485  | Fannie Mae Pool (FS3881) | 5,50 % | 01.02.2053            | 3.221.477        | 0,07                         |
| 5.690.749  | Fannie Mae Pool (FS4110) | 2,50 % | 01.03.2052            | 4.664.470        | 0,10                         |
| 1.739.247  | Fannie Mae Pool (FS4190) | 5,00 % | 01.04.2053            | 1.685.950        | 0,04                         |
| 2.653.287  | Fannie Mae Pool (FS4357) | 5,50 % | 01.04.2053            | 2.634.873        | 0,06                         |
| 1.701.407  | Fannie Mae Pool (FS4874) | 5,50 % | 01.06.2053            | 1.688.088        | 0,04                         |
| 2.280.454  | Fannie Mae Pool (FS4933) | 6,00 % | 01.06.2053            | 2.296.125        | 0,05                         |
| 2.027.353  | Fannie Mae Pool (FS4967) | 4,00 % | 01.10.2052            | 1.858.446        | 0,04                         |
| 2.324.046  | Fannie Mae Pool (FS5116) | 5,50 % | 01.06.2053            | 2.307.918        | 0,05                         |
| 3.195.204  | Fannie Mae Pool (FS5235) | 5,50 % | 01.07.2053            | 3.163.012        | 0,07                         |
| 2.195.449  | Fannie Mae Pool (FS5701) | 4,00 % | 01.12.2052            | 2.012.877        | 0,04                         |
| 2.337.429  | Fannie Mae Pool (FS5835) | 6,00 % | 01.09.2053            | 2.366.523        | 0,05                         |
| 4.139.754  | Fannie Mae Pool (FS5850) | 6,00 % | 01.09.2053            | 4.162.268        | 0,09                         |
| 2.390.324  | Fannie Mae Pool (FS5888) | 6,00 % | 01.10.2053            | 2.415.079        | 0,05                         |
| 1.525.195  | Fannie Mae Pool (FS6084) | 6,00 % | 01.10.2053            | 1.543.241        | 0,03                         |
| 515.860  | Fannie Mae Pool (FS6256) | 3,50 % | 01.08.2052            | 457.424          | 0,01                         |
| 4.033.240  | Fannie Mae Pool (FS6288) | 5,50 % | 01.10.2053            | 4.001.077        | 0,09                         |
| 1.170.117  | Fannie Mae Pool (FS6471) | 3,00 % | 01.05.2052            | 997.459          | 0,02                         |
| 3.981.654  | Fannie Mae Pool (FS6941) | 6,00 % | 01.02.2054            | 4.031.861        | 0,09                         |
| 2.517.648  | Fannie Mae Pool (FS6943) | 3,00 % | 01.06.2052            | 2.144.503        | 0,05                         |
| 1.339.284  | Fannie Mae Pool (FS7587) | 5,50 % | 01.04.2054            | 1.326.267        | 0,03                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung    | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|--------------------------|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Mortgage-Backed Securities 33,01 % (31. Dezember 2023: 45,47 %) (Fortsetzung)</b> |                          |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |                          |        |                       |                  |                              |
| 1.548.544  | Fannie Mae Pool (FS7870) | 6,00 % | 01.05.2054            | 1.567.956        | 0,03                         |
| 2.119.642  | Fannie Mae Pool (FS7944) | 2,50 % | 01.06.2052            | 1.731.814        | 0,04                         |
| 1.323.287  | Fannie Mae Pool (FS7997) | 6,00 % | 01.05.2054            | 1.331.363        | 0,03                         |
| 6.210.904  | Fannie Mae Pool (FS8200) | 6,00 % | 01.06.2054            | 6.243.923        | 0,13                         |
| 4.850.112  | Fannie Mae Pool (FS8394) | 5,50 % | 01.07.2054            | 4.799.361        | 0,10                         |
| 3.226.701  | Fannie Mae Pool (FS8739) | 6,00 % | 01.08.2054            | 3.244.864        | 0,07                         |
| 4.232.651  | Fannie Mae Pool (FS9435) | 5,50 % | 01.06.2053            | 4.181.882        | 0,09                         |
| 1.084.412  | Fannie Mae Pool (MA4414) | 2,50 % | 01.09.2051            | 893.339          | 0,02                         |
| 1.996.187  | Fannie Mae Pool (MA4466) | 2,50 % | 01.11.2051            | 1.637.600        | 0,04                         |
| 2.884.787  | Fannie Mae Pool (MA4548) | 2,50 % | 01.02.2052            | 2.356.764        | 0,05                         |
| 689.238  | Fannie Mae Pool (MA4563) | 2,50 % | 01.03.2052            | 563.068          | 0,01                         |
| 1.414.992  | Fannie Mae Pool (MA4579) | 3,00 % | 01.04.2052            | 1.205.059        | 0,03                         |
| 4.179.413  | Fannie Mae Pool (MA4600) | 3,50 % | 01.05.2052            | 3.705.751        | 0,08                         |
| 3.592.233  | Fannie Mae Pool (MA4626) | 4,00 % | 01.06.2052            | 3.292.443        | 0,07                         |
| 506.461  | Fannie Mae Pool (MA4644) | 4,00 % | 01.05.2052            | 464.346          | 0,01                         |
| 888.427  | Fannie Mae Pool (MA4699) | 3,50 % | 01.08.2052            | 787.080          | 0,02                         |
| 6.472.783  | Fannie Mae Pool (MA4700) | 4,00 % | 01.08.2052            | 5.931.605        | 0,13                         |
| 4.014.249  | Fannie Mae Pool (MA4732) | 4,00 % | 01.09.2052            | 3.678.620        | 0,08                         |
| 11.874.627   | Fannie Mae Pool (MA5038) | 5,00 % | 01.06.2053            | 11.484.886       | 0,25                         |
| 4.155.691  | Fannie Mae Pool (MA5039) | 5,50 % | 01.06.2053            | 4.106.593        | 0,09                         |
| 4.081.495  | Fannie Mae Pool (MA5166) | 6,00 % | 01.10.2053            | 4.104.895        | 0,09                         |
| 967.001  | Fannie Mae Pool (MA5189) | 5,00 % | 01.11.2053            | 934.641          | 0,02                         |
| 2.249.570  | Fannie Mae Pool (MA5190) | 5,50 % | 01.11.2053            | 2.222.927        | 0,05                         |
| 9.898.027  | Fannie Mae Pool (MA5388) | 5,50 % | 01.06.2054            | 9.774.815        | 0,21                         |
| 1.847.386  | Freddie Mac Pool         | 2,50 % | 01.05.2051            | 1.519.193        | 0,03                         |
| 1.871.854  | Freddie Mac Pool         | 2,50 % | 01.06.2051            | 1.528.978        | 0,03                         |
| 7.902.079  | Freddie Mac Pool         | 2,50 % | 01.07.2051            | 6.455.238        | 0,14                         |
| 2.041.551  | Freddie Mac Pool         | 2,50 % | 01.09.2051            | 1.677.063        | 0,04                         |
| 1.410.597  | Freddie Mac Pool         | 2,50 % | 01.10.2051            | 1.150.266        | 0,02                         |
| 5.515.802  | Freddie Mac Pool         | 2,50 % | 01.11.2051            | 4.503.227        | 0,10                         |
| 1.212.145  | Freddie Mac Pool         | 2,50 % | 01.12.2051            | 996.305          | 0,02                         |
| 2.389.879  | Freddie Mac Pool         | 2,50 % | 01.01.2052            | 1.958.404        | 0,04                         |
| 2.586.344  | Freddie Mac Pool         | 2,50 % | 01.02.2052            | 2.116.796        | 0,05                         |
| 5.105.286  | Freddie Mac Pool         | 2,50 % | 01.03.2052            | 4.174.155        | 0,09                         |
| 5.384.500  | Freddie Mac Pool         | 2,50 % | 01.04.2052            | 4.402.598        | 0,09                         |
| 5.836.128  | Freddie Mac Pool         | 2,50 % | 01.05.2052            | 4.765.932        | 0,10                         |
| 1.160.868  | Freddie Mac Pool         | 2,50 % | 01.07.2052            | 954.830          | 0,02                         |
| 867.948  | Freddie Mac Pool         | 2,50 % | 01.09.2052            | 708.656          | 0,02                         |
| 1.537.162  | Freddie Mac Pool         | 3,00 % | 01.07.2051            | 1.316.603        | 0,03                         |
| 331.173  | Freddie Mac Pool         | 3,00 % | 01.11.2051            | 284.591          | 0,01                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|-----------------------|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Mortgage-Backed Securities 33,01 % (31. Dezember 2023: 45,47 %) (Fortsetzung)</b> |                       |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |                       |        |                       |                  |                              |
| 2.443.793  | Freddie Mac Pool      | 3,00 % | 01.12.2051            | 2.087.163        | 0,04                         |
| 432.535  | Freddie Mac Pool      | 3,00 % | 01.01.2052            | 368.717          | 0,01                         |
| 612.179  | Freddie Mac Pool      | 3,00 % | 01.02.2052            | 520.491          | 0,01                         |
| 431.489  | Freddie Mac Pool      | 3,00 % | 01.03.2052            | 368.941          | 0,01                         |
| 2.099.701  | Freddie Mac Pool      | 3,00 % | 01.04.2052            | 1.788.614        | 0,04                         |
| 2.581.913  | Freddie Mac Pool      | 3,00 % | 01.05.2052            | 2.199.341        | 0,05                         |
| 487.440  | Freddie Mac Pool      | 3,00 % | 01.06.2052            | 415.513          | 0,01                         |
| 4.018.598  | Freddie Mac Pool      | 3,00 % | 01.08.2052            | 3.419.697        | 0,07                         |
| 1.099.060  | Freddie Mac Pool      | 3,00 % | 01.09.2052            | 935.573          | 0,02                         |
| 645.840  | Freddie Mac Pool      | 3,00 % | 01.01.2053            | 551.220          | 0,01                         |
| 848.339  | Freddie Mac Pool      | 3,00 % | 01.09.2053            | 721.780          | 0,02                         |
| 949.920  | Freddie Mac Pool      | 3,50 % | 01.02.2052            | 844.753          | 0,02                         |
| 3.485.349  | Freddie Mac Pool      | 3,50 % | 01.04.2052            | 3.089.052        | 0,07                         |
| 1.040.869  | Freddie Mac Pool      | 3,50 % | 01.05.2052            | 921.983          | 0,02                         |
| 637.784  | Freddie Mac Pool      | 3,50 % | 01.06.2052            | 565.431          | 0,01                         |
| 2.956.511  | Freddie Mac Pool      | 3,50 % | 01.07.2052            | 2.620.404        | 0,06                         |
| 771.848  | Freddie Mac Pool      | 3,50 % | 01.08.2052            | 684.114          | 0,01                         |
| 5.494.511  | Freddie Mac Pool      | 3,50 % | 01.09.2052            | 4.870.981        | 0,10                         |
| 8.421.908  | Freddie Mac Pool      | 3,50 % | 01.10.2052            | 7.459.396        | 0,16                         |
| 3.154.287  | Freddie Mac Pool      | 3,50 % | 01.11.2052            | 2.793.554        | 0,06                         |
| 1.965.212  | Freddie Mac Pool      | 3,50 % | 01.12.2052            | 1.742.300        | 0,04                         |
| 1.239.853  | Freddie Mac Pool      | 3,50 % | 01.02.2053            | 1.098.449        | 0,02                         |
| 828.639  | Freddie Mac Pool      | 3,50 % | 01.05.2053            | 734.685          | 0,02                         |
| 1.722.731  | Freddie Mac Pool      | 4,00 % | 01.04.2052            | 1.578.206        | 0,03                         |
| 1.422.538  | Freddie Mac Pool      | 4,00 % | 01.05.2052            | 1.304.071        | 0,03                         |
| 1.378.040  | Freddie Mac Pool      | 4,00 % | 01.06.2052            | 1.263.274        | 0,03                         |
| 1.425.447  | Freddie Mac Pool      | 4,00 % | 01.07.2052            | 1.304.704        | 0,03                         |
| 3.116.580  | Freddie Mac Pool      | 4,00 % | 01.08.2052            | 2.857.022        | 0,06                         |
| 3.406.491  | Freddie Mac Pool      | 4,00 % | 01.09.2052            | 3.121.676        | 0,07                         |
| 1.659.403  | Freddie Mac Pool      | 4,00 % | 01.10.2052            | 1.521.408        | 0,03                         |
| 1.849.077  | Freddie Mac Pool      | 4,00 % | 01.12.2052            | 1.692.450        | 0,04                         |
| 3.353.457  | Freddie Mac Pool      | 4,00 % | 01.01.2053            | 3.070.387        | 0,07                         |
| 2.771.131  | Freddie Mac Pool      | 4,00 % | 01.02.2053            | 2.536.537        | 0,05                         |
| 4.259.044  | Freddie Mac Pool      | 4,00 % | 01.05.2053            | 3.898.153        | 0,08                         |
| 3.947.563  | Freddie Mac Pool      | 4,00 % | 01.06.2053            | 3.613.089        | 0,08                         |
| 3.771.629  | Freddie Mac Pool      | 4,00 % | 01.01.2054            | 3.452.333        | 0,07                         |
| 1.268.109  | Freddie Mac Pool      | 4,50 % | 01.06.2052            | 1.198.792        | 0,03                         |
| 2.009.642  | Freddie Mac Pool      | 4,50 % | 01.07.2052            | 1.891.957        | 0,04                         |
| 3.695.084  | Freddie Mac Pool      | 4,50 % | 01.08.2052            | 3.481.274        | 0,07                         |
| 8.727.380  | Freddie Mac Pool      | 4,50 % | 01.09.2052            | 8.228.551        | 0,18                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|-----------------------|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Mortgage-Backed Securities 33,01 % (31. Dezember 2023: 45,47 %) (Fortsetzung)</b> |                       |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |                       |        |                       |                  |                              |
| 3.873.849  | Freddie Mac Pool      | 4,50 % | 01.10.2052            | 3.651.901        | 0,08                         |
| 5.277.081  | Freddie Mac Pool      | 4,50 % | 01.11.2052            | 4.972.602        | 0,11                         |
| 3.783.337  | Freddie Mac Pool      | 4,50 % | 01.12.2052            | 3.567.433        | 0,08                         |
| 2.490.141  | Freddie Mac Pool      | 4,50 % | 01.04.2053            | 2.345.155        | 0,05                         |
| 6.172.594  | Freddie Mac Pool      | 4,50 % | 01.05.2053            | 5.820.653        | 0,13                         |
| 45.342   | Freddie Mac Pool      | 4,50 % | 01.07.2053            | 42.702           | 0,00                         |
| 6.169.693  | Freddie Mac Pool      | 5,00 % | 01.10.2052            | 5.976.114        | 0,13                         |
| 3.766.048  | Freddie Mac Pool      | 5,00 % | 01.11.2052            | 3.647.597        | 0,08                         |
| 1.350.879  | Freddie Mac Pool      | 5,00 % | 01.12.2052            | 1.308.390        | 0,03                         |
| 7.556.380  | Freddie Mac Pool      | 5,00 % | 01.01.2053            | 7.299.435        | 0,16                         |
| 7.617.452  | Freddie Mac Pool      | 5,00 % | 01.02.2053            | 7.376.674        | 0,16                         |
| 591.235  | Freddie Mac Pool      | 5,00 % | 01.03.2053            | 572.920          | 0,01                         |
| 4.854.434  | Freddie Mac Pool      | 5,00 % | 01.04.2053            | 4.698.988        | 0,10                         |
| 2.860.345  | Freddie Mac Pool      | 5,00 % | 01.05.2053            | 2.769.932        | 0,06                         |
| 14.241.090   | Freddie Mac Pool      | 5,00 % | 01.06.2053            | 13.777.903       | 0,30                         |
| 6.527.641  | Freddie Mac Pool      | 5,00 % | 01.07.2053            | 6.310.110        | 0,14                         |
| 4.867.152  | Freddie Mac Pool      | 5,00 % | 01.08.2053            | 4.710.692        | 0,10                         |
| 1.031.047  | Freddie Mac Pool      | 5,00 % | 01.09.2053            | 997.060          | 0,02                         |
| 7.294.668  | Freddie Mac Pool      | 5,00 % | 01.11.2053            | 7.050.442        | 0,15                         |
| 451.758  | Freddie Mac Pool      | 5,00 % | 01.01.2054            | 436.346          | 0,01                         |
| 642.052  | Freddie Mac Pool      | 5,00 % | 01.03.2054            | 620.147          | 0,01                         |
| 7.061.871  | Freddie Mac Pool      | 5,00 % | 01.04.2054            | 6.820.943        | 0,15                         |
| 1.440.977  | Freddie Mac Pool      | 5,00 % | 01.06.2054            | 1.392.705        | 0,03                         |
| 4.572.882  | Freddie Mac Pool      | 5,00 % | 01.11.2054            | 4.416.145        | 0,09                         |
| 2.171.976  | Freddie Mac Pool      | 5,50 % | 01.11.2052            | 2.150.457        | 0,05                         |
| 2.419.108  | Freddie Mac Pool      | 5,50 % | 01.12.2052            | 2.394.596        | 0,05                         |
| 2.519.944  | Freddie Mac Pool      | 5,50 % | 01.01.2053            | 2.490.429        | 0,05                         |
| 559.012  | Freddie Mac Pool      | 5,50 % | 01.02.2053            | 553.078          | 0,01                         |
| 4.350.639  | Freddie Mac Pool      | 5,50 % | 01.03.2053            | 4.297.046        | 0,09                         |
| 4.126.163  | Freddie Mac Pool      | 5,50 % | 01.04.2053            | 4.078.564        | 0,09                         |
| 7.244.884  | Freddie Mac Pool      | 5,50 % | 01.05.2053            | 7.163.579        | 0,15                         |
| 4.437.517  | Freddie Mac Pool      | 5,50 % | 01.06.2053            | 4.385.965        | 0,09                         |
| 3.144.482  | Freddie Mac Pool      | 5,50 % | 01.07.2053            | 3.109.303        | 0,07                         |
| 4.437.729  | Freddie Mac Pool      | 5,50 % | 01.08.2053            | 4.387.282        | 0,09                         |
| 491.404  | Freddie Mac Pool      | 5,50 % | 01.09.2053            | 487.994          | 0,01                         |
| 9.689.908  | Freddie Mac Pool      | 5,50 % | 01.10.2053            | 9.578.013        | 0,21                         |
| 9.043.082  | Freddie Mac Pool      | 5,50 % | 01.11.2053            | 8.938.657        | 0,19                         |
| 13.198.998   | Freddie Mac Pool      | 5,50 % | 01.12.2053            | 13.039.454       | 0,28                         |
| 740.370  | Freddie Mac Pool      | 5,50 % | 01.01.2054            | 731.287          | 0,02                         |
| 2.903.890  | Freddie Mac Pool      | 5,50 % | 01.02.2054            | 2.879.213        | 0,06                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung     | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|---------------------------|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Mortgage-Backed Securities 33,01 % (31. Dezember 2023: 45,47 %) (Fortsetzung)</b> |                           |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |                           |        |                       |                  |                              |
| 8.350.305  | Freddie Mac Pool          | 5,50 % | 01.03.2054            | 8.246.360        | 0,18                         |
| 7.605.471  | Freddie Mac Pool          | 5,50 % | 01.04.2054            | 7.510.798        | 0,16                         |
| 7.825.745  | Freddie Mac Pool          | 5,50 % | 01.06.2054            | 7.728.329        | 0,17                         |
| 2.382.654  | Freddie Mac Pool          | 5,50 % | 01.07.2054            | 2.352.622        | 0,05                         |
| 3.590.504  | Freddie Mac Pool          | 5,50 % | 01.08.2054            | 3.545.247        | 0,08                         |
| 1.957.559  | Freddie Mac Pool          | 5,50 % | 01.09.2054            | 1.932.879        | 0,04                         |
| 2.587.674  | Freddie Mac Pool          | 5,50 % | 01.10.2054            | 2.562.666        | 0,06                         |
| 2.381.843  | Freddie Mac Pool          | 6,00 % | 01.01.2053            | 2.394.713        | 0,05                         |
| 3.371.167  | Freddie Mac Pool          | 6,00 % | 01.05.2053            | 3.397.319        | 0,07                         |
| 3.386.465  | Freddie Mac Pool          | 6,00 % | 01.06.2053            | 3.428.535        | 0,07                         |
| 2.251.569  | Freddie Mac Pool          | 6,00 % | 01.07.2053            | 2.267.006        | 0,05                         |
| 3.297.447  | Freddie Mac Pool          | 6,00 % | 01.08.2053            | 3.337.274        | 0,07                         |
| 9.405.955  | Freddie Mac Pool          | 6,00 % | 01.09.2053            | 9.460.842        | 0,20                         |
| 4.315.750  | Freddie Mac Pool          | 6,00 % | 01.10.2053            | 4.339.645        | 0,09                         |
| 9.463.975  | Freddie Mac Pool          | 6,00 % | 01.12.2053            | 9.517.265        | 0,20                         |
| 650.954  | Freddie Mac Pool          | 6,00 % | 01.01.2054            | 655.268          | 0,01                         |
| 650.117  | Freddie Mac Pool          | 6,00 % | 01.02.2054            | 654.177          | 0,01                         |
| 11.870.628   | Freddie Mac Pool          | 6,00 % | 01.03.2054            | 11.933.830       | 0,26                         |
| 3.763.652  | Freddie Mac Pool          | 6,00 % | 01.04.2054            | 3.807.784        | 0,08                         |
| 1.512.941  | Freddie Mac Pool          | 6,00 % | 01.05.2054            | 1.522.869        | 0,03                         |
| 1.751.530  | Freddie Mac Pool          | 6,00 % | 01.06.2054            | 1.760.907        | 0,04                         |
| 2.899.234  | Freddie Mac Pool          | 6,00 % | 01.07.2054            | 2.917.778        | 0,06                         |
| 11.647.633   | Freddie Mac Pool          | 6,00 % | 01.09.2054            | 11.725.683       | 0,25                         |
| 2.349.873  | Freddie Mac Pool          | 6,00 % | 01.10.2054            | 2.362.017        | 0,05                         |
| 1.447.543  | Freddie Mac Pool          | 6,50 % | 01.07.2053            | 1.481.114        | 0,03                         |
| 1.334.565  | Freddie Mac Pool          | 6,50 % | 01.01.2054            | 1.362.921        | 0,03                         |
| 2.132.940  | Freddie Mac Pool          | 6,50 % | 01.03.2054            | 2.182.053        | 0,05                         |
| 1.461.389  | Freddie Mac Pool          | 6,50 % | 01.08.2054            | 1.492.956        | 0,03                         |
| 296.212  | Freddie Mac Pool (QC6452) | 2,50 % | 01.09.2051            | 242.202          | 0,00                         |
| 487.130  | Freddie Mac Pool (QE0322) | 2,50 % | 01.04.2052            | 397.191          | 0,01                         |
| 1.881.678  | Freddie Mac Pool (QE2363) | 3,50 % | 01.05.2052            | 1.667.847        | 0,04                         |
| 1.868.230  | Freddie Mac Pool (QE2482) | 3,50 % | 01.05.2052            | 1.655.305        | 0,04                         |
| 1.070.871  | Freddie Mac Pool (QE6058) | 4,50 % | 01.07.2052            | 1.008.777        | 0,02                         |
| 2.597.546  | Freddie Mac Pool (QE7028) | 4,50 % | 01.08.2052            | 2.448.441        | 0,05                         |
| 713.587  | Freddie Mac Pool (QE8253) | 4,50 % | 01.08.2052            | 672.710          | 0,01                         |
| 3.316.233  | Freddie Mac Pool (QF4916) | 5,00 % | 01.12.2052            | 3.205.372        | 0,07                         |
| 3.283.961  | Freddie Mac Pool (QF6256) | 5,00 % | 01.01.2053            | 3.180.323        | 0,07                         |
| 4.561.794  | Freddie Mac Pool (QH1480) | 5,50 % | 01.09.2053            | 4.505.011        | 0,10                         |
| 766.023  | Freddie Mac Pool (RA5546) | 3,00 % | 01.07.2051            | 656.115          | 0,01                         |
| 1.636.023  | Freddie Mac Pool (RA5855) | 2,50 % | 01.09.2051            | 1.343.683        | 0,03                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung     | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|---------------------------|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Mortgage-Backed Securities 33,01 % (31. Dezember 2023: 45,47 %) (Fortsetzung)</b> |                           |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |                           |        |                       |                  |                              |
| 646.543  | Freddie Mac Pool (RA6604) | 3,00 % | 01.01.2052            | 555.010          | 0,01                         |
| 2.123.385  | Freddie Mac Pool (RA7642) | 4,50 % | 01.08.2052            | 2.002.186        | 0,04                         |
| 948.071  | Freddie Mac Pool (RA7784) | 4,50 % | 01.08.2052            | 893.642          | 0,02                         |
| 2.273.441  | Freddie Mac Pool (RA7921) | 4,00 % | 01.09.2052            | 2.083.589        | 0,04                         |
| 1.925.484  | Freddie Mac Pool (RA8247) | 5,00 % | 01.11.2052            | 1.866.231        | 0,04                         |
| 1.210.579  | Freddie Mac Pool (RA8249) | 5,50 % | 01.11.2052            | 1.198.854        | 0,03                         |
| 889.019  | Freddie Mac Pool (SD0868) | 2,50 % | 01.02.2052            | 724.997          | 0,02                         |
| 3.762.335  | Freddie Mac Pool (SD1011) | 2,50 % | 01.04.2052            | 3.095.096        | 0,07                         |
| 3.459.959  | Freddie Mac Pool (SD1724) | 4,00 % | 01.09.2052            | 3.172.098        | 0,07                         |
| 1.037.872  | Freddie Mac Pool (SD1900) | 3,50 % | 01.06.2052            | 921.323          | 0,02                         |
| 1.066.434  | Freddie Mac Pool (SD1913) | 5,00 % | 01.11.2052            | 1.033.757        | 0,02                         |
| 938.229  | Freddie Mac Pool (SD2334) | 5,00 % | 01.02.2053            | 908.455          | 0,02                         |
| 5.872.696  | Freddie Mac Pool (SD2513) | 4,50 % | 01.08.2052            | 5.531.801        | 0,12                         |
| 1.944.783  | Freddie Mac Pool (SD2642) | 5,50 % | 01.04.2053            | 1.927.686        | 0,04                         |
| 2.606.033  | Freddie Mac Pool (SD2654) | 5,00 % | 01.04.2053            | 2.523.659        | 0,05                         |
| 591.474  | Freddie Mac Pool (SD2862) | 6,00 % | 01.05.2053            | 595.198          | 0,01                         |
| 1.798.868  | Freddie Mac Pool (SD3010) | 5,50 % | 01.06.2053            | 1.784.749        | 0,04                         |
| 737.979  | Freddie Mac Pool (SD3136) | 5,50 % | 01.06.2053            | 733.419          | 0,02                         |
| 1.185.343  | Freddie Mac Pool (SD3209) | 2,50 % | 01.04.2052            | 975.458          | 0,02                         |
| 1.864.974  | Freddie Mac Pool (SD3218) | 5,00 % | 01.05.2053            | 1.804.902        | 0,04                         |
| 665.902  | Freddie Mac Pool (SD3371) | 5,50 % | 01.05.2053            | 659.633          | 0,01                         |
| 1.507.141  | Freddie Mac Pool (SD3392) | 5,50 % | 01.07.2053            | 1.495.866        | 0,03                         |
| 1.730.596  | Freddie Mac Pool (SD3609) | 2,50 % | 01.04.2052            | 1.417.377        | 0,03                         |
| 711.628  | Freddie Mac Pool (SD3611) | 3,00 % | 01.03.2052            | 609.001          | 0,01                         |
| 3.141.930  | Freddie Mac Pool (SD3661) | 5,50 % | 01.08.2053            | 3.116.873        | 0,07                         |
| 1.214.623  | Freddie Mac Pool (SD3736) | 5,50 % | 01.09.2053            | 1.201.914        | 0,03                         |
| 1.727.138  | Freddie Mac Pool (SD3817) | 6,00 % | 01.09.2053            | 1.747.821        | 0,04                         |
| 5.420.616  | Freddie Mac Pool (SD4397) | 5,50 % | 01.11.2053            | 5.370.967        | 0,12                         |
| 1.081.002  | Freddie Mac Pool (SD4428) | 2,50 % | 01.05.2052            | 888.896          | 0,02                         |
| 1.303.091  | Freddie Mac Pool (SD4446) | 3,50 % | 01.06.2052            | 1.159.046        | 0,02                         |
| 936.489  | Freddie Mac Pool (SD4531) | 2,50 % | 01.04.2052            | 770.811          | 0,02                         |
| 953.258  | Freddie Mac Pool (SD4693) | 6,50 % | 01.01.2054            | 975.984          | 0,02                         |
| 2.393.158  | Freddie Mac Pool (SD4977) | 5,00 % | 01.11.2053            | 2.313.151        | 0,05                         |
| 461.597  | Freddie Mac Pool (SD5015) | 5,00 % | 01.03.2054            | 446.541          | 0,01                         |
| 3.402.524  | Freddie Mac Pool (SD5058) | 5,50 % | 01.03.2054            | 3.380.150        | 0,07                         |
| 1.153.952  | Freddie Mac Pool (SD5459) | 5,50 % | 01.04.2054            | 1.141.421        | 0,02                         |
| 2.945.881  | Freddie Mac Pool (SD5622) | 5,50 % | 01.06.2054            | 2.911.022        | 0,06                         |
| 6.917.128  | Freddie Mac Pool (SD5854) | 3,50 % | 01.12.2052            | 6.132.811        | 0,13                         |
| 1.472.682  | Freddie Mac Pool (SD6978) | 5,50 % | 01.07.2054            | 1.456.437        | 0,03                         |
| 5.638.291  | Freddie Mac Pool (SD8205) | 2,50 % | 01.04.2052            | 4.612.801        | 0,10                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung     | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|---------------------------|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Mortgage-Backed Securities 33,01 % (31. Dezember 2023: 45,47 %) (Fortsetzung)</b> |                           |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |                           |        |                       |                  |                              |
| 4.170.184  | Freddie Mac Pool (SD8206) | 3,00 % | 01.04.2052            | 3.552.784        | 0,08                         |
| 10.502.006   | Freddie Mac Pool (SD8213) | 3,00 % | 01.05.2052            | 8.936.604        | 0,19                         |
| 1.814.934  | Freddie Mac Pool (SD8214) | 3,50 % | 01.05.2052            | 1.609.012        | 0,03                         |
| 2.610.689  | Freddie Mac Pool (SD8220) | 3,00 % | 01.06.2052            | 2.222.053        | 0,05                         |
| 4.985.444  | Freddie Mac Pool (SD8221) | 3,50 % | 01.06.2052            | 4.419.874        | 0,10                         |
| 10.519.419   | Freddie Mac Pool (SD8226) | 3,50 % | 01.07.2052            | 9.326.051        | 0,20                         |
| 1.173.605  | Freddie Mac Pool (SD8231) | 4,50 % | 01.07.2052            | 1.105.208        | 0,02                         |
| 8.917.526  | Freddie Mac Pool (SD8237) | 4,00 % | 01.08.2052            | 8.170.644        | 0,18                         |
| 7.482.565  | Freddie Mac Pool (SD8238) | 4,50 % | 01.08.2052            | 7.045.632        | 0,15                         |
| 8.600.203  | Freddie Mac Pool (SD8257) | 4,50 % | 01.10.2052            | 8.108.947        | 0,17                         |
| 1.633.474  | Freddie Mac Pool (SD8275) | 4,50 % | 01.12.2052            | 1.538.992        | 0,03                         |
| 7.585.011  | Freddie Mac Pool (SD8300) | 5,50 % | 01.02.2053            | 7.504.735        | 0,16                         |
| 2.687.075  | Freddie Mac Pool (SD8307) | 5,00 % | 01.03.2053            | 2.601.585        | 0,06                         |
| 4.029.425  | Freddie Mac Pool (SD8323) | 5,00 % | 01.05.2053            | 3.895.215        | 0,08                         |
| 2.261.928  | Freddie Mac Pool (SD8348) | 5,00 % | 01.08.2053            | 2.185.860        | 0,05                         |
| 3.299.444  | Freddie Mac Pool (SD8350) | 6,00 % | 01.08.2053            | 3.319.036        | 0,07                         |
| 3.713.347  | Freddie Mac Pool (SD8362) | 5,50 % | 01.09.2053            | 3.671.136        | 0,08                         |
| 520.461  | Freddie Mac Pool (SD8396) | 6,00 % | 01.01.2054            | 523.285          | 0,01                         |
| 2.787.506  | Freddie Mac Pool (SD8401) | 5,50 % | 01.02.2054            | 2.752.807        | 0,06                         |
| 11.771.849   | Freddie Mac Pool (SD8402) | 6,00 % | 01.02.2054            | 11.834.524       | 0,25                         |
| 5.690.804  | Freddie Mac Pool (SD8421) | 6,00 % | 01.04.2054            | 5.721.103        | 0,12                         |
| 1.742.973  | Freddie Mac Pool (SD8432) | 6,00 % | 01.05.2054            | 1.752.253        | 0,04                         |
| 964.140  | Freddie Mac Pool (SD8469) | 5,50 % | 01.10.2054            | 951.987          | 0,02                         |
| 35.745.000   | Ginnie Mae                | 5,00 % | 01.01.2055            | 34.679.631       | 0,75                         |
| 28.130.000   | Ginnie Mae                | 5,50 % | 01.01.2055            | 27.901.842       | 0,60                         |
| 1.300.588  | Ginnie Mae II Pool        | 5,00 % | 20.11.2052            | 1.265.973        | 0,03                         |
| 1.448.898  | Ginnie Mae II Pool        | 5,00 % | 20.02.2053            | 1.409.853        | 0,03                         |
| 1.313.036  | Ginnie Mae II Pool        | 5,00 % | 20.03.2053            | 1.277.450        | 0,03                         |
| 918.226  | Ginnie Mae II Pool        | 5,00 % | 20.04.2053            | 893.056          | 0,02                         |
| 1.780.939  | Ginnie Mae II Pool        | 5,00 % | 20.05.2053            | 1.731.847        | 0,04                         |
| 3.331.644  | Ginnie Mae II Pool        | 5,00 % | 20.07.2053            | 3.238.779        | 0,07                         |
| 1.594.692  | Ginnie Mae II Pool        | 5,00 % | 20.08.2053            | 1.549.524        | 0,03                         |
| 2.124.970  | Ginnie Mae II Pool        | 5,00 % | 20.09.2053            | 2.065.084        | 0,04                         |
| 1.916.359  | Ginnie Mae II Pool        | 5,00 % | 20.10.2053            | 1.862.057        | 0,04                         |
| 4.464.620  | Ginnie Mae II Pool        | 5,00 % | 20.11.2053            | 4.338.111        | 0,09                         |
| 886.629  | Ginnie Mae II Pool        | 5,00 % | 20.01.2054            | 861.505          | 0,02                         |
| 2.559.932  | Ginnie Mae II Pool        | 5,00 % | 20.10.2054            | 2.485.802        | 0,05                         |
| 3.177.530  | Ginnie Mae II Pool        | 5,50 % | 20.06.2053            | 3.158.751        | 0,07                         |
| 3.837.524  | Ginnie Mae II Pool        | 5,50 % | 20.07.2053            | 3.816.698        | 0,08                         |
| 1.728.885  | Ginnie Mae II Pool        | 5,50 % | 20.08.2053            | 1.719.148        | 0,04                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$     | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|--------|-----------------------|----------------------|------------------------------|
| <b>Mortgage-Backed Securities 33,01 % (31. Dezember 2023: 45,47 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                      |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |        |                       |                      |                              |
| 1.054.704  | Ginnie Mae II Pool  | 5,50 % | 20.09.2053            | 1.048.548            | 0,02                         |
| 637.783  | Ginnie Mae II Pool  | 5,50 % | 20.02.2054            | 633.212              | 0,01                         |
| 5.484.069  | Ginnie Mae II Pool  | 5,50 % | 20.08.2054            | 5.444.745            | 0,12                         |
| 5.122.497  | Ginnie Mae II Pool  | 5,50 % | 20.10.2054            | 5.085.241            | 0,11                         |
| <b>Mortgage-Backed Securities insgesamt **</b>                                       |   |        |                       | <b>1.530.842.706</b> | <b>33,01</b>                 |
| <b>Kommunalanleihen 0,28 % (31. Dezember 2023: 0,64 %)</b>                           |   |        |                       |                      |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |   |        |                       |                      |                              |
| 565.000  | Bay Area Toll Authority   | 7,04 % | 01.04.2050            | 648.427              | 0,01                         |
| 845.000  | California State University   | 2,98 % | 01.11.2051            | 566.513              | 0,01                         |
| 875.000  | Central Texas Turnpike System   | 3,03 % | 15.08.2041            | 646.929              | 0,01                         |
| 265.000  | City of Atlantic City NJ  | 4,29 % | 01.09.2026            | 264.493              | 0,01                         |
| 845.000  | Commonwealth Financing Authority                                      | 3,53 % | 01.06.2042            | 680.981              | 0,02                         |
| 845.000  | County of Clark NV  | 3,23 % | 01.07.2044            | 620.989              | 0,01                         |
| 705.000  | Dallas Area Rapid Transit   | 2,82 % | 01.12.2042            | 518.948              | 0,01                         |
| 795.000  | Foothill-Eastern Transportation Corridor Agency                       | 3,92 % | 15.01.2053            | 611.070              | 0,01                         |
| 845.000  | Grand Parkway Transportation Corp                                     | 3,24 % | 01.10.2052            | 587.306              | 0,01                         |
| 845.000  | Highland Local School District/Medina County                          | 3,19 % | 01.12.2049            | 601.951              | 0,01                         |
| 845.000  | JobsOhio Beverage System  | 2,83 % | 01.01.2038            | 671.794              | 0,02                         |
| 460.000  | Los Angeles Community College District                                | 6,75 % | 01.08.2049            | 512.426              | 0,01                         |
| 400.000  | Massachusetts Educational Financing Authority                         | 4,08 % | 01.07.2027            | 394.116              | 0,01                         |
| 725.000  | Michigan Finance Authority  | 3,38 % | 01.12.2040            | 580.463              | 0,01                         |
| 200.000  | New Jersey Housing & Mortgage Finance Agency                          | 3,80 % | 01.10.2032            | 192.456              | 0,01                         |
| 300.000  | New Jersey Turnpike Authority   | 7,10 % | 01.01.2041            | 335.384              | 0,01                         |
| 1.125.000  | New York State Dormitory Authority                                    | 2,69 % | 01.07.2040            | 824.712              | 0,02                         |
| 840.000  | Ohio Turnpike & Infrastructure Commission                             | 3,22 % | 15.02.2048            | 611.251              | 0,01                         |
| 845.000  | Ohio University   | 2,91 % | 01.12.2043            | 610.109              | 0,01                         |
| 350.000  | Pennsylvania Turnpike Commission                                      | 3,25 % | 01.12.2043            | 257.949              | 0,01                         |
| 705.000  | Regents of the University of California Medical Center Pooled Revenue | 3,01 % | 15.05.2050            | 461.576              | 0,01                         |
| 565.000  | State of California   | 7,63 % | 01.03.2040            | 666.447              | 0,02                         |
| 530.000  | Texas Private Activity Bond Surface Transportation Corp               | 3,92 % | 31.12.2049            | 419.974              | 0,01                         |
| 845.000  | Utah Transit Authority  | 2,77 % | 15.12.2038            | 645.564              | 0,01                         |
| <b>Kommunalanleihen insgesamt †</b>  |   |        |                       | <b>12.931.828</b>    | <b>0,28</b>                  |
| <b>Mittelfristige Schuldverschreibungen^ 5,47 % (31. Dezember 2023: 0,02 %)</b>      |   |        |                       |                      |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |   |        |                       |                      |                              |
| 4.948.849  | Allied Universal Holdco LLC   | 8,21 % | 12.05.2028            | 4.971.168            | 0,11                         |
| 4.987.500  | Alpha Generation LLC  | 7,11 % | 30.09.2031            | 5.028.647            | 0,11                         |
| 5.000.000  | AQA Acquisition Holding Inc   | 0,00 % | 03.03.2028            | 5.050.000            | 0,11                         |
| 206.897  | ArchKey Holdings Inc  | 1,00 % | 01.11.2031            | 208.610              | 0,00                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|--------------------------------------|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Mittelfristige Schuldverschreibungen<sup>^</sup> 5,47 % (31. Dezember 2023: 0,02 %) (Fortsetzung)</b> |                                      |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |                                      |         |                       |                  |                              |
| 4.482.759  | ArchKey Holdings Inc                 | 9,30 %  | 10.10.2031            | 4.519.876        | 0,10                         |
| 4.977.462  | Artera Services LLC                  | 8,83 %  | 15.02.2031            | 4.942.545        | 0,11                         |
| 4.975.031  | Auris Luxembourg III Sarl            | 8,18 %  | 28.02.2029            | 5.040.328        | 0,11                         |
| 2.992.272  | Aveanna Healthcare LLC               | 8,36 %  | 17.07.2028            | 2.972.269        | 0,06                         |
| 5.000.000  | Aveanna Healthcare LLC               | 11,66 % | 10.12.2029            | 4.837.500        | 0,10                         |
| 4.949.239  | Bausch & Lomb Corp                   | 7,69 %  | 10.05.2027            | 4.974.207        | 0,11                         |
| 8.000.000  | BCPE Empire Holdings Inc             | 0,00 %  | 11.12.2028            | 8.054.200        | 0,17                         |
| 4.987.500  | Belron Finance 2019 LLC              | 7,27 %  | 16.10.2031            | 5.041.290        | 0,11                         |
| 5.000.000  | Champ Acquisition Corp               | 0,00 %  | 25.11.2031            | 5.050.000        | 0,11                         |
| 1.492.500  | Champions Holdco Inc                 | 9,27 %  | 23.02.2029            | 1.417.412        | 0,03                         |
| 4.948.980  | Chariot Buyer LLC                    | 7,71 %  | 03.11.2028            | 4.984.563        | 0,11                         |
| 7.494.916  | Commscope LLC                        | 9,86 %  | 17.12.2029            | 7.602.693        | 0,16                         |
| 5.000.000  | Creative Artists Agency LLC          | 7,11 %  | 01.10.2031            | 5.030.200        | 0,11                         |
| 1.500.000  | Cube Industrials Buyer Inc           | 8,13 %  | 17.10.2031            | 1.511.873        | 0,03                         |
| 1.772.398  | Deerfield Dakota Holding LLC         | 11,34 % | 07.04.2028            | 1.703.718        | 0,04                         |
| 5.000.000  | Edelman Financial Engines Center LLC | 9,61 %  | 06.10.2028            | 5.051.575        | 0,11                         |
| 4.049.887  | Ellucian Holdings Inc                | 7,36 %  | 09.10.2029            | 4.082.286        | 0,09                         |
| 5.000.000  | Engineered Machinery Holdings Inc    | 10,59 % | 21.05.2029            | 5.025.000        | 0,11                         |
| 7.532.791  | Glatfelter Corp                      | 8,76 %  | 04.11.2031            | 7.559.457        | 0,16                         |
| 2.992.481  | Greystar Real Estate Partners LLC    | 7,09 %  | 21.08.2030            | 3.018.665        | 0,06                         |
| 2.978.300  | HAH Group Holding Co LLC             | 9,36 %  | 24.09.2031            | 2.982.827        | 0,06                         |
| 570.342  | Hanger Inc Delayed Draw Term Loan    | 0,00 %  | 23.10.2031            | 576.687          | 0,01                         |
| 4.429.658  | Hanger Inc Term Loan                 | 0,00 %  | 23.10.2031            | 4.478.938        | 0,10                         |
| 4.987.500  | Hunterstown Generation LLC           | 7,83 %  | 06.11.2031            | 5.027.400        | 0,11                         |
| 3.000.000  | Icon Parent I Inc                    | 0,00 %  | 12.11.2032            | 3.055.005        | 0,07                         |
| 5.000.000  | Leia Finco US LLC                    | 9,89 %  | 09.10.2032            | 4.966.650        | 0,11                         |
| 10.000.000   | Level 3 Financing Inc                | 10,92 % | 15.04.2030            | 10.208.750       | 0,22                         |
| 564.445  | Lids Holdings Inc                    | 10,00 % | 14.12.2026            | 560.212          | 0,01                         |
| 8.000.000  | LifePoint Health Inc                 | 8,41 %  | 17.05.2031            | 8.038.360        | 0,17                         |
| 4.874.374  | Lightstone Holdco LLC B Term Loan    | 10,34 % | 29.01.2027            | 4.938.350        | 0,11                         |
| 275.723  | Lightstone Holdco LLC C Term Loan    | 10,34 % | 29.01.2027            | 279.342          | 0,01                         |
| 1.970.000  | Maverick Bidco Inc                   | 9,10 %  | 18.05.2028            | 1.972.463        | 0,04                         |
| 1.269.816  | Men's Wearhouse LLC                  | 11,06 % | 26.02.2029            | 1.270.876        | 0,03                         |
| 5.000.000  | MH Sub I LLC                         | 10,61 % | 23.02.2029            | 4.963.550        | 0,11                         |
| 84.258   | National Mentor Holdings Inc         | 8,18 %  | 02.03.2028            | 83.666           | 0,00                         |
| 2.908.188  | National Mentor Holdings Inc         | 8,20 %  | 02.03.2028            | 2.887.729        | 0,06                         |
| 5.000.000  | National Mentor Holdings Inc         | 11,68 % | 02.03.2029            | 4.781.250        | 0,10                         |
| 7.342.168  | Nautilus Power LLC                   | 9,84 %  | 16.11.2026            | 7.318.563        | 0,16                         |
| 4.953.173  | Northeast Grocery Inc                | 12,02 % | 13.12.2028            | 4.994.458        | 0,11                         |
| 5.000.000  | Nouryon Finance BV                   | 7,66 %  | 03.04.2028            | 5.045.325        | 0,11                         |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Mittelfristige Schuldverschreibungen<sup>^</sup> 5,47 % (31. Dezember 2023: 0,02 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                    |                              |
| 5.500.000  | PMHC II Inc   | 0,00 %  | 23.04.2029            | 5.432.790          | 0,12                         |
| 4.962.563  | Prairie ECI Acquiror LP   | 8,61 %  | 01.08.2029            | 5.005.985          | 0,11                         |
| 2.000.000  | Project Alpha Intermediate Holding Inc  | 0,00 %  | 22.11.2032            | 2.032.510          | 0,04                         |
| 9.295.896  | Revere Power LLC B Term Loan  | 8,73 %  | 27.03.2026            | 9.217.486          | 0,20                         |
| 820.071  | Revere Power LLC C Term Loan  | 8,73 %  | 27.03.2026            | 813.154            | 0,02                         |
| 4.948.586  | S&S Holdings LLC  | 9,46 %  | 11.03.2028            | 4.944.256          | 0,11                         |
| 1.980.000  | Summer BC Bidco B LLC   | 9,59 %  | 15.02.2029            | 1.996.711          | 0,04                         |
| 4.831.306  | TEAM Services Group LLC   | 9,47 %  | 20.12.2027            | 4.863.531          | 0,10                         |
| 4.987.500  | Thunder Generation Funding LLC  | 7,33 %  | 03.10.2031            | 5.026.452          | 0,11                         |
| 5.000.000  | Trident TPI Holdings Inc  | 0,00 %  | 15.09.2028            | 5.051.125          | 0,11                         |
| 1.962.500  | Trulite Holding Corp  | 10,59 % | 01.03.2030            | 1.960.047          | 0,04                         |
| 7.967.481  | Verde Purchaser LLC   | 8,83 %  | 30.11.2030            | 8.002.339          | 0,17                         |
| 3.000.000  | White Cap Supply Holdings LLC   | 7,61 %  | 19.10.2029            | 3.009.495          | 0,06                         |
| 4.987.469  | Windsor Holdings III LLC  | 7,86 %  | 01.08.2030            | 5.056.046          | 0,11                         |
| 5.176.293  | WWEX UNI TopCo Holdings LLC   | 8,33 %  | 26.07.2028            | 5.214.390          | 0,11                         |
| <b>Mittelfristige Schuldverschreibungen insgesamt<sup>†</sup></b>  |   |         |                       | <b>253.734.800</b> | <b>5,47</b>                  |
| <b>Pensionsgeschäfte 1,78 % (31. Dezember 2023: 0,00 %)</b>  |   |         |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |   |         |                       |                    |                              |
| 82.500.000   | State Street Bank and Trust Co, repurchase value US\$ 82,520,304 <sup>^</sup> | 4,43 %  | 02.01.2025            | 82.500.000         | 1,78                         |
| <b>Pensionsgeschäfte insgesamt<sup>†</sup></b>   |   |         |                       | <b>82.500.000</b>  | <b>1,78</b>                  |

<sup>^</sup> Besichert über US-Schatz-/Staatsanleihen mit einem Wert von insgesamt USD 84.150.019.

| Anzahl<br>der Anteile                                     | Wertpapierbezeichnung                                | Zeitwert<br>US\$     | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|---|--|----------------------|------------------------------|
| <b>Investmentfonds 1,22 % (31. Dezember 2023: 3,01 %)</b> |  |                      |                              |
| <b>Britisches Pfund</b>                                   |  |                      |                              |
| 21.035  | NB Global Monthly Income Fund Ltd                    | 15.148               | 0,00                         |
| <b>Britisches Pfund insgesamt</b>                         |  | <b>15.148</b>        | <b>0,00</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>  |  |                      |                              |
| 383.815   | Neuberger Berman China Bond Fund                     | 3.841.993            | 0,08                         |
| 760.691   | Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund      | 10.109.588           | 0,22                         |
| 486.855   | Neuberger Berman European High Yield Bond Fund       | 7.137.293            | 0,16                         |
| 459.982   | Neuberger Berman Global Flexible Credit Income Fund  | 6.076.356            | 0,13                         |
| 654.438   | Neuberger Berman Global High Yield Engagement Fund   | 9.777.308            | 0,21                         |
| 2.000.000   | Neuberger Berman Global Investment Grade Credit Fund | 19.540.000           | 0,42                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>                                |  | <b>56.482.538</b>    | <b>1,22</b>                  |
| <b>Investmentfonds insgesamt<sup>#</sup></b>              |  | <b>56.497.686</b>    | <b>1,22</b>                  |
| <b>Anlagen insgesamt</b>                                  |  | <b>4.599.297.666</b> | <b>99,19</b>                 |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 0,85 % (31. Dezember 2023: 1,01 %)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 1.667.245.064 COP  | 373.619 US\$        | 16.01.2025       | Barclays Bank Plc           | 1         | 4.123                          | 0,00                 |
| 1.492.295.556 COP  | 337.057 US\$        | 16.01.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 1.048                          | 0,00                 |
| 874.545 €          | 21.960.721 CZK      | 17.01.2025       | Citibank NA                 | 1         | 2.610                          | 0,00                 |
| 871.013 €          | 359.138.663 HUF     | 19.03.2025       | Citibank NA                 | 2         | 4.318                          | 0,00                 |
| 154.434 €          | 63.913.334 HUF      | 19.03.2025       | Goldman Sachs International | 1         | 172                            | 0,00                 |
| 631.390 €          | 2.693.933 PLN       | 17.01.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 2.292                          | 0,00                 |
| 1.587.463 £        | 1.900.000 €         | 16.01.2025       | Citibank NA                 | 1         | 19.416                         | 0,00                 |
| 979.693 £          | 1.176.856 €         | 16.01.2025       | Royal Bank of Canada        | 1         | 7.545                          | 0,00                 |
| 403.771.757 HUF    | 974.318 €           | 19.03.2025       | Citibank NA                 | 1         | 281                            | 0,00                 |
| 22.394.468 PHP     | 382.397 US\$        | 19.03.2025       | Citibank NA                 | 1         | 670                            | 0,00                 |
| 862.651 RON        | 171.894 €           | 17.01.2025       | Citibank NA                 | 3         | 1.293                          | 0,00                 |
| 4.273.885 RON      | 851.288 €           | 17.01.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 6         | 6.753                          | 0,00                 |
| 1.156.946 RON      | 231.318 €           | 17.01.2025       | Standard Chartered Bank     | 1         | 924                            | 0,00                 |
| 23.401.795 THB     | 683.349 US\$        | 02.01.2025       | Citibank NA                 | 2         | 3.022                          | 0,00                 |
| 4.268.598 TRY      | 92.412 US\$         | 24.03.2025       | Citibank NA                 | 1         | 19.339                         | 0,00                 |
| 39.400.514 TRY     | 949.043 US\$        | 27.05.2025       | Goldman Sachs International | 2         | 23.324                         | 0,00                 |
| 10.516.431 TRY     | 234.442 US\$        | 24.03.2025       | Goldman Sachs International | 3         | 40.876                         | 0,00                 |
| 37.282.049 TRY     | 888.726 US\$        | 09.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | 159.847                        | 0,00                 |
| 55.325 US\$        | 7.801.832 ¥         | 16.01.2025       | Citibank NA                 | 1         | 5.604                          | 0,00                 |
| 1.097.584 US\$     | 36.472.004 THB      | 02.01.2025       | Citibank NA                 | 3         | 27.867                         | 0,00                 |
| 609.345 US\$       | 2.677.447.538 COP   | 16.01.2025       | Citibank NA                 | 1         | 2.724                          | 0,00                 |
| 5.023 US\$         | 52.924 NOK          | 16.01.2025       | Citibank NA                 | 1         | 363                            | 0,00                 |
| 57.169 US\$        | 1.059.881 ZAR       | 19.03.2025       | Citibank NA                 | 1         | 1.384                          | 0,00                 |
| 640.403 US\$       | 608.560 €           | 05.02.2025       | Citibank NA                 | 1         | 9.384                          | 0,00                 |
| 667.230 US\$       | 898.059 SGD         | 20.03.2025       | Citibank NA                 | 1         | 6.905                          | 0,00                 |
| 1.003.181 US\$     | 952.722 €           | 03.01.2025       | Citibank NA                 | 2         | 16.637                         | 0,00                 |
| 169.766 US\$       | 1.045.170 BRL       | 05.03.2025       | Citibank NA                 | 1         | 2.503                          | 0,00                 |
| 182.460.643 US\$   | 164.319.891 €       | 16.01.2025       | Citibank NA                 | 5         | 12.216.952                     | 0,26                 |
| 3.589.686 US\$     | 1.282.074.018 HUF   | 16.01.2025       | Citibank NA                 | 1         | 364.514                        | 0,01                 |
| 20.042.994 US\$    | 15.127.833 £        | 16.01.2025       | Citibank NA                 | 3         | 1.099.056                      | 0,02                 |
| 372.059 US\$       | 12.068.687 TWD      | 22.01.2025       | Citibank NA                 | 1         | 4.981                          | 0,00                 |
| 6.762.064 US\$     | 134.909.994 MXN     | 16.01.2025       | Citibank NA                 | 1         | 289.000                        | 0,01                 |
| 667.872 US\$       | 956.913.488 KRW     | 20.03.2025       | Goldman Sachs International | 1         | 18.569                         | 0,00                 |
| 908.849 US\$       | 4.044.775 MYR       | 19.03.2025       | Goldman Sachs International | 1         | 1.420                          | 0,00                 |
| 24.910.000 US\$    | 23.945.683 €        | 05.02.2025       | Goldman Sachs International | 1         | 80.588                         | 0,00                 |
| 160.000 US\$       | 1.762.264 SEK       | 05.02.2025       | Goldman Sachs International | 1         | 221                            | 0,00                 |
| 1.510.000 US\$     | 2.428.024 AUD       | 05.02.2025       | Goldman Sachs International | 1         | 6.620                          | 0,00                 |
| 220.000 US\$       | 1.577.113 DKK       | 05.02.2025       | Goldman Sachs International | 1         | 626                            | 0,00                 |
| 8.096.259 US\$     | 6.253.357 £         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | 265.447                        | 0,01                 |
| 10.134.095 US\$    | 1.427.427.875 ¥     | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | 1.037.145                      | 0,02                 |
| 78 US\$            | 2.578 THB           | 02.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | 2                              | 0,00                 |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 0,85 % (31. Dezember 2023: 1,01 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag              | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 2.070.000 US\$                  | 2.971.406 CAD       | 05.02.2025       | Goldman Sachs International | 1         | 1.336                          | 0,00                 |
| 54.627 US\$                     | 51.557 €            | 03.01.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 1.240                          | 0,00                 |
| 43.189 US\$                     | 896.461 MXN         | 04.02.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 328                            | 0,00                 |
| 157.312.564 US\$                | 141.164.240 €       | 16.01.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 5         | 11.059.296                     | 0,24                 |
| 667.667 US\$                    | 652.331.022 CLP     | 19.03.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 12.338                         | 0,00                 |
| 1.207.781 US\$                  | 8.773.109 CNY       | 19.03.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 10.706                         | 0,00                 |
| 101.229.040 US\$                | 78.000.000 £        | 16.01.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 3.552.978                      | 0,08                 |
| 3.804.853 US\$                  | 549.164.494 ¥       | 16.01.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 3         | 305.047                        | 0,01                 |
| 39.221.077 US\$                 | 29.322.763 £        | 16.01.2025       | Royal Bank of Canada        | 2         | 2.501.436                      | 0,05                 |
| 70.531.726 US\$                 | 65.192.112 €        | 16.01.2025       | Royal Bank of Canada        | 3         | 2.989.412                      | 0,07                 |
| 506.342 US\$                    | 400.000 £           | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | 5.439                          | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i> |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 9.950.114 US\$                  | 15.109.324 AUD      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 6         | 594.998                        | 0,01                 |
| 3.196.577 US\$                  | 4.940.297 AUD       | 16.01.2025       | UBS AG                      | 3         | 137.735                        | 0,00                 |
| 6.046.456 US\$                  | 9.455.930 AUD       | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 32        | 191.706                        | 0,01                 |
| <i>Abgesicherte Klassen CNY</i> |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 619 CNY                         | 84 US\$             | 03.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | 0                              | 0,00                 |
| 2.873.725 US\$                  | 20.406.819 CNY      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 3         | 94.177                         | 0,00                 |
| 15.965.133 US\$                 | 114.370.197 CNY     | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 43        | 387.126                        | 0,01                 |
| 18.091 US\$                     | 132.401 CNY         | 03.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | 57                             | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 556.101 €                       | 576.126 US\$        | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | 23                             | 0,00                 |
| 1.539.292 US\$                  | 1.430.610 €         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 3         | 57.108                         | 0,00                 |
| 2.376.382 US\$                  | 2.199.969 €         | 16.01.2025       | UBS AG                      | 4         | 97.104                         | 0,00                 |
| 6.309.077 US\$                  | 5.877.453 €         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 31        | 219.741                        | 0,01                 |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i> |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 179.880 £                       | 225.065 US\$        | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 2         | 191                            | 0,00                 |
| 962.934 US\$                    | 742.850 £           | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 2         | 32.695                         | 0,00                 |
| 1.473.231 US\$                  | 1.136.056 £         | 16.01.2025       | UBS AG                      | 3         | 50.597                         | 0,00                 |
| 3.752.424 US\$                  | 2.915.056 £         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 30        | 102.025                        | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen HKD</i> |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 15.646.444 HKD                  | 2.013.677 US\$      | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | 714                            | 0,00                 |
| 33.128.413 HKD                  | 4.260.090 US\$      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 23        | 5.007                          | 0,00                 |
| 4.388.948 US\$                  | 34.067.599 HKD      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 2         | 2.937                          | 0,00                 |
| 1.080.622 US\$                  | 8.386.438 HKD       | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | 916                            | 0,00                 |
| 16.292.066 US\$                 | 126.462.551 HKD     | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 23        | 10.728                         | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen JPY</i> |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 122.314.531 ¥                   | 778.687 US\$        | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 5         | 819                            | 0,00                 |
| 7.037.495 US\$                  | 1.045.322.223 ¥     | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 4         | 375.691                        | 0,01                 |
| 3.360.425 US\$                  | 500.386.242 ¥       | 16.01.2025       | UBS AG                      | 2         | 171.479                        | 0,00                 |
| 1.839.289 US\$                  | 277.059.296 ¥       | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 31        | 73.601                         | 0,00                 |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 0,85 % (31. Dezember 2023: 1,01 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>   |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 5.046.388 US\$  | 6.647.413 SGD       | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 2         | 170.884                        | 0,00                 |
| 2.038.155 US\$  | 2.644.783 SGD       | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | 98.355                         | 0,00                 |
| 11.553.576 US\$   | 15.337.241 SGD      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 33        | 304.571                        | 0,01                 |
| <i>Abgesicherte Klassen ZAR</i>   |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 328.441 US\$  | 5.886.222 ZAR       | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 4         | 16.891                         | 0,00                 |
| 114.615 US\$  | 2.101.238 ZAR       | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | 3.399                          | 0,00                 |
| 5.314.425 US\$  | 95.415.657 ZAR      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 43        | 264.192                        | 0,01                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>39.661.388</b>              | <b>0,85</b>          |

### Futures-Kontrakte 0,16 % (31. Dezember 2023: 0,18 %)

| Anzahl Kontrakte   | Beschreibung                                     | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|--|--------------------------------|----------------------|
| 100  | 30 Day Federal Funds Future January 2025         | 3.125                          | 0,00                 |
| (351)  | Euro-BOBL Future March 2025                      | 581.558                        | 0,02                 |
| (3)  | Euro-OAT Future March 2025                       | 8.823                          | 0,00                 |
| (40)   | United Kingdom Long Gilt Future March 2025       | 25.273                         | 0,00                 |
| (176)  | US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2025 | 368.500                        | 0,01                 |
| (450)  | US Treasury Long Bond (CBT) Future March 2025    | 1.969.350                      | 0,04                 |
| (636)  | US Treasury Ultra Bond (CBT) Future March 2025   | 4.279.780                      | 0,09                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten <sup>*</sup></b> |  |                                | <b>7.236.409</b>     |

### Credit-Default-Swap-Kontrakte 0,08 % (31. Dezember 2023: 0,04 %)

| Nominalwert   | Fälligkeit | Gegenpartei                 | Referenzverbindlichkeit                       | Zeitwert US\$    | % des Nettovermögens |
|---|------------|-----------------------------|---|------------------|----------------------|
| USD 47.000.000  | 20.12.2029 | ICE Clear U.S. <sup>1</sup> | Selling default protection on CDX.NA.HY.43.V1 | 3.617.045        | 0,08                 |
| <b>Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt <sup>*</sup></b> |            |                             |   | <b>3.617.045</b> | <b>0,08</b>          |

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

### Inflation-Swap-Kontrakte 0,00 % (31. Dezember 2023: 0,00 %)

| Nominalwert   | Fälligkeit | Gegenpartei                   | Erhalt/ (Zahlung) <sup>#</sup> | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|------------|-------------------------------|--------------------------------|-----------------|--------------------|--------------------------------|----------------------|
| USD 22.200.000  | 02.12.2026 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | (Zahlung)                      | 2,58 %          | CPURNSA            | 6.683                          | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten <sup>∞</sup></b> |            |                               |                                |                 |                    | <b>6.683</b>                   | <b>0,00</b>          |

<sup>#</sup>Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

|  | Zeitwert<br>US\$     | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|----------------------|------------------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> | <b>4.649.819.191</b> | <b>100,28</b>                |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (1,68 %) (31. Dezember 2023: (0,27 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettövermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 20.864.609 BRL     | 3.531.379 US\$      | 05.03.2025       | Citibank NA                 | 1         | (192.331)                       | (0,00)               |
| 19.592.090 BRL     | 3.220.000 US\$      | 09.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (52.435)                        | (0,00)               |
| 3.441.567.177 COP  | 784.925 US\$        | 16.01.2025       | Citibank NA                 | 1         | (5.181)                         | (0,00)               |
| 50.096 €           | 250.519 RON         | 17.01.2025       | Barclays Bank Plc           | 1         | (192)                           | (0,00)               |
| 180.222 €          | 190.150 US\$        | 03.01.2025       | Barclays Bank Plc           | 1         | (3.530)                         | (0,00)               |
| 273.589 €          | 1.368.343 RON       | 17.01.2025       | Citibank NA                 | 2         | (1.088)                         | (0,00)               |
| 722.593 €          | 759.415 US\$        | 03.01.2025       | Citibank NA                 | 2         | (11.170)                        | (0,00)               |
| 43.934 €           | 36.911 £            | 16.01.2025       | Citibank NA                 | 1         | (704)                           | (0,00)               |
| 286.113 €          | 299.875 US\$        | 03.01.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 2         | (3.605)                         | (0,00)               |
| 101.771 €          | 106.919 US\$        | 05.02.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | (1.392)                         | (0,00)               |
| 492 €              | 552 US\$            | 16.01.2025       | Royal Bank of Canada        | 1         | (41)                            | (0,00)               |
| 82.000.002 £       | 103.471.686 US\$    | 16.01.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 2         | (786.594)                       | (0,02)               |
| 20.736.800 HUF     | 57.997 US\$         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (5.832)                         | (0,00)               |
| 691.000.000 ¥      | 4.899.502 US\$      | 16.01.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | (495.782)                       | (0,01)               |
| 282.650.725 KZT    | 550.414 US\$        | 14.05.2025       | Goldman Sachs International | 3         | (30.151)                        | (0,00)               |
| 55.282.043 KZT     | 107.710 US\$        | 14.05.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | (5.954)                         | (0,00)               |
| 6.587.586 MXN      | 323.940 US\$        | 04.02.2025       | Citibank NA                 | 1         | (8.977)                         | (0,00)               |
| 220.500.000 MXN    | 10.977.468 US\$     | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (397.743)                       | (0,01)               |
| 6.814.600 MXN      | 331.626 US\$        | 04.02.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | (5.809)                         | (0,00)               |
| 796.423.244 MXN    | 39.916.753 US\$     | 16.01.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | (1.703.879)                     | (0,04)               |
| 176.321 PLN        | 41.223 €            | 17.01.2025       | Citibank NA                 | 1         | (44)                            | (0,00)               |
| 13.072.787 THB     | 407.925 US\$        | 02.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (24.503)                        | (0,00)               |
| 55.195 US\$        | 2.178.498 TRY       | 24.03.2025       | Barclays Bank Plc           | 1         | (1.837)                         | (0,00)               |
| 83.636 US\$        | 3.114.047 TRY       | 09.01.2025       | Citibank NA                 | 1         | (3.948)                         | (0,00)               |
| 418.515 US\$       | 1.865.688.664 COP   | 16.01.2025       | Citibank NA                 | 1         | (4.188)                         | (0,00)               |
| 636.579 US\$       | 21.709.508 THB      | 19.03.2025       | Citibank NA                 | 2         | (3.325)                         | (0,00)               |
| 953.965 US\$       | 34.168.002 TRY      | 09.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (7.025)                         | (0,00)               |
| 456.619 US\$       | 2.039.119.857 COP   | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (5.377)                         | (0,00)               |
| 6.510.000 US\$     | 5.199.485 £         | 05.02.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (0)                             | (0,00)               |
| 378.379 US\$       | 22.402.316 PHP      | 19.03.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (4.822)                         | (0,00)               |
| 99.209 US\$        | 624.406 BRL         | 05.03.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (717)                           | (0,00)               |
| 7.452.846 US\$     | 46.133.865 BRL      | 09.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (5.879)                         | (0,00)               |
| 20.910.000 US\$    | 3.278.604.150 ¥     | 05.02.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (35.243)                        | (0,00)               |
| 86.877 US\$        | 3.890.353 TRY       | 27.05.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | (9.133)                         | (0,00)               |
| 57.039 US\$        | 2.396.931 TRY       | 27.05.2025       | Morgan Stanley              | 1         | (2.115)                         | (0,00)               |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (1,68 %) (31. Dezember 2023: (0,27 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 72.721 US\$  | 3.097.561 TRY       | 24.03.2025       | Morgan Stanley              | 1         | (8.372)                         | (0,00)               |
| 4.376.642 ZAR  | 243.025 US\$        | 19.03.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (12.671)                        | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 2.648.921 AUD  | 1.689.606 US\$      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (49.496)                        | (0,00)               |
| 365.364.574 AUD  | 246.066.466 US\$    | 16.01.2025       | UBS AG                      | 2         | (19.846.718)                    | (0,43)               |
| 52.674.338 AUD   | 34.596.321 US\$     | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 80        | (1.982.390)                     | (0,04)               |
| <i>Abgesicherte Klassen CNY</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 698.765.849 CNY  | 99.759.562 US\$     | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (4.582.845)                     | (0,10)               |
| 248.076.656 CNY  | 35.086.223 US\$     | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 69        | (1.296.475)                     | (0,03)               |
| 695.093 CNY  | 95.297 US\$         | 02.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 2         | (618)                           | (0,00)               |
| 2.312.971 US\$   | 16.984.143 CNY      | 06.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | (322)                           | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 760.073 €  | 851.270 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (63.796)                        | (0,00)               |
| 408.826 €  | 436.766 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | (13.201)                        | (0,00)               |
| 79.450.851 €   | 87.420.936 US\$     | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 68        | (5.105.845)                     | (0,11)               |
| 244 US\$   | 235 €               | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | (0)                             | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 366.091 £  | 471.076 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (12.636)                        | (0,00)               |
| 60.469.088 £   | 79.221.822 US\$     | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | (3.498.972)                     | (0,08)               |
| 9.970.750 £  | 12.874.831 US\$     | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 60        | (388.888)                       | (0,01)               |
| 505.552 US\$   | 403.992 £           | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (350)                           | (0,00)               |
| 197 US\$   | 158 £               | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | (0)                             | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen HKD</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 2.596.331.564 HKD  | 334.501.219 US\$    | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | (238.193)                       | (0,00)               |
| 471.295.114 HKD  | 60.713.860 US\$     | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 32        | (37.276)                        | (0,00)               |
| 24.147.406 US\$  | 187.717.483 HKD     | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 38        | (20.157)                        | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen JPY</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 32.120.580.762 ¥   | 219.497.651 US\$    | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 2         | (14.794.260)                    | (0,32)               |
| 200.972.483 ¥  | 1.345.240 US\$      | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | (64.449)                        | (0,00)               |
| 5.162.650.949 ¥  | 34.772.060 US\$     | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 81        | (1.870.659)                     | (0,04)               |
| 2.032.372 US\$   | 319.392.930 ¥       | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | (3.109)                         | (0,00)               |
| 37.101 US\$  | 5.838.898 ¥         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | (110)                           | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 470.055.708 SGD  | 362.039.185 US\$    | 16.01.2025       | UBS AG                      | 2         | (17.279.745)                    | (0,37)               |
| 66.651.168 SGD   | 50.736.848 US\$     | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 92        | (1.851.964)                     | (0,04)               |
| <i>Abgesicherte Klassen ZAR</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 203.432.744 ZAR  | 11.497.286 US\$     | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 2         | (729.851)                       | (0,02)               |
| 185.180.245 ZAR  | 10.341.090 US\$     | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 66        | (539.734)                       | (0,01)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>(78.113.648)</b>             | <b>(1,68)</b>        |

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Futures-Kontrakte (0,10 %) (31. Dezember 2023: (0,92 %))

| Anzahl Kontrakte   | Beschreibung                                    | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---|---------------------------------|----------------------|
| 1.042  | 3 Month SOFR Future March 2028                  | (451.567)                       | (0,01)               |
| 11   | Euro-BTP Future March 2025                      | (29.957)                        | (0,00)               |
| 68   | Euro-Bund Future March 2025                     | (135.831)                       | (0,00)               |
| 2  | Euro-Buxl 30-Year Bond Future March 2025        | (18.059)                        | (0,00)               |
| 443  | Euro-Schatz Future March 2025                   | (215.611)                       | (0,01)               |
| 29   | United Kingdom Long Gilt Future March 2025      | (127.482)                       | (0,00)               |
| 1.267  | US Treasury 2-Year Note (CBT) Future March 2025 | (37.542)                        | (0,00)               |
| 2.804  | US Treasury 5-Year Note (CBT) Future March 2025 | (112.930)                       | (0,00)               |
| 1.443  | US Treasury Ultra 10-Year Future March 2025     | (3.448.053)                     | (0,08)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten *</b> |   | <b>(4.577.032)</b>              | <b>(0,10)</b>        |

### Inflation-Swap-Kontrakte (0,00 %) (31. Dezember 2023: (0,00 %))

| Nominalwert   | Fälligkeit | Gegenpartei                   | Erhalt/<br>(Zahlung)# | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|------------|-------------------------------|-----------------------|-----------------|--------------------|---------------------------------|----------------------|
| USD 9.215.000   | 02.12.2029 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup> | Erhalt                | 2,47 %          | CPURNSA            | (4.523)                         | (0,00)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Inflation-Swap-Kontrakten<sup>∞</sup></b> |            |                               |                       |                 |                    | <b>(4.523)</b>                  | <b>(0,00)</b>        |

#Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

### Zinsswap-Kontrakte (0,02 %) (31. Dezember 2023: (0,06 %))

| Nominalwert  | Fälligkeit | Gegenpartei                              | Erhalt/<br>(Zahlung)# | Fester Zinssatz | Variabler Zinssatz | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|------------|--|-----------------------|-----------------|--------------------|---------------------------------|----------------------|
| BRL 2.138.147  | 02.01.2031 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)             | 12,71 %         | 1D BROIS           | (48.173)                        | (0,00)               |
| BRL 2.262.674  | 02.01.2031 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)             | 11,24 %         | 1D BROIS           | (120.580)                       | (0,00)               |
| BRL 3.908.784  | 02.01.2031 | LCH Clearnet Ltd <sup>1</sup>            | (Zahlung)             | 11,31 %         | 1D BROIS           | (136.112)                       | (0,00)               |
| BRL 6.266.079  | 02.01.2025 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)             | 6,17 %          | 1D BROIS           | (209.244)                       | (0,01)               |
| BRL 3.860.376  | 04.01.2027 | Chicago Mercantile Exchange <sup>1</sup> | (Zahlung)             | 6,18 %          | 1D BROIS           | (249.967)                       | (0,01)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Zinsswapkontrakten<sup>∞</sup></b> |            |  |                       |                 |                    | <b>(764.076)</b>                | <b>(0,02)</b>        |

#Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

## Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

|   | Zeitwert<br>US\$     | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|---|----------------------|------------------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(83.459.279)</b>  | <b>(1,80)</b>                |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>4.566.359.912</b> | <b>98,48</b>                 |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>70.470.230</b>    | <b>1,52</b>                  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>4.636.830.142</b> | <b>100,00</b>                |

^ Schuldverschreibungen mit einem Zinssatz von 0,00 %, wurden zum 31. Dezember 2024 eventuell noch nicht abgerechnet und haben somit keinen gültigen Zinssatz. Die Zinssätze werden erst bei Abrechnung gültig.

| <b>Portfolioanalyse</b>  |   | US\$                 | % des<br>Gesamtver-<br>mögens |
|--------------------------|---|----------------------|-------------------------------|
| *                        | Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 722.692.291          | 14,28                         |
| **                       | Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden             | 3.456.202.586        | 68,28                         |
| †                        | Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente  | 363.905.103          | 7,19                          |
| μ                        | Investmentfonds   | 56.497.686           | 1,12                          |
| ±                        | Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden                          | 2.659.377            | 0,05                          |
| ∞                        | OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap                            | (35.597.131)         | (0,70)                        |
| <b>Anlagen insgesamt</b> |   | <b>4.566.359.912</b> | <b>90,22</b>                  |

## Sustainable Asia High Yield - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                              | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|--------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 79,64 % (31. Dezember 2023: 85,29 %)</b> |  |        |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |  |        |                       |                  |                              |
| 200.000  | Adani Ports & Special Economic Zone Ltd**          | 4,38 % | 03.07.2029            | 172.311          | 0,54                         |
| 400.000  | Axis Bank Ltd*                                     | 4,10 % | 31.12.2149            | 383.098          | 1,20                         |
| 400.000  | Bangkok Bank PCL**                                 | 3,73 % | 25.09.2034            | 362.832          | 1,14                         |
| 300.000  | Bangkok Bank PCL**                                 | 5,00 % | 31.12.2149            | 297.705          | 0,93                         |
| 400.000  | Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT**             | 3,75 % | 30.03.2026            | 390.682          | 1,23                         |
| 400.000  | Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT*              | 4,30 % | 31.12.2149            | 382.479          | 1,20                         |
| 500.000  | Bank of East Asia Ltd*                             | 5,83 % | 31.12.2149            | 495.353          | 1,56                         |
| 250.000  | Bank of East Asia Ltd**                            | 6,75 % | 27.06.2034            | 250.123          | 0,79                         |
| 375.000  | CA Magnum Holdings**                               | 5,38 % | 31.10.2026            | 366.324          | 1,15                         |
| 850.000  | CAS Capital No 1 Ltd*                              | 4,00 % | 31.12.2149            | 814.697          | 2,56                         |
| 200.000  | Central Plaza Development Ltd*                     | 3,85 % | 14.07.2025            | 196.966          | 0,62                         |
| 200.000  | Champion Path Holdings Ltd**                       | 4,85 % | 27.01.2028            | 189.602          | 0,60                         |
| 400.000  | China Overseas Grand Oceans Finance IV Cayman Ltd* | 2,45 % | 09.02.2026            | 382.383          | 1,20                         |
| 400.000  | Continuum Green Energy India Pvt/Co-Issuers**      | 7,50 % | 26.06.2033            | 413.653          | 1,30                         |
| 200.000  | Elect Global Investments Ltd*                      | 4,10 % | 31.12.2149            | 190.850          | 0,60                         |
| 600.000  | Fortune Star BVI Ltd**                             | 5,00 % | 18.05.2026            | 576.985          | 1,81                         |
| 200.000  | Fortune Star BVI Ltd**                             | 5,05 % | 27.01.2027            | 188.183          | 0,59                         |
| 500.000  | Franshion Brilliant Ltd*                           | 4,25 % | 23.07.2029            | 425.117          | 1,33                         |
| 400.000  | Fuqing Investment Management Ltd*                  | 3,25 % | 23.06.2025            | 388.001          | 1,22                         |
| 200.000  | FWD Group Holdings Ltd**                           | 7,64 % | 02.07.2031            | 213.582          | 0,67                         |
| 600.000  | FWD Group Holdings Ltd**                           | 8,05 % | 31.12.2149            | 598.875          | 1,88                         |
| 729.000  | Globe Telecom Inc*                                 | 4,20 % | 31.12.2149            | 712.254          | 2,24                         |
| 600.000  | GLP China Holdings Ltd*                            | 2,95 % | 29.03.2026            | 541.440          | 1,70                         |
| 600.000  | GLP Pte Ltd**                                      | 3,88 % | 04.06.2025            | 579.155          | 1,82                         |
| 500.000  | GLP Pte Ltd**                                      | 4,50 % | 31.12.2149            | 290.980          | 0,91                         |
| 358.000  | Greenko Dutch BV**                                 | 3,85 % | 29.03.2026            | 348.249          | 1,09                         |
| 1.169.000  | Greenko Power II Ltd*                              | 4,30 % | 13.12.2028            | 1.101.923        | 3,46                         |
| 500.000  | Greenko Solar Mauritius Ltd*                       | 5,95 % | 29.07.2026            | 506.884          | 1,59                         |
| 600.000  | HDFC Bank Ltd**                                    | 3,70 % | 31.12.2149            | 562.815          | 1,77                         |
| 281.000  | IRB Infrastructure Developers Ltd*                 | 7,11 % | 11.03.2032            | 284.488          | 0,89                         |
| 516.250  | JSW Hydro Energy Ltd*                              | 4,13 % | 18.05.2031            | 466.186          | 1,46                         |
| 200.000  | JSW Steel Ltd**                                    | 5,05 % | 05.04.2032            | 179.093          | 0,56                         |
| 600.000  | Kasikombank PCL*                                   | 3,34 % | 02.10.2031            | 574.586          | 1,80                         |
| 200.000  | Kasikombank PCL**                                  | 5,28 % | 31.12.2149            | 197.284          | 0,62                         |
| 200.000  | Lai Sun MTN Ltd**                                  | 5,00 % | 28.07.2026            | 133.285          | 0,42                         |
| 650.000  | Longfor Group Holdings Ltd**                       | 3,95 % | 16.09.2029            | 488.870          | 1,53                         |
| 300.000  | Melco Resorts Finance Ltd*                         | 5,25 % | 26.04.2026            | 295.829          | 0,93                         |
| 900.000  | Melco Resorts Finance Ltd*                         | 5,38 % | 04.12.2029            | 825.667          | 2,59                         |
| 700.000  | Melco Resorts Finance Ltd*                         | 5,75 % | 21.07.2028            | 669.397          | 2,10                         |

## Sustainable Asia High Yield - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung  | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|---------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 79,64 % (31. Dezember 2023: 85,29 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                   |                              |
| 200.000  | Melco Resorts Finance Ltd**                                      | 7,63 %  | 17.04.2032            | 201.016           | 0,63                         |
| 200.000  | MGM China Holdings Ltd**   | 4,75 %  | 01.02.2027            | 193.728           | 0,61                         |
| 360.000  | MGM China Holdings Ltd*  | 5,88 %  | 15.05.2026            | 359.332           | 1,13                         |
| 200.000  | MGM China Holdings Ltd**   | 7,13 %  | 26.06.2031            | 202.897           | 0,64                         |
| 400.000  | Network i2i Ltd*   | 5,65 %  | 31.12.2149            | 400.941           | 1,26                         |
| 200.000  | New Metro Global Ltd**   | 4,50 %  | 02.05.2026            | 165.057           | 0,52                         |
| 200.000  | NWD Finance BVI Ltd*   | 4,13 %  | 31.12.2149            | 69.915            | 0,22                         |
| 200.000  | NWD Finance BVI Ltd*   | 5,25 %  | 31.12.2149            | 88.223            | 0,28                         |
| 350.000  | PCPD Capital Ltd*  | 5,13 %  | 18.06.2026            | 304.194           | 0,95                         |
| 600.000  | Periana Holdings LLC**   | 5,95 %  | 19.04.2026            | 599.653           | 1,88                         |
| 95.000   | ReNew Pvt Ltd**  | 5,88 %  | 05.03.2027            | 93.151            | 0,29                         |
| 400.000  | ReNew Wind Energy AP2/ReNew Power Pvt Ltd other 9 Subsidiaries** | 4,50 %  | 14.07.2028            | 371.865           | 1,17                         |
| 365.478  | RKPF Overseas 2020 A Ltd**                                       | 5,20 %  | 12.07.2029            | 154.607           | 0,49                         |
| 500.000  | Shriram Finance Ltd**  | 6,63 %  | 22.04.2027            | 504.775           | 1,58                         |
| 400.000  | SMIC SG Holdings Pte Ltd*  | 5,38 %  | 24.07.2029            | 397.832           | 1,25                         |
| 1.150.000  | Standard Chartered Plc*  | 4,30 %  | 31.12.2149            | 1.030.688         | 3,24                         |
| 400.000  | Standard Chartered Plc**   | 4,75 %  | 31.12.2149            | 348.825           | 1,10                         |
| 200.000  | Standard Chartered Plc**   | 6,00 %  | 31.12.2149            | 200.381           | 0,63                         |
| 200.000  | Standard Chartered Plc*  | 7,75 %  | 31.12.2149            | 206.290           | 0,65                         |
| 223.500  | Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd**                        | 6,75 %  | 24.04.2033            | 226.243           | 0,71                         |
| 600.000  | Studio City Finance Ltd*   | 6,50 %  | 15.01.2028            | 585.552           | 1,84                         |
| 1.000.000  | Sunac China Holdings Ltd*  | 7,25 %  | 30.09.2030            | 115.070           | 0,36                         |
| 200.000  | UPL Corp Ltd**   | 4,63 %  | 16.06.2030            | 177.239           | 0,56                         |
| 200.000  | Vanke Real Estate Hong Kong Co Ltd*                              | 3,98 %  | 09.11.2027            | 100.765           | 0,32                         |
| 300.000  | VEON Holdings BV**   | 3,38 %  | 25.11.2027            | 265.241           | 0,83                         |
| 200.000  | Wynn Macau Ltd*  | 5,50 %  | 15.01.2026            | 198.197           | 0,62                         |
| 300.000  | Wynn Macau Ltd*  | 5,50 %  | 01.10.2027            | 292.196           | 0,92                         |
| 600.000  | Wynn Macau Ltd*  | 5,63 %  | 26.08.2028            | 578.400           | 1,82                         |
| 310.000  | Yanlord Land HK Co Ltd**   | 5,13 %  | 20.05.2026            | 293.748           | 0,92                         |
| 200.000  | Zhongsheng Group Holdings Ltd*                                   | 5,98 %  | 30.01.2028            | 198.296           | 0,62                         |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>  |  |         |                       | <b>25.362.503</b> | <b>79,64</b>                 |
| <b>Staatsanleihen 12,64 % (31. Dezember 2023: 8,77 %)</b>                      |  |         |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |  |         |                       |                   |                              |
| 500.000  | City of Ulaanbaatar Mongolia                                     | 7,75 %  | 21.08.2027            | 510.698           | 1,60                         |
| 700.000  | Development Bank of Mongolia LLC                                 | 11,00 % | 07.03.2026            | 728.875           | 2,29                         |
| 425.754  | Sri Lanka Government International Bond                          | 3,10 %  | 15.01.2030            | 353.376           | 1,11                         |
| 835.110  | Sri Lanka Government International Bond                          | 3,35 %  | 15.03.2033            | 635.769           | 2,00                         |
| 563.892  | Sri Lanka Government International Bond                          | 3,60 %  | 15.06.2035            | 408.822           | 1,28                         |

## Sustainable Asia High Yield - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|---|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 12,64 % (31. Dezember 2023: 8,77 %) (Fortsetzung)</b>                                |   |        |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |        |                       |                   |                              |
| 391.354  | Sri Lanka Government International Bond | 3,60 % | 15.05.2036            | 298.408           | 0,94                         |
| 783.037  | Sri Lanka Government International Bond | 3,60 % | 15.02.2038            | 600.041           | 1,88                         |
| 520.801  | Sri Lanka Government International Bond | 4,00 % | 15.04.2028            | 488.928           | 1,54                         |
| <b>Staatsanleihen insgesamt *</b>  |   |        |                       | <b>4.024.917</b>  | <b>12,64</b>                 |
| <b>Anlagen insgesamt</b>   |   |        |                       | <b>29.387.420</b> | <b>92,28</b>                 |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |   |        |                       | <b>29.387.420</b> | <b>92,28</b>                 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

**Futures-Kontrakte (0,04 %) (31. Dezember 2023: (0,21 %))**

| Anzahl<br>Kontrakte   | Beschreibung                                     | Nicht<br>realisierter<br>Verlust US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens          |
|---|--|---------------------------------------|---------------------------------------|
| (13)  | US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2025 | (3.656)                               | (0,01)                                |
| 1   | US Treasury 2-Year Note (CBT) Future March 2025  | (422)                                 | (0,00)                                |
| 11  | US Treasury 5-Year Note (CBT) Future March 2025  | (9.977)                               | (0,03)                                |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten *</b>  |  | <b>(14.055)</b>                       | <b>(0,04)</b>                         |
|   |  | <b>Zeitwert<br/>US\$</b>              | <b>% des<br/>Nettover-<br/>mögens</b> |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> |  | <b>(14.055)</b>                       | <b>(0,04)</b>                         |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              |  | <b>29.373.365</b>                     | <b>92,24</b>                          |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  |  | <b>2.471.036</b>                      | <b>7,76</b>                           |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   |  | <b>31.844.401</b>                     | <b>100,00</b>                         |

| Portfolioanalyse  | US\$              | % des<br>Gesamtver-<br>mögens |
|---|-------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 18.588.406        | 58,27                         |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden            | 10.799.014        | 33,86                         |
| ± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden                          | (14.055)          | (0,04)                        |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>29.373.365</b> | <b>92,09</b>                  |

## Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag  | Wertpapierbezeichnung   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|---|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 10,39 % (31. Dezember 2023: 6,31 %)</b> |   |        |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar</b>  |   |        |                       |                   |                              |
| 1.670.000   | Abu Dhabi Commercial Bank PJSC <sup>*</sup>                   | 4,50 % | 14.09.2027            | 1.652.582         | 0,28                         |
| 3.060.000   | AIA Group Ltd <sup>**</sup>                                   | 5,38 % | 05.04.2034            | 3.043.861         | 0,51                         |
| 2.827.000   | Akbank TAS <sup>**</sup>                                      | 7,50 % | 20.01.2030            | 2.862.868         | 0,48                         |
| 1.840.000   | Akbank TAS <sup>**</sup>                                      | 9,37 % | 31.12.2149            | 1.874.780         | 0,31                         |
| 2.159.000   | Antofagasta Plc <sup>*</sup>                                  | 6,25 % | 02.05.2034            | 2.193.638         | 0,37                         |
| 1.619.000   | Banco do Brasil SA <sup>**</sup>                              | 6,25 % | 18.04.2030            | 1.620.063         | 0,27                         |
| 4.133.000   | Bancolombia SA <sup>*</sup>                                   | 8,63 % | 24.12.2034            | 4.331.316         | 0,72                         |
| 4.270.000   | Banque Ouest Africaine de Developpement <sup>*</sup>          | 4,70 % | 22.10.2031            | 3.860.507         | 0,64                         |
| 1.151.200   | Brazil Minas SPE via State of Minas Gerais <sup>**</sup>      | 5,33 % | 15.02.2028            | 1.145.548         | 0,19                         |
| 1.680.000   | CAS Capital No 1 Ltd <sup>*</sup>                             | 4,00 % | 31.12.2149            | 1.610.225         | 0,27                         |
| 560.000   | Cemex SAB de CV <sup>**</sup>                                 | 5,13 % | 31.12.2149            | 548.998           | 0,09                         |
| 3.483.000   | Cemex SAB de CV <sup>**</sup>                                 | 9,13 % | 31.12.2149            | 3.595.770         | 0,60                         |
| 2.573.000   | EI Sukuk Co Ltd <sup>*</sup>                                  | 5,43 % | 28.05.2029            | 2.627.632         | 0,44                         |
| 1.004.000   | Emirates NBD Bank PJSC <sup>**</sup>                          | 5,14 % | 26.11.2029            | 1.014.733         | 0,17                         |
| 1.721.000   | Emirates NBD Bank PJSC <sup>*</sup>                           | 5,88 % | 11.10.2028            | 1.775.313         | 0,30                         |
| 490.000   | Empresa de los Ferrocarriles del Estado <sup>*</sup>          | 3,07 % | 18.08.2050            | 296.568           | 0,05                         |
| 5.240.000   | Empresa de los Ferrocarriles del Estado <sup>*</sup>          | 3,83 % | 14.09.2061            | 3.460.915         | 0,58                         |
| 4.909.800   | Greenko Power II Ltd <sup>*</sup>                             | 4,30 % | 13.12.2028            | 4.628.079         | 0,77                         |
| 4.450.000   | Inversiones CMPC SA <sup>**</sup>                             | 3,00 % | 06.04.2031            | 3.787.992         | 0,63                         |
| 4.040.000   | Prosus NV <sup>*</sup>  | 4,99 % | 19.01.2052            | 3.152.509         | 0,53                         |
| 1.160.000   | QNB Bank AS <sup>**</sup>                                     | 7,25 % | 21.05.2029            | 1.209.324         | 0,20                         |
| 930.000   | Suzano Austria GmbH <sup>*</sup>                              | 3,75 % | 15.01.2031            | 821.365           | 0,14                         |
| 2.140.000   | Suzano Austria GmbH <sup>*</sup>                              | 5,00 % | 15.01.2030            | 2.057.617         | 0,34                         |
| 1.820.000   | Suzano Austria GmbH <sup>**</sup>                             | 7,00 % | 16.03.2047            | 1.916.612         | 0,32                         |
| 4.640.000   | Telecomunicaciones Digitales SA <sup>**</sup>                 | 4,50 % | 30.01.2030            | 4.221.640         | 0,71                         |
| 1.254.000   | Turkiye Is Bankasi AS <sup>**</sup>                           | 7,75 % | 12.06.2029            | 1.294.009         | 0,22                         |
| 1.530.000   | Yapi ve Kredi Bankasi AS <sup>**</sup>                        | 9,74 % | 31.12.2149            | 1.579.074         | 0,26                         |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>                           |   |        |                       | <b>62.183.538</b> | <b>10,39</b>                 |
| <b>Staatsanleihen 84,69 % (31. Dezember 2023: 86,94 %)</b>      |   |        |                       |                   |                              |
| <b>Euro</b>   |   |        |                       |                   |                              |
| 1.229.985   | Argentine Republic Government International Bond <sup>*</sup> | 0,13 % | 09.07.2030            | 949.516           | 0,16                         |
| 1.140.000   | Bank Gospodarstwa Krajowego <sup>*</sup>                      | 0,50 % | 08.07.2031            | 990.826           | 0,17                         |
| 2.781.000   | Bank Gospodarstwa Krajowego <sup>*</sup>                      | 5,13 % | 22.02.2033            | 3.185.696         | 0,53                         |
| 7.455.000   | Benin Government International Bond <sup>*</sup>              | 4,95 % | 22.01.2035            | 6.557.102         | 1,10                         |
| 1.600.000   | Bulgaria Government International Bond <sup>*</sup>           | 4,13 % | 23.09.2029            | 1.744.679         | 0,29                         |
| 1.636.000   | Bulgaria Government International Bond <sup>*</sup>           | 4,38 % | 13.05.2031            | 1.816.435         | 0,30                         |
| 1.450.000   | Bulgaria Government International Bond <sup>*</sup>           | 4,50 % | 27.01.2033            | 1.633.053         | 0,27                         |
| 720.000   | Bulgaria Government International Bond <sup>*</sup>           | 4,88 % | 13.05.2036            | 820.301           | 0,14                         |

## Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                             | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|--------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 84,69 % (31. Dezember 2023: 86,94 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                    |                              |
| <b>Euro (Fortsetzung)</b>  |   |        |                       |                    |                              |
| 2.155.000  | Chile Government International Bond*              | 3,88 % | 09.07.2031            | 2.269.530          | 0,38                         |
| 14.730.022   | Chile Government International Bond*              | 4,13 % | 05.07.2034            | 15.786.790         | 2,64                         |
| 3.703.000  | Indonesia Government International Bond*          | 3,65 % | 10.09.2032            | 3.851.405          | 0,64                         |
| 1.640.000  | Ivory Coast Government International Bond*        | 4,88 % | 30.01.2032            | 1.501.885          | 0,25                         |
| 3.200.000  | Ivory Coast Government International Bond*        | 5,25 % | 22.03.2030            | 3.142.076          | 0,53                         |
| 5.960.000  | Ivory Coast Government International Bond*        | 5,88 % | 17.10.2031            | 5.803.500          | 0,97                         |
| 5.628.000  | Ivory Coast Government International Bond*        | 6,63 % | 22.03.2048            | 4.721.329          | 0,79                         |
| 13.935.000   | Ivory Coast Government International Bond*        | 6,88 % | 17.10.2040            | 12.538.553         | 2,09                         |
| 2.395.000  | Latvia Government International Bond*             | 0,25 % | 23.01.2030            | 2.175.448          | 0,36                         |
| 5.050.000  | Mexico Government International Bond*             | 2,25 % | 12.08.2036            | 4.105.028          | 0,69                         |
| 4.880.000  | Mexico Government International Bond*             | 3,38 % | 23.02.2031            | 4.910.466          | 0,82                         |
| 18.644.000   | Peruvian Government International Bond*           | 1,25 % | 11.03.2033            | 15.763.236         | 2,63                         |
| 8.477.000  | Peruvian Government International Bond*           | 1,95 % | 17.11.2036            | 7.021.908          | 1,17                         |
| 3.685.000  | Peruvian Government International Bond*           | 3,75 % | 01.03.2030            | 3.854.182          | 0,64                         |
| 1.480.000  | Philippine Government International Bond*         | 0,70 % | 03.02.2029            | 1.384.164          | 0,23                         |
| 3.710.000  | Philippine Government International Bond*         | 1,20 % | 28.04.2033            | 3.207.824          | 0,54                         |
| 4.978.000  | Philippine Government International Bond*         | 1,75 % | 28.04.2041            | 3.731.114          | 0,62                         |
| 1.606.000  | Republic of Poland Government International Bond* | 3,13 % | 22.10.2031            | 1.677.784          | 0,28                         |
| 5.686.000  | Romanian Government International Bond*           | 2,00 % | 28.01.2032            | 4.701.499          | 0,79                         |
| 5.340.000  | Romanian Government International Bond*           | 2,00 % | 14.04.2033            | 4.215.889          | 0,70                         |
| 3.202.000  | Romanian Government International Bond*           | 2,12 % | 16.07.2031            | 2.757.269          | 0,46                         |
| 11.345.000   | Romanian Government International Bond*           | 3,62 % | 26.05.2030            | 11.065.297         | 1,85                         |
| 4.738.000  | Romanian Government International Bond*           | 3,75 % | 07.02.2034            | 4.224.001          | 0,71                         |
| 2.360.000  | Romanian Government International Bond*           | 3,88 % | 29.10.2035            | 2.030.211          | 0,34                         |
| 4.022.000  | Romanian Government International Bond*           | 5,63 % | 22.02.2036            | 4.010.843          | 0,67                         |
| 1.595.000  | Romanian Government International Bond*           | 6,38 % | 18.09.2033            | 1.724.192          | 0,29                         |
| 20.342.000   | Serbia International Bond*                        | 1,65 % | 03.03.2033            | 16.953.337         | 2,83                         |
| 3.972.000  | Serbia International Bond*                        | 2,05 % | 23.09.2036            | 3.137.812          | 0,52                         |
| <b>Euro insgesamt</b>  |   |        |                       | <b>169.964.180</b> | <b>28,39</b>                 |
| <b>US-Dollar</b>   |   |        |                       |                    |                              |
| 2.084.000  | Amazon Conservation DAC**                         | 6,03 % | 16.01.2042            | 2.079.311          | 0,35                         |
| 12.822.514   | Argentine Republic Government International Bond* | 0,75 % | 09.07.2030            | 9.914.368          | 1,66                         |
| 756.342  | Argentine Republic Government International Bond* | 1,00 % | 09.07.2029            | 616.041            | 0,10                         |
| 6.729.000  | Argentine Republic Government International Bond* | 3,50 % | 09.07.2041            | 4.216.851          | 0,70                         |
| 14.929.307   | Argentine Republic Government International Bond* | 4,13 % | 09.07.2035            | 9.937.778          | 1,66                         |
| 13.570.000   | Argentine Republic Government International Bond* | 4,13 % | 09.07.2046            | 9.037.254          | 1,51                         |

## Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                      | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 84,69 % (31. Dezember 2023: 86,94 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                  |                              |
| 6.766.000  | Bank Gospodarstwa Krajowego*               | 5,38 %  | 22.05.2033            | 6.612.395        | 1,11                         |
| 883.000  | Bank Gospodarstwa Krajowego**              | 5,75 %  | 09.07.2034            | 878.532          | 0,15                         |
| 1.940.000  | Bank Gospodarstwa Krajowego*               | 6,25 %  | 31.10.2028            | 2.018.871        | 0,34                         |
| 1.087.000  | Bank Gospodarstwa Krajowego**              | 6,25 %  | 09.07.2054            | 1.067.373        | 0,18                         |
| 3.685.000  | Brazilian Government International Bond*   | 5,63 %  | 07.01.2041            | 3.103.646        | 0,52                         |
| 6.475.000  | Brazilian Government International Bond*   | 5,63 %  | 21.02.2047            | 5.099.927        | 0,85                         |
| 16.026.000   | Brazilian Government International Bond*   | 6,00 %  | 20.10.2033            | 14.989.529       | 2,50                         |
| 3.250.000  | Brazilian Government International Bond*   | 6,25 %  | 18.03.2031            | 3.174.016        | 0,53                         |
| 800.000  | Brazilian Government International Bond*   | 8,25 %  | 20.01.2034            | 874.389          | 0,15                         |
| 4.368.000  | Bulgaria Government International Bond*    | 5,00 %  | 05.03.2037            | 4.114.307        | 0,69                         |
| 3.750.000  | Chile Government International Bond*       | 3,50 %  | 31.01.2034            | 3.236.926        | 0,54                         |
| 3.434.000  | Chile Government International Bond*       | 4,95 %  | 05.01.2036            | 3.257.332        | 0,54                         |
| 7.103.000  | Colombia Government International Bond*    | 3,00 %  | 30.01.2030            | 5.900.817        | 0,99                         |
| 282.000  | Colombia Government International Bond*    | 5,00 %  | 15.06.2045            | 190.914          | 0,03                         |
| 426.000  | Colombia Government International Bond*    | 5,20 %  | 15.05.2049            | 287.230          | 0,05                         |
| 4.165.000  | Colombia Government International Bond*    | 6,13 %  | 18.01.2041            | 3.412.509        | 0,57                         |
| 2.010.000  | Colombia Government International Bond*    | 7,38 %  | 18.09.2037            | 1.920.575        | 0,32                         |
| 14.534.000   | Colombia Government International Bond*    | 7,50 %  | 02.02.2034            | 14.337.791       | 2,40                         |
| 2.083.000  | Colombia Government International Bond*    | 7,75 %  | 07.11.2036            | 2.040.090        | 0,34                         |
| 7.558.000  | Colombia Government International Bond*    | 8,00 %  | 20.04.2033            | 7.741.281        | 1,29                         |
| 1.740.000  | Colombia Government International Bond**   | 8,00 %  | 14.11.2035            | 1.753.920        | 0,29                         |
| 1.763.000  | Colombia Government International Bond*    | 8,38 %  | 07.11.2054            | 1.713.460        | 0,29                         |
| 660.000  | Colombia Government International Bond*    | 8,75 %  | 14.11.2053            | 669.002          | 0,11                         |
| 1.290.000  | Colombia Government International Bond*    | 10,38 % | 28.01.2033            | 1.545.949        | 0,26                         |
| 1.210.000  | Costa Rica Government International Bond*  | 6,13 %  | 19.02.2031            | 1.220.587        | 0,21                         |
| 8.636.000  | Costa Rica Government International Bond*  | 6,55 %  | 03.04.2034            | 8.796.846        | 1,48                         |
| 5.993.000  | Costa Rica Government International Bond*  | 7,16 %  | 12.03.2045            | 6.184.776        | 1,03                         |
| 3.184.000  | Costa Rica Government International Bond*  | 7,30 %  | 13.11.2054            | 3.305.788        | 0,55                         |
| 7.740.000  | Dominican Republic International Bond*     | 4,50 %  | 30.01.2030            | 7.107.254        | 1,19                         |
| 9.600.000  | Dominican Republic International Bond*     | 4,88 %  | 23.09.2032            | 8.592.000        | 1,44                         |
| 3.381.000  | Dominican Republic International Bond*     | 5,88 %  | 30.01.2060            | 2.867.933        | 0,48                         |
| 2.210.000  | Dominican Republic International Bond*     | 5,95 %  | 25.01.2027            | 2.201.160        | 0,37                         |
| 10.271.000   | Dominican Republic International Bond*     | 6,00 %  | 22.02.2033            | 9.890.973        | 1,65                         |
| 4.652.000  | Dominican Republic International Bond*     | 6,40 %  | 05.06.2049            | 4.385.673        | 0,73                         |
| 672.000  | Dominican Republic International Bond*     | 6,60 %  | 01.06.2036            | 668.304          | 0,11                         |
| 2.485.000  | Dominican Republic International Bond*     | 7,05 %  | 03.02.2031            | 2.550.852        | 0,42                         |
| 150.000  | El Salvador Government International Bond* | 7,12 %  | 20.01.2050            | 126.937          | 0,02                         |
| 150.000  | El Salvador Government International Bond* | 7,63 %  | 01.02.2041            | 139.781          | 0,02                         |

## Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|---|---------|-----------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 84,69 % (31. Dezember 2023: 86,94 %) (Fortsetzung)</b> |   |         |                       |                  |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |         |                       |                  |                              |
| 8.038.000  | El Salvador Government International Bond <sup>†</sup>        | 7,65 %  | 15.06.2035            | 7.790.831        | 1,30                         |
| 2.643.000  | El Salvador Government International Bond <sup>**</sup>       | 9,25 %  | 17.04.2030            | 2.804.884        | 0,47                         |
| 11.338.000   | El Salvador Government International Bond <sup>†</sup>        | 9,50 %  | 15.07.2052            | 11.857.847       | 1,98                         |
| 244.000  | El Salvador Government International Bond <sup>†</sup>        | 9,65 %  | 21.11.2054            | 257.664          | 0,04                         |
| 858.000  | Fondo MIVIVIENDA SA <sup>*</sup>                              | 4,63 %  | 12.04.2027            | 845.238          | 0,14                         |
| 927.136  | Ghana Government International Bond <sup>†</sup>              | 0,00 %  | 03.07.2026            | 863.881          | 0,14                         |
| 783.183  | Ghana Government International Bond <sup>†</sup>              | 0,00 %  | 03.01.2030            | 608.639          | 0,10                         |
| 6.411.466  | Ghana Government International Bond <sup>†</sup>              | 5,00 %  | 03.07.2029            | 5.553.155        | 0,93                         |
| 10.082.604   | Ghana Government International Bond <sup>†</sup>              | 5,00 %  | 03.07.2035            | 7.114.714        | 1,19                         |
| 5.580.000  | Istanbul Metropolitan Municipality <sup>*</sup>               | 10,50 % | 06.12.2028            | 6.057.553        | 1,01                         |
| 418.281  | Ivory Coast Government International Bond <sup>†</sup>        | 5,75 %  | 31.12.2032            | 397.161          | 0,07                         |
| 500.000  | Ivory Coast Government International Bond <sup>†</sup>        | 6,38 %  | 03.03.2028            | 497.410          | 0,08                         |
| 3.950.000  | Latvia Government International Bond <sup>†</sup>             | 5,13 %  | 30.07.2034            | 3.851.643        | 0,64                         |
| 2.860.000  | Mexico Government International Bond <sup>†</sup>             | 4,75 %  | 27.04.2032            | 2.598.300        | 0,43                         |
| 10.506.000   | Mexico Government International Bond <sup>†</sup>             | 5,75 %  | 12.10.2110            | 8.080.169        | 1,35                         |
| 1.865.000  | Mexico Government International Bond <sup>**</sup>            | 6,00 %  | 07.05.2036            | 1.759.688        | 0,29                         |
| 2.630.000  | Mongolia Government International Bond <sup>†</sup>           | 4,45 %  | 07.07.2031            | 2.286.318        | 0,38                         |
| 1.310.000  | Mongolia Government International Bond <sup>†</sup>           | 7,88 %  | 05.06.2029            | 1.369.933        | 0,23                         |
| 10.171.000   | Morocco Government International Bond <sup>†</sup>            | 3,00 %  | 15.12.2032            | 8.316.837        | 1,39                         |
| 750.000  | Morocco Government International Bond <sup>†</sup>            | 5,50 %  | 11.12.2042            | 667.201          | 0,11                         |
| 13.066.000   | Morocco Government International Bond <sup>†</sup>            | 6,50 %  | 08.09.2033            | 13.494.271       | 2,25                         |
| 1.073.000  | Peruvian Government International Bond <sup>†</sup>           | 3,00 %  | 15.01.2034            | 864.570          | 0,14                         |
| 970.000  | Peruvian Government International Bond <sup>†</sup>           | 6,55 %  | 14.03.2037            | 1.014.014        | 0,17                         |
| 5.816.000  | Republic of Armenia International Bond <sup>†</sup>           | 3,60 %  | 02.02.2031            | 4.805.945        | 0,80                         |
| 11.600.000   | Republic of Armenia International Bond <sup>†</sup>           | 3,95 %  | 26.09.2029            | 10.183.408       | 1,70                         |
| 5.534.000  | Republic of Poland Government International Bond <sup>†</sup> | 5,13 %  | 18.09.2034            | 5.367.233        | 0,90                         |
| 1.478.000  | Republic of Poland Government International Bond <sup>†</sup> | 5,50 %  | 18.03.2054            | 1.362.528        | 0,23                         |
| 848.000  | Republic of Poland Government International Bond <sup>†</sup> | 5,75 %  | 16.11.2032            | 866.274          | 0,15                         |
| 4.820.000  | Serbia International Bond <sup>†</sup>                        | 2,13 %  | 01.12.2030            | 3.922.840        | 0,66                         |
| 3.347.508  | Sri Lanka Government International Bond <sup>†</sup>          | 3,10 %  | 15.01.2030            | 2.778.432        | 0,46                         |
| 6.566.080  | Sri Lanka Government International Bond <sup>†</sup>          | 3,35 %  | 15.03.2033            | 4.998.757        | 0,84                         |
| 4.433.616  | Sri Lanka Government International Bond <sup>†</sup>          | 3,60 %  | 15.06.2035            | 3.214.372        | 0,54                         |
| 3.077.030  | Sri Lanka Government International Bond <sup>†</sup>          | 3,60 %  | 15.05.2036            | 2.346.235        | 0,39                         |
| 6.156.650  | Sri Lanka Government International Bond <sup>†</sup>          | 3,60 %  | 15.02.2038            | 4.717.841        | 0,79                         |
| 4.142.019  | Sri Lanka Government International Bond <sup>†</sup>          | 4,00 %  | 15.04.2028            | 3.888.528        | 0,65                         |
| 674.061  | Ukraine Government International Bond <sup>†</sup>            | 0,00 %  | 01.02.2030            | 370.059          | 0,06                         |
| 2.518.871  | Ukraine Government International Bond <sup>†</sup>            | 0,00 %  | 01.02.2034            | 1.048.527        | 0,18                         |
| 1.378.622  | Ukraine Government International Bond <sup>†</sup>            | 0,00 %  | 01.02.2035            | 817.497          | 0,14                         |

## Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung   | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|---|--------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 84,69 % (31. Dezember 2023: 86,94 %) (Fortsetzung)</b> |   |        |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |        |                       |                    |                              |
| 2.953.853  | Ukraine Government International Bond*                            | 0,00 % | 01.02.2036            | 1.742.530          | 0,29                         |
| 6.269.000  | Ukraine Government International Bond*                            | 0,00 % | 01.08.2041            | 4.854.510          | 0,81                         |
| 751.389  | Ukraine Government International Bond*                            | 1,75 % | 01.02.2029            | 524.219            | 0,09                         |
| 5.004.203  | Ukraine Government International Bond*                            | 1,75 % | 01.02.2034            | 2.833.630          | 0,47                         |
| 3.828.287  | Ukraine Government International Bond*                            | 1,75 % | 01.02.2035            | 2.114.099          | 0,35                         |
| 2.755.973  | Ukraine Government International Bond*                            | 1,75 % | 01.02.2036            | 1.500.379          | 0,25                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |   |        |                       | <b>336.991.012</b> | <b>56,30</b>                 |
| <b>Staatsanleihen insgesamt</b>  |   |        |                       | <b>506.955.192</b> | <b>84,69</b>                 |
| <b>Pensionsgeschäfte 2,17 % (31. Dezember 2023: 0,00 %)</b>              |   |        |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |   |        |                       |                    |                              |
| 13.000.000   | State Street Bank and Trust Co, repurchase value US\$ 13,003,199^ | 4,43 % | 02.01.2025            | 13.000.000         | 2,17                         |
| <b>Pensionsgeschäfte insgesamt †</b>                                     |   |        |                       | <b>13.000.000</b>  | <b>2,17</b>                  |
| <b>Anlagen insgesamt</b>   |   |        |                       | <b>582.138.730</b> | <b>97,25</b>                 |

^ Besichert über US-Schatz-/Staatsanleihen mit einem Wert von insgesamt USD 13.260.127.

### Devisenterminkontrakte 0,59 % (31. Dezember 2023: 1,97 %)

| Geforderter<br>Betrag  | Zu zahlender<br>Betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|------------------------|-----------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------------|------------------------------|
| 195.509.718 US\$   | 185.513.966 €          | 04.02.2025            | Standard Chartered Bank        | 1         | 3.157.635                            | 0,53                         |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>                                      |                        |                       |                                |           |                                      |                              |
| 4.493.835 US\$   | 4.286.698 €            | 13.03.2025            | State Street Bank and Trust Co | 1         | 41.649                               | 0,01                         |
| 24.950.448 US\$  | 23.711.998 €           | 13.03.2025            | Westpac Banking Corp           | 11        | 323.049                              | 0,05                         |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ~</b> |                        |                       |                                |           | <b>3.522.333</b>                     | <b>0,59</b>                  |

### Futures-Kontrakte 0,65 % (31. Dezember 2023: 1,70 %)

| Anzahl<br>Kontrakte   | Beschreibung                                     | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--|--------------------------------------|------------------------------|
| (93)  | Euro-BOBL Future March 2025                      | 108.044                              | 0,02                         |
| (771)   | Euro-Bund Future March 2025                      | 2.874.134                            | 0,48                         |
| (86)  | Euro-Buxl 30-Year Bond Future March 2025         | 763.969                              | 0,13                         |
| (78)  | US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2025 | 103.593                              | 0,02                         |
| 158   | US Treasury 2-Year Note (CBT) Future March 2025  | 18.516                               | 0,00                         |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten *</b> |  | <b>3.868.256</b>                     | <b>0,65</b>                  |

## Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Credit-Default-Swap-Kontrakten 0,14 % (31. Dezember 2023: 0,00 %)

| Nominalwert  | Fälligkeit | Gegenpartei                 | Referenzverbindlichkeit                | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|------------|-----------------------------|--|------------------|------------------------------|
| USD 26.697.000   | 20.12.2029 | ICE Clear U.S. <sup>1</sup> | Buying default protection on CDX.EM.42 | 836.491          | 0,14                         |
| <b>Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt *</b> |            |                             |  | <b>836.491</b>   | <b>0,14</b>                  |

<sup>1</sup>Zentral abgewickelter Swap.

|  | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|--------------------|------------------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> | <b>590.365.810</b> | <b>98,63</b>                 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (2,05 %) (31. Dezember 2023: (0,46 %))

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei             | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 14.178.830 €   | 14.904.330 US\$     | 04.02.2025       | Standard Chartered Bank | 1         | (202.862)                       | (0,03)               |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                     |                  |                         |           |                                 |                      |
| 4.931.561 €  | 5.234.087 US\$      | 13.03.2025       | Citibank NA             | 1         | (112.143)                       | (0,02)               |
| 508.920.579 €  | 540.520.120 US\$    | 13.03.2025       | Standard Chartered Bank | 2         | (11.952.689)                    | (2,00)               |
| 3.424.786 €  | 3.573.784 US\$      | 13.03.2025       | Westpac Banking Corp    | 6         | (16.784)                        | (0,00)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten **</b> |                     |                  |                         |           | <b>(12.284.478)</b>             | <b>(2,05)</b>        |

### Futures- Kontrakte (0,48 %) (31. Dezember 2023: (0,82 %))

| Anzahl Kontrakte   | Beschreibung                                    | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---|---------------------------------|----------------------|
| 20   | Euro-Schatz Future March 2025                   | (7.663)                         | (0,00)               |
| 476  | US Treasury 5-Year Note (CBT) Future March 2025 | (215.687)                       | (0,03)               |
| 404  | US Treasury Long Bond (CBT) Future March 2025   | (1.066.813)                     | (0,18)               |
| 399  | US Treasury Ultra Bond (CBT) Future March 2025  | (1.537.457)                     | (0,27)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten *</b> |   | <b>(2.827.620)</b>              | <b>(0,48)</b>        |

|   | Zeitwert<br>US\$    | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|---|---------------------|------------------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(15.112.098)</b> | <b>(2,53)</b>                |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>575.253.712</b>  | <b>96,10</b>                 |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>23.337.270</b>   | <b>3,90</b>                  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>598.590.982</b>  | <b>100,00</b>                |

## Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

| Portfolioanalyse  | US\$               | % des<br>Gesamtver-<br>mögens |
|---|--------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 529.079.750        | 86,17                         |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden            | 40.058.980         | 6,52                          |
| † Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente  | 13.000.000         | 2,12                          |
| ± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden                          | 1.040.636          | 0,17                          |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente   | (7.925.654)        | (1,29)                        |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>575.253.712</b> | <b>93,69</b>                  |

## Tactical Macro – Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag  | Wertpapierbezeichnung       | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|-----------------------------|--------|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Schatzwechsel 92,55 % (31. Dezember 2023: 84,66 %)</b> |                             |        |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar</b>  |                             |        |                       |                   |                              |
| 5.500.000   | United States Treasury Bill | 0,00 % | 09.01.2025            | 5.495.504         | 15,26                        |
| 5.500.000   | United States Treasury Bill | 0,00 % | 14.01.2025            | 5.492.320         | 15,26                        |
| 5.060.000   | United States Treasury Bill | 0,00 % | 21.01.2025            | 5.048.675         | 14,02                        |
| 3.500.000   | United States Treasury Bill | 0,00 % | 13.02.2025            | 3.482.721         | 9,67                         |
| 6.000.000   | United States Treasury Bill | 0,00 % | 25.02.2025            | 5.962.283         | 16,56                        |
| 2.100.000   | United States Treasury Bill | 0,00 % | 13.03.2025            | 2.082.955         | 5,79                         |
| 5.825.000   | United States Treasury Bill | 0,00 % | 15.04.2025            | 5.755.456         | 15,99                        |
| <b>Schatzwechsel insgesamt **</b>                         |                             |        |                       | <b>33.319.914</b> | <b>92,55</b>                 |
| <b>Anlagen insgesamt</b>                                  |                             |        |                       | <b>33.319.914</b> | <b>92,55</b>                 |

### Devisenterminkontrakte 0,18 % (31. Dezember 2023: 0,25 %)

| Geforderter<br>Betrag   | Zu zahlender<br>Betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|---|------------------------|-----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------------|------------------------------|
| 6.734.200 CNY   | 143.007.471 ¥          | 19.03.2025            | Goldman Sachs International | 1         | 927                                  | 0,00                         |
| 218.995 £   | 273.376 US\$           | 19.03.2025            | Goldman Sachs International | 1         | 738                                  | 0,00                         |
| 333.714 US\$  | 305.440 €              | 19.03.2025            | Goldman Sachs International | 1         | 16.383                               | 0,05                         |
| 275.286 US\$  | 218.995 £              | 19.03.2025            | Goldman Sachs International | 1         | 1.172                                | 0,00                         |
| 316.966 US\$  | 46.320.650 ¥           | 19.03.2025            | Goldman Sachs International | 1         | 19.641                               | 0,05                         |
| 1.408.200 US\$  | 215.331.594 ¥          | 21.03.2025            | Goldman Sachs International | 2         | 25.689                               | 0,07                         |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>   |                        |                       |                             |           |                                      |                              |
| 114.875 US\$  | 108.336 €              | 16.01.2025            | Westpac Banking Corp        | 1         | 2.633                                | 0,01                         |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                        |                       |                             |           | <b>67.183</b>                        | <b>0,18</b>                  |

### Verkaufte Optionskontrakte 0,82 % (31. Dezember 2023: 1,32 %)

| Nominalwert  | Fälligkeit | Art  | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|------------|--|------------------|------------------------------|
| <b>Kaufoptionen</b>  |            |  |                  |                              |
| 16.315.100 USD   | 20.03.2025 | United States Dollar/Chinese Yuan Renminbi Currency Option, Strike Price CNH7.25 | 294.752          | 0,82                         |
| <b>Beizulegender Zeitwert aus gekauften Optionskontrakten insgesamt <sup>∞</sup> (Kosten: (91.691) US\$)</b> |            |  | <b>294.752</b>   | <b>0,82</b>                  |

Die Gegenpartei für alle OTC-Optionskontrakte ist Goldman Sachs International.

### Total Return Swap-Kontrakte 0,06 % (31. Dezember 2023: 0,00 %)

| Nominalwert  | Datum der<br>Schließung | Variabler Zinssatz | Referenzunternehmen | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn US\$      | % des<br>Nettover-<br>mögens |      |
|--|-------------------------|--------------------|---------------------|---|------------------------------|------|
| USD  | 3.255.170               | 27.05.2025         | 0,01 <sup>1</sup>   | Goldman Sachs GSOWEW00 Index <sup>2</sup> | 21.388                       | 0,06 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Total Return Swap-Kontrakten <sup>∞</sup></b> |                         |                    |                     | <b>21.388</b>                             | <b>0,06</b>                  |      |

<sup>1</sup> Feste Finanzierungskosten.

<sup>2</sup> Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist Goldman Sachs International.

## Tactical Macro – Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

|  | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|-------------------|------------------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> | <b>33.703.237</b> | <b>93,61</b>                 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

**Devisenterminkontrakte (0,83 %) (31. Dezember 2023: (0,14 %))**

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 305.440 €  | 330.077 US\$        | 19.03.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (12.747)                        | (0,04)               |
| 108.102.015 ¥  | 1.017.000 CAD       | 21.03.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (15.101)                        | (0,04)               |
| 46.529.816 ¥   | 316.966 US\$        | 19.03.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (18.298)                        | (0,05)               |
| 213.451.294 ¥  | 1.408.200 US\$      | 21.03.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (37.761)                        | (0,11)               |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 25.699 €   | 28.782 US\$         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (2.157)                         | (0,01)               |
| 22.823 €   | 25.179 US\$         | 16.01.2025       | Standard Chartered Bank     | 1         | (1.534)                         | (0,00)               |
| 3.143.920 €  | 3.466.296 US\$      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 2         | (209.036)                       | (0,58)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>(296.634)</b>                | <b>(0,83)</b>        |

**Verkaufte Optionskontrakte (0,81 %) (31. Dezember 2023: (0,73 %))**

| Nominalwert  | Fälligkeit | Art  | Zeitwert US\$    | % des Nettovermögens |
|--|------------|--|------------------|----------------------|
| <b>Kaufoptionen</b>  |            |  |                  |                      |
| (5.441.800) USD  | 20.03.2025 | United States Dollar/Chinese Yuan Renminbi Currency Option, Strike Price CNH7.25 | (98.313)         | (0,27)               |
| (5.432.860) USD  | 20.03.2025 | United States Dollar/Chinese Yuan Renminbi Currency Option, Strike Price CNH7.25 | (98.151)         | (0,27)               |
| (5.440.440) USD  | 20.03.2025 | United States Dollar/Chinese Yuan Renminbi Currency Option, Strike Price CNH7.25 | (98.288)         | (0,27)               |
| <b>Beizulegender Zeitwert aus verkauften Optionskontrakten insgesamt <sup>∞</sup> (Prämie: 112.778 US\$)</b> |            |  | <b>(294.752)</b> | <b>(0,81)</b>        |

Die Gegenpartei für alle OTC-Optionskontrakte ist Goldman Sachs International.

**Total Return Swap-Kontrakte (0,11 %) (31. Dezember 2023: (0,00 %))**

| Nominalwert   | Datum der Schließung | Variabler Zinssatz | Referenzunternehmen                       | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|----------------------|--------------------|---|---------------------------------|----------------------|
| USD (3.663.280)   | 27.05.2025           | 0,00 <sup>1</sup>  | Goldman Sachs GSOWCLO0 Index <sup>2</sup> | (39.190)                        | (0,11)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Total Return Swap-Kontrakten <sup>∞</sup></b> |                      |                    |   | <b>(39.190)</b>                 | <b>(0,11)</b>        |

<sup>1</sup> Feste Finanzierungskosten.

<sup>2</sup> Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist Goldman Sachs International.

## Tactical Macro – Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

|   | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Nettover-<br>mögens           |
|---|-------------------|--|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(630.576)</b>  | <b>(1,75)</b>                          |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>33.072.661</b> | <b>91,86</b>                           |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>2.930.105</b>  | <b>8,14</b>                            |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>36.002.766</b> | <b>100,00</b>                          |
| <br>  |                   |  |
| <b>Portfolioanalyse</b>   | <b>US\$</b>       | <b>% des<br/>Gesamtver-<br/>mögens</b> |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden              | 33.319.914        | 90,77                                  |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente   | (247.253)         | (0,67)                                 |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>33.072.661</b> | <b>90,10</b>                           |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der Anteile                               | Wertpapierbezeichnung              | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|------------------------------------|---------------|----------------------|
| <b>Aktien 2,05 % (31. Dezember 2023: 4,75 %)</b> |                                    |               |                      |
| <b>US-Dollar</b>                                 |                                    |               |                      |
| 684  | AbbVie Inc                         | 121.547       | 0,01                 |
| 3.010  | Akamai Technologies Inc            | 287.906       | 0,04                 |
| 3.041  | Alibaba Group Holding Ltd ADR      | 257.846       | 0,03                 |
| 3.367  | APA Corp                           | 77.744        | 0,01                 |
| 786  | Apple Inc                          | 196.830       | 0,02                 |
| 798  | ArcBest Corp                       | 74.469        | 0,01                 |
| 280  | Autodesk Inc                       | 82.760        | 0,01                 |
| 191  | Axon Enterprise Inc                | 113.515       | 0,01                 |
| 2.684  | Best Buy Co Inc                    | 230.287       | 0,03                 |
| 1.941  | Boston Scientific Corp             | 173.370       | 0,02                 |
| 13.930   | Boyd Gaming Corp                   | 1.010.482     | 0,13                 |
| 520  | Bunge Global SA                    | 40.435        | 0,00                 |
| 2.367  | Cardinal Health Inc                | 279.945       | 0,03                 |
| 1.100  | CarMax Inc                         | 89.936        | 0,01                 |
| 1.951  | Charles Schwab Corp                | 144.394       | 0,02                 |
| 9.280  | Chemours Co                        | 156.832       | 0,02                 |
| 1.900  | Chipotle Mexican Grill Inc Class A | 114.570       | 0,01                 |
| 30.327   | Cleveland-Cliffs Inc               | 285.074       | 0,04                 |
| 17.740   | CONMED Corp                        | 1.214.126     | 0,15                 |
| 180  | ConocoPhillips                     | 17.851        | 0,00                 |
| 770  | Constellation Brands Inc Class A   | 170.170       | 0,02                 |
| 11.000   | Coming Inc                         | 522.720       | 0,06                 |
| 3.441  | Coterra Energy Inc                 | 87.883        | 0,01                 |
| 15.254   | CSX Corp                           | 492.247       | 0,06                 |
| 1.650  | Darden Restaurants Inc             | 308.039       | 0,04                 |
| 8.257  | Devon Energy Corp                  | 270.252       | 0,03                 |
| 924  | Diamondback Energy Inc             | 151.379       | 0,02                 |
| 4.815  | EQT Corp                           | 222.020       | 0,03                 |
| 895  | FedEx Corp                         | 251.790       | 0,03                 |
| 1.540  | Fiserv Inc                         | 316.347       | 0,04                 |
| 3.983  | Freeport-McMoRan Inc               | 151.673       | 0,02                 |
| 2.817  | Halliburton Co                     | 76.594        | 0,01                 |
| 3.489  | HF Sinclair Corp                   | 122.289       | 0,02                 |
| 677  | Hilton Worldwide Holdings Inc      | 167.327       | 0,02                 |
| 2.565  | HP Inc                             | 83.696        | 0,01                 |
| 1.171  | Insulet Corp                       | 305.713       | 0,04                 |
| 7.260  | Kraft Heinz Co                     | 222.955       | 0,03                 |
| 2.808  | Live Nation Entertainment Inc      | 363.636       | 0,05                 |
| 880  | Lowe's Cos Inc                     | 217.184       | 0,03                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile   | Wertpapierbezeichnung                             |                       | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|---|-----------------------|-------------------|------------------------------|
| <b>Aktien 2,05 % (31. Dezember 2023: 4,75 %) (Fortsetzung)</b>           |   |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |   |                       |                   |                              |
| 5.644  | LyondellBasell Industries NV Class A              |                       | 419.180           | 0,05                         |
| 330  | Mastercard Inc Class A                            |                       | 173.768           | 0,02                         |
| 143  | Meta Platforms Inc Class A                        |                       | 83.728            | 0,01                         |
| 1.814  | Middleby Corp                                     |                       | 245.706           | 0,03                         |
| 1.140  | Morgan Stanley                                    |                       | 143.321           | 0,02                         |
| 108  | Netflix Inc                                       |                       | 96.263            | 0,01                         |
| 1.534  | NRG Energy Inc                                    |                       | 138.397           | 0,02                         |
| 233  | Nucor Corp  |                       | 27.193            | 0,00                         |
| 4.796  | ONEOK Inc   |                       | 481.518           | 0,06                         |
| 8.586  | PG&E Corp   |                       | 173.265           | 0,02                         |
| 1.398  | Prudential Financial Inc                          |                       | 165.705           | 0,02                         |
| 4.824  | Range Resources Corp                              |                       | 173.568           | 0,02                         |
| 1.452  | Ross Stores Inc                                   |                       | 219.644           | 0,03                         |
| 1.235  | Semtech Corp                                      |                       | 76.385            | 0,01                         |
| 1.197  | Skyworks Solutions Inc                            |                       | 106.150           | 0,01                         |
| 1.299  | State Street Corp                                 |                       | 127.497           | 0,02                         |
| 2.811  | T Rowe Price Group Inc                            |                       | 317.896           | 0,04                         |
| 418  | Take-Two Interactive Software Inc                 |                       | 76.945            | 0,01                         |
| 2.561  | Targa Resources Corp                              |                       | 457.139           | 0,06                         |
| 708  | Thor Industries Inc                               |                       | 67.763            | 0,01                         |
| 3.116  | Unum Group  |                       | 227.561           | 0,03                         |
| 8.512  | Viatris Inc                                       |                       | 105.974           | 0,01                         |
| 2.602  | Western Digital Corp                              |                       | 155.157           | 0,02                         |
| 290  | Wingstop Inc                                      |                       | 82.418            | 0,01                         |
| 55.607   | Winnebago Industries Inc                          |                       | 2.656.902         | 0,33                         |
| 1.311  | Wynn Resorts Ltd                                  |                       | 112.956           | 0,01                         |
|  | <b>Aktien insgesamt *</b>                         |                       | <b>16.585.832</b> | <b>2,05</b>                  |
| <b>Immobilienaktiengesellschaften 0,06 % (31. Dezember 2023: 0,07 %)</b> |   |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |   |                       |                   |                              |
| 4.600  | Tanger Inc  |                       | 156.998           | 0,02                         |
| 5.799  | Ventas Inc  |                       | 341.503           | 0,04                         |
|  | <b>Immobilienaktiengesellschaften insgesamt *</b> |                       | <b>498.501</b>    | <b>0,06</b>                  |
|  |   |                       |                   |                              |
| Anzahl der Anteile   | Wertpapierbezeichnung                             | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
| <b>Participatory Notes 0,02 % (31. Dezember 2023: 0,00 %)</b>            |   |                       |                   |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |   |                       |                   |                              |
| 150  | BNP Paribas Issuance BV                           | 08.08.2025            | 161.034           | 0,02                         |
|  | <b>Participatory Notes insgesamt **</b>           |                       | <b>161.034</b>    | <b>0,02</b>                  |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                                   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|---------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Schatzwechsel 38,27 % (31. Dezember 2023: 43,48 %)</b>      |   |         |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |   |         |                       |                    |                              |
| 20.000.000   | United States Treasury Bill                             | 0,00 %  | 09.01.2025            | 19.983.650         | 2,48                         |
| 55.000.000   | United States Treasury Bill                             | 0,00 %  | 16.01.2025            | 54.909.511         | 6,81                         |
| 55.000.000   | United States Treasury Bill                             | 0,00 %  | 23.01.2025            | 54.863.973         | 6,80                         |
| 50.000.000   | United States Treasury Bill                             | 0,00 %  | 06.02.2025            | 49.795.217         | 6,17                         |
| 65.000.000   | United States Treasury Bill                             | 0,00 %  | 20.02.2025            | 64.631.988         | 8,01                         |
| 65.000.000   | United States Treasury Bill                             | 0,00 %  | 27.02.2025            | 64.574.576         | 8,00                         |
| <b>Schatzwechsel insgesamt **</b>                              |   |         |                       | <b>308.758.915</b> | <b>38,27</b>                 |
| <b>Unternehmensanleihen 7,83 % (31. Dezember 2023: 7,41 %)</b> |   |         |                       |                    |                              |
| <b>Euro</b>  |   |         |                       |                    |                              |
| 500.000  | BNP Paribas SA**  | 0,00 %  | 03.01.2025            | 714.236            | 0,09                         |
| 2.000.000  | KBC Group NV*   | 8,00 %  | 29.12.2049            | 2.288.455          | 0,28                         |
| <b>Euro insgesamt</b>  |   |         |                       | <b>3.002.691</b>   | <b>0,37</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>   |   |         |                       |                    |                              |
| 1.500.000  | Alamo Re Ltd**  | 6,00 %  | 07.06.2027            | 1.569.000          | 0,19                         |
| 2.000.000  | Alamo Re Ltd**  | 12,68 % | 07.06.2026            | 2.098.400          | 0,26                         |
| 2.250.000  | Atlas Capital Reinsurance 2022 Designated Activity Co** | 14,27 % | 06.06.2025            | 2.308.275          | 0,29                         |
| 2.250.000  | Blue Halo Re Ltd*                                       | 14,03 % | 24.02.2025            | 2.273.175          | 0,28                         |
| 750.000  | Blue Ridge Re Ltd**                                     | 12,28 % | 08.01.2027            | 783.225            | 0,10                         |
| 2.000.000  | Bridge Street Re Ltd**                                  | 8,28 %  | 07.01.2028            | 2.000.000          | 0,25                         |
| 2.400.000  | Cape Lookout Re Ltd**                                   | 13,87 % | 28.03.2025            | 2.437.200          | 0,30                         |
| 750.000  | Cape Lookout Re Ltd**                                   | 12,70 % | 28.04.2026            | 784.050            | 0,10                         |
| 1.400.000  | Cape Lookout Re Ltd**                                   | 12,28 % | 05.04.2027            | 1.457.120          | 0,18                         |
| 2.750.000  | Gateway Re II Ltd**                                     | 13,18 % | 27.04.2026            | 2.928.475          | 0,36                         |
| 2.500.000  | Herbie Re Ltd**   | 11,53 % | 08.01.2029            | 2.502.953          | 0,31                         |
| 3.000.000  | Herbie Re Ltd**   | 14,00 % | 08.01.2025            | 2.995.500          | 0,37                         |
| 2.000.000  | Hestia Re Ltd**   | 14,36 % | 22.04.2025            | 1.814.000          | 0,22                         |
| 2.500.000  | Hestia Re Ltd**   | 15,03 % | 07.04.2026            | 2.600.125          | 0,32                         |
| 1.800.000  | Kilimanjaro III Re Ltd**                                | 10,13 % | 25.06.2025            | 1.841.220          | 0,23                         |
| 420.000  | Montoya Re Ltd*   | 11,38 % | 07.04.2025            | 424.452            | 0,05                         |
| 1.500.000  | Pelican IV Re Ltd**                                     | 4,78 %  | 07.05.2027            | 40.725             | 0,01                         |
| 1.500.000  | Purple Re Ltd**   | 17,15 % | 24.04.2026            | 1.590.150          | 0,20                         |
| 1.685.000  | Residential Reinsurance 2021 Ltd**                      | 8,16 %  | 06.06.2025            | 1.697.301          | 0,21                         |
| 1.425.000  | Residential Reinsurance 2021 Ltd**                      | 9,79 %  | 06.06.2025            | 1.428.847          | 0,18                         |
| 1.000.000  | Residential Reinsurance 2021 Ltd*                       | 14,21 % | 06.06.2025            | 857.450            | 0,11                         |
| 3.000.000  | Residential Reinsurance 2022 Ltd**                      | 14,63 % | 06.12.2026            | 3.220.800          | 0,40                         |
| 2.450.000  | Sanders Re III Ltd**                                    | 10,03 % | 07.04.2028            | 2.553.268          | 0,32                         |
| 1.500.000  | Sanders Re III Ltd*                                     | 17,28 % | 07.04.2026            | 1.472.475          | 0,18                         |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung                            | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--|---------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Unternehmensanleihen 7,83 % (31. Dezember 2023: 7,41 %) (Fortsetzung)</b> |  |         |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>   |  |         |                       |                    |                              |
| 3.250.000  | Sussex Capital UK Pcc Ltd**                      | 12,64 % | 08.01.2025            | 3.245.125          | 0,40                         |
| 3.000.000  | Tailwind RE Ltd*                                 | 13,24 % | 08.01.2025            | 2.995.500          | 0,37                         |
| 2.700.000  | Titania RE Ltd**                                 | 10,53 % | 26.11.2027            | 2.695.140          | 0,33                         |
| 2.000.000  | Titania RE Ltd**                                 | 16,81 % | 27.02.2026            | 2.121.100          | 0,26                         |
| 1.000.000  | Ursa Re II Ltd**                                 | 9,28 %  | 16.06.2025            | 1.008.700          | 0,13                         |
| 2.000.000  | Ursa Re II Ltd**                                 | 11,28 % | 06.12.2025            | 2.073.600          | 0,26                         |
| 2.250.000  | Veraison Re Ltd**                                | 9,03 %  | 08.03.2027            | 2.329.875          | 0,29                         |
| <b>US-Dollar insgesamt</b>   |  |         |                       | <b>60.147.226</b>  | <b>7,46</b>                  |
| <b>Unternehmensanleihen insgesamt</b>  |  |         |                       | <b>63.149.917</b>  | <b>7,83</b>                  |
| <b>Staatsanleihen 1,28 % (31. Dezember 2023: 2,40 %)</b>                     |  |         |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |  |         |                       |                    |                              |
| 15.491.200   | Argentine Republic Government International Bond | 4,13 %  | 09.07.2035            | 10.311.805         | 1,28                         |
| <b>Staatsanleihen insgesamt *</b>  |  |         |                       | <b>10.311.805</b>  | <b>1,28</b>                  |
| <b>Anlagen insgesamt</b>   |  |         |                       | <b>399.466.004</b> | <b>49,51</b>                 |

### Devisenterminkontrakte 3,16 % (31. Dezember 2023: 5,65 %)

| Geforderter<br>Betrag | Zu zahlender<br>Betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|-----------------------|------------------------|-----------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------------|------------------------------|
| 50.000 AUD            | 4.816.358 ¥            | 19.03.2025            | Citibank NA                    | 1         | 46                                   | 0,00                         |
| 36.000.000 AUD        | 39.707.208 NZD         | 24.01.2025            | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 41.272                               | 0,00                         |
| 629.128 AUD           | 375.000 €              | 24.01.2025            | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 890                                  | 0,00                         |
| 120.000 AUD           | 11.518.404 ¥           | 19.03.2025            | Royal Bank of Scotland         | 1         | 371                                  | 0,00                         |
| 60.000 AUD            | 5.786.150 ¥            | 19.03.2025            | State Street Bank and Trust Co | 1         | 13                                   | 0,00                         |
| 850.000 BRL           | 135.493 US\$           | 19.03.2025            | Barclays Bank Plc              | 2         | 302                                  | 0,00                         |
| 290.000 BRL           | 46.262 US\$            | 19.03.2025            | Citibank NA                    | 2         | 67                                   | 0,00                         |
| 2.380.000 BRL         | 379.821 US\$           | 19.03.2025            | HSBC Bank Plc                  | 2         | 404                                  | 0,00                         |
| 7.456.663 BRL         | 1.200.000 US\$         | 03.01.2025            | JPMorgan Chase Bank            | 4         | 7.000                                | 0,00                         |
| 623.183 BRL           | 100.000 US\$           | 04.02.2025            | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 255                                  | 0,00                         |
| 230.000 CAD           | 160.363 US\$           | 19.03.2025            | Barclays Bank Plc              | 3         | 4                                    | 0,00                         |
| 400.000 CAD           | 278.358 US\$           | 19.03.2025            | Citibank NA                    | 4         | 544                                  | 0,00                         |
| 380.000 CAD           | 5.530.737 MXN          | 19.03.2025            | Goldman Sachs International    | 1         | 2.335                                | 0,00                         |
| 450.000 CAD           | 313.371 US\$           | 19.03.2025            | Goldman Sachs International    | 5         | 393                                  | 0,00                         |
| 6.794.856 CAD         | 7.600.000 AUD          | 24.01.2025            | JPMorgan Chase Bank            | 2         | 22.662                               | 0,00                         |
| 2.400.000 CAD         | 260.770.962 ¥          | 24.01.2025            | JPMorgan Chase Bank            | 2         | 6.563                                | 0,00                         |
| 562.030 CAD           | 375.000 €              | 24.01.2025            | JPMorgan Chase Bank            | 3         | 2.454                                | 0,00                         |
| 110.000 CAD           | 76.686 US\$            | 19.03.2025            | Royal Bank of Canada           | 2         | 12                                   | 0,00                         |
| 120.000 CAD           | 1.758.369 MXN          | 19.03.2025            | Royal Bank of Canada           | 1         | 176                                  | 0,00                         |
| 190.000 CAD           | 132.339 US\$           | 19.03.2025            | State Street Bank and Trust Co | 3         | 138                                  | 0,00                         |
| 420.000 CAD           | 292.390 US\$           | 19.03.2025            | UBS AG                         | 5         | 455                                  | 0,00                         |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 3,16 % (31. Dezember 2023: 5,65 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 704.672 CHF        | 750.000 €           | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 2.174                          | 0,00                 |
| 99.805.407 CLP     | 100.000 US\$        | 23.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 336                            | 0,00                 |
| 398.983.568 CLP    | 400.000 US\$        | 13.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 1.150                          | 0,00                 |
| 7.210.227 COP      | 1.635 US\$          | 03.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 1                              | 0,00                 |
| 443.587.538 COP    | 100.000 US\$        | 07.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 632                            | 0,00                 |
| 268.031.000 EGP    | 5.199.942 US\$      | 15.01.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | 49.598                         | 0,01                 |
| 114.092 €          | 490.000 PLN         | 19.03.2025       | Barclays Bank Plc              | 4         | 241                            | 0,00                 |
| 20.000 €           | 3.177.425 ¥         | 19.03.2025       | Barclays Bank Plc              | 1         | 384                            | 0,00                 |
| 2.690.000 €        | 1.114.345.627 HUF   | 19.03.2025       | BNP Paribas                    | 3         | 305                            | 0,00                 |
| 67.442 €           | 290.000 PLN         | 19.03.2025       | Citibank NA                    | 3         | 56                             | 0,00                 |
| 30.000 €           | 4.818.408 ¥         | 19.03.2025       | Citibank NA                    | 1         | 239                            | 0,00                 |
| 40.000 €           | 6.413.854 ¥         | 19.03.2025       | Deutsche Bank AG               | 2         | 389                            | 0,00                 |
| 153.589 €          | 660.000 PLN         | 19.03.2025       | Goldman Sachs International    | 4         | 234                            | 0,00                 |
| 200.000 €          | 853.518 PLN         | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 796                            | 0,00                 |
| 3.250.000 €        | 5.415.820 AUD       | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | 14.958                         | 0,00                 |
| 125.000 €          | 115.929 CHF         | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 1.314                          | 0,00                 |
| 130.000 €          | 20.819.588 ¥        | 19.03.2025       | Royal Bank of Scotland         | 4         | 1.423                          | 0,00                 |
| 180.000 €          | 28.825.217 ¥        | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 6         | 1.984                          | 0,00                 |
| 104.765 €          | 450.000 PLN         | 19.03.2025       | UBS AG                         | 4         | 206                            | 0,00                 |
| 70.000 €           | 28.879.403 HUF      | 19.03.2025       | UBS AG                         | 2         | 305                            | 0,00                 |
| 30.000 £           | 5.838.328 ¥         | 19.03.2025       | Barclays Bank Plc              | 1         | 76                             | 0,00                 |
| 50.000 £           | 9.590.254 ¥         | 19.03.2025       | Citibank NA                    | 2         | 1.026                          | 0,00                 |
| 40.000 £           | 50.019 US\$         | 19.03.2025       | Citibank NA                    | 1         | 49                             | 0,00                 |
| 20.000 £           | 3.824.104 ¥         | 19.03.2025       | Deutsche Bank AG               | 1         | 488                            | 0,00                 |
| 393.421 £          | 491.677 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | 988                            | 0,00                 |
| 750.000 £          | 1.506.532 AUD       | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 3         | 6.329                          | 0,00                 |
| 1.000.000 £        | 1.126.097 CHF       | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 3         | 6.545                          | 0,00                 |
| 2.665.671 £        | 3.200.000 €         | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 3         | 21.425                         | 0,01                 |
| 500.000 £          | 97.518.020 ¥        | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 3.991                          | 0,00                 |
| 60.000 £           | 11.561.124 ¥        | 19.03.2025       | Royal Bank of Scotland         | 2         | 893                            | 0,00                 |
| 260.000 £          | 50.225.120 ¥        | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 10        | 3.052                          | 0,00                 |
| 8.546.518 HUF      | 520.000 CZK         | 19.03.2025       | BNP Paribas                    | 1         | 15                             | 0,00                 |
| 99.152.190 HUF     | 6.030.000 CZK       | 19.03.2025       | Citibank NA                    | 4         | 294                            | 0,00                 |
| 16.574.218 HUF     | 40.000 €            | 19.03.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | 5                              | 0,00                 |
| 17.430.000 HUF     | 43.600 US\$         | 19.03.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | 108                            | 0,00                 |
| 25.156.716 HUF     | 1.520.000 CZK       | 19.03.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 483                            | 0,00                 |
| 83.017.818 HUF     | 200.000 €           | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | 1.468                          | 0,00                 |
| 34.810.394 HUF     | 2.100.000 CZK       | 19.03.2025       | UBS AG                         | 2         | 804                            | 0,00                 |
| 35.770.000 HUF     | 89.298 US\$         | 19.03.2025       | UBS AG                         | 3         | 401                            | 0,00                 |
| 54.146.413 HUF     | 130.000 €           | 19.03.2025       | UBS AG                         | 5         | 722                            | 0,00                 |
| 364.272 ILS        | 100.000 US\$        | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 25                             | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 3,16 % (31. Dezember 2023: 5,65 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 6.661.095 ILS      | 1.795.617 US\$      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 3         | 33.037                         | 0,00                 |
| 130.000 ILS        | 35.685 US\$         | 19.03.2025       | UBS AG                         | 1         | 63                             | 0,00                 |
| 2.814.807 ILS      | 753.277 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                         | 2         | 19.465                         | 0,00                 |
| 51.220.000 INR     | 593.209 US\$        | 19.03.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | 957                            | 0,00                 |
| 8.010.000 INR      | 92.891 US\$         | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 27                             | 0,00                 |
| 56.793.159 ¥       | 650.000 NZD         | 19.03.2025       | Barclays Bank Plc              | 1         | 80                             | 0,00                 |
| 11.358.226 ¥       | 70.000 €            | 19.03.2025       | Citibank NA                    | 1         | 181                            | 0,00                 |
| 9.663.162 ¥        | 100.000 AUD         | 19.03.2025       | Citibank NA                    | 1         | 105                            | 0,00                 |
| 179.014.164 ¥      | 1.100.000 €         | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | 1.950                          | 0,00                 |
| 65.561.318 ¥       | 600.000 CAD         | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | 711                            | 0,00                 |
| 24.762.105 ¥       | 125.000 £           | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 1.443                          | 0,00                 |
| 43.721.525 ¥       | 250.000 CHF         | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 2.376                          | 0,00                 |
| 618.689.572 ¥      | 7.000.000 NZD       | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | 24.535                         | 0,00                 |
| 97.615.836 ¥       | 1.000.000 AUD       | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | 3.549                          | 0,00                 |
| 150.000.000 ¥      | 952.489 US\$        | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | 4.401                          | 0,00                 |
| 3.909.619 ¥        | 20.000 £            | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 62                             | 0,00                 |
| 3.496.769 ¥        | 40.000 NZD          | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 16                             | 0,00                 |
| 121.932.355 ¥      | 1.260.000 AUD       | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 6         | 2.453                          | 0,00                 |
| 29.440.000 ¥       | 188.611 US\$        | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 360                            | 0,00                 |
| 17.381.169 ¥       | 180.000 AUD         | 19.03.2025       | UBS AG                         | 2         | 108                            | 0,00                 |
| 10.322.684 MXN     | 494.524 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | 765                            | 0,00                 |
| 10.189.682 MXN     | 488.679 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                         | 1         | 229                            | 0,00                 |
| 2.850.000 NOK      | 249.825 US\$        | 19.03.2025       | Citibank NA                    | 5         | 1.065                          | 0,00                 |
| 2.964.093 NOK      | 250.000 €           | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | 1.877                          | 0,00                 |
| 3.020.000 NOK      | 264.099 US\$        | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 4         | 1.756                          | 0,00                 |
| 221.128 NZD        | 200.000 AUD         | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 69                             | 0,00                 |
| 60.000 NZD         | 5.238.690 ¥         | 19.03.2025       | Royal Bank of Scotland         | 1         | 17                             | 0,00                 |
| 52.940.000 PHP     | 900.757 US\$        | 19.03.2025       | UBS AG                         | 4         | 4.803                          | 0,00                 |
| 130.000 PLN        | 30.194 €            | 19.03.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | 14                             | 0,00                 |
| 40.000 PLN         | 9.292 €             | 19.03.2025       | HSBC Bank Plc                  | 1         | 3                              | 0,00                 |
| 32.070.000 PLN     | 7.451.878 €         | 19.03.2025       | Royal Bank of Scotland         | 3         | 200                            | 0,00                 |
| 120.000 PLN        | 27.846 €            | 19.03.2025       | UBS AG                         | 1         | 40                             | 0,00                 |
| 101.151.648 SEK    | 104.000.000 NOK     | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 8.381                          | 0,00                 |
| 2.208.322 SEK      | 200.000 US\$        | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | 89                             | 0,00                 |
| 8.080.000 THB      | 236.615 US\$        | 19.03.2025       | BNP Paribas                    | 2         | 1.549                          | 0,00                 |
| 8.220.000 THB      | 241.520 US\$        | 19.03.2025       | Deutsche Bank AG               | 1         | 770                            | 0,00                 |
| 9.740.000 TRY      | 256.174 US\$        | 19.03.2025       | Barclays Bank Plc              | 2         | 39                             | 0,00                 |
| 1.020.000 TRY      | 26.482 US\$         | 19.03.2025       | BNP Paribas                    | 1         | 349                            | 0,00                 |
| 8.839.091 TRY      | 220.000 €           | 19.03.2025       | Citibank NA                    | 4         | 3.953                          | 0,00                 |
| 1.800.000 TRY      | 859.485 ZAR         | 19.03.2025       | Goldman Sachs International    | 2         | 2.112                          | 0,00                 |
| 599.248.116 TRY    | 15.619.352 US\$     | 19.03.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | 144.028                        | 0,02                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 3,16 % (31. Dezember 2023: 5,65 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 17.825.141 TRY     | 487.959 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | 9.681                          | 0,00                 |
| 32.080.000 TRY     | 15.007.441 ZAR      | 19.03.2025       | HSBC Bank Plc               | 3         | 53.993                         | 0,02                 |
| 10.927.774 TRY     | 300.000 US\$        | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 2         | 2.469                          | 0,00                 |
| 317.486.325 TRY    | 8.244.000 US\$      | 19.03.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 107.562                        | 0,02                 |
| 80.566.657 TRY     | 1.980.000 €         | 19.03.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 3         | 62.250                         | 0,01                 |
| 1.760.000 TRY      | 841.001 ZAR         | 19.03.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 2.033                          | 0,00                 |
| 56.278.380 TRY     | 1.494.172 US\$      | 16.01.2025       | UBS AG                      | 3         | 77.002                         | 0,01                 |
| 77.160.000 TRY     | 2.003.870 US\$      | 19.03.2025       | UBS AG                      | 3         | 25.845                         | 0,00                 |
| 4.031.476 US\$     | 82.473.739 MXN      | 19.03.2025       | Banco Santander SA          | 1         | 115.307                        | 0,02                 |
| 428.234 US\$       | 1.760.000 PLN       | 19.03.2025       | Barclays Bank Plc           | 1         | 3.344                          | 0,00                 |
| 4.539.133 US\$     | 4.290.000 €         | 19.03.2025       | Barclays Bank Plc           | 9         | 82.126                         | 0,02                 |
| 2.726.363 US\$     | 30.300.000 NOK      | 19.03.2025       | Barclays Bank Plc           | 6         | 59.001                         | 0,01                 |
| 579.251 US\$       | 10.800.000 ZAR      | 19.03.2025       | Barclays Bank Plc           | 10        | 10.822                         | 0,00                 |
| 1.412.891 US\$     | 1.230.000 CHF       | 19.03.2025       | Barclays Bank Plc           | 2         | 44.299                         | 0,01                 |
| 196.243 US\$       | 340.000 NZD         | 19.03.2025       | Barclays Bank Plc           | 3         | 5.600                          | 0,00                 |
| 3.122.930 US\$     | 2.450.000 £         | 19.03.2025       | Barclays Bank Plc           | 6         | 56.293                         | 0,01                 |
| 688.120 US\$       | 14.210.000 MXN      | 19.03.2025       | Barclays Bank Plc           | 6         | 13.375                         | 0,00                 |
| 12.264.516 US\$    | 17.320.000 CAD      | 19.03.2025       | Barclays Bank Plc           | 9         | 188.138                        | 0,02                 |
| 179.247 US\$       | 27.780.000 ¥        | 19.03.2025       | Barclays Bank Plc           | 4         | 932                            | 0,00                 |
| 19.292 US\$        | 70.000 ILS          | 19.03.2025       | Barclays Bank Plc           | 1         | 43                             | 0,00                 |
| 1.361.446 US\$     | 6.034.320.000 COP   | 19.03.2025       | Barclays Bank Plc           | 4         | 5.681                          | 0,00                 |
| 470.364 US\$       | 672.800.000 KRW     | 19.03.2025       | Barclays Bank Plc           | 8         | 13.854                         | 0,00                 |
| 220.742 US\$       | 1.050.000 RON       | 19.03.2025       | Barclays Bank Plc           | 3         | 3.237                          | 0,00                 |
| 1.275.682 US\$     | 26.330.000 MXN      | 19.03.2025       | BNP Paribas                 | 1         | 25.433                         | 0,00                 |
| 5.173.804 US\$     | 6.910.000 SGD       | 19.03.2025       | BNP Paribas                 | 6         | 93.230                         | 0,02                 |
| 346.872 US\$       | 2.520.000 CNY       | 19.03.2025       | BNP Paribas                 | 2         | 3.022                          | 0,00                 |
| 3.875.953 US\$     | 42.200.000 SEK      | 19.03.2025       | BNP Paribas                 | 5         | 41.086                         | 0,01                 |
| 47.207 US\$        | 290.000 BRL         | 19.03.2025       | BNP Paribas                 | 1         | 877                            | 0,00                 |
| 777.886 US\$       | 14.160.000 ZAR      | 19.03.2025       | BNP Paribas                 | 6         | 32.609                         | 0,00                 |
| 110.237 US\$       | 109.300.000 CLP     | 19.03.2025       | BNP Paribas                 | 2         | 434                            | 0,00                 |
| 130.749 US\$       | 1.460.000 NOK       | 19.03.2025       | BNP Paribas                 | 2         | 2.222                          | 0,00                 |
| 2.064.780 US\$     | 9.790.000 RON       | 19.03.2025       | BNP Paribas                 | 3         | 36.807                         | 0,01                 |
| 64.011 US\$        | 2.170.000 THB       | 19.03.2025       | BNP Paribas                 | 1         | 48                             | 0,00                 |
| 1.946.254 US\$     | 761.870.000 HUF     | 19.03.2025       | BNP Paribas                 | 3         | 35.733                         | 0,00                 |
| 1.454.855 US\$     | 1.270.000 CHF       | 19.03.2025       | BNP Paribas                 | 3         | 41.755                         | 0,01                 |
| 308.597 US\$       | 26.520.000 INR      | 19.03.2025       | BNP Paribas                 | 2         | 958                            | 0,00                 |
| 2.128.189 US\$     | 50.620.000 CZK      | 19.03.2025       | BNP Paribas                 | 3         | 43.377                         | 0,01                 |
| 2.802.008 US\$     | 11.460.000 PLN      | 19.03.2025       | Citibank NA                 | 12        | 35.398                         | 0,00                 |
| 669.163 US\$       | 530.000 £           | 19.03.2025       | Citibank NA                 | 5         | 5.766                          | 0,00                 |
| 98.326 US\$        | 15.300.000 ¥        | 19.03.2025       | Citibank NA                 | 2         | 117                            | 0,00                 |
| 306.328 US\$       | 290.000 €           | 19.03.2025       | Citibank NA                 | 4         | 5.039                          | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 3,16 % (31. Dezember 2023: 5,65 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 1.016.186 US\$     | 7.390.000 CNY       | 19.03.2025       | Citibank NA                 | 9         | 7.833                          | 0,00                 |
| 787.807 US\$       | 8.630.000 SEK       | 19.03.2025       | Citibank NA                 | 7         | 3.567                          | 0,00                 |
| 396.110 US\$       | 560.000 CAD         | 19.03.2025       | Citibank NA                 | 11        | 5.649                          | 0,00                 |
| 219.043 US\$       | 380.000 NZD         | 19.03.2025       | Citibank NA                 | 5         | 5.973                          | 0,00                 |
| 3.362.030 US\$     | 20.640.000 BRL      | 19.03.2025       | Citibank NA                 | 5         | 64.615                         | 0,01                 |
| 44.864 US\$        | 64.130.000 KRW      | 19.03.2025       | Citibank NA                 | 1         | 1.350                          | 0,00                 |
| 61.742 US\$        | 5.270.000 INR       | 19.03.2025       | Citibank NA                 | 2         | 609                            | 0,00                 |
| 181.513 US\$       | 2.030.000 NOK       | 19.03.2025       | Citibank NA                 | 5         | 2.810                          | 0,00                 |
| 758.784 US\$       | 1.020.000 SGD       | 19.03.2025       | Citibank NA                 | 3         | 8.829                          | 0,00                 |
| 30.916 US\$        | 30.550.000 CLP      | 19.03.2025       | Citibank NA                 | 1         | 225                            | 0,00                 |
| 390.119 US\$       | 9.370.000 CZK       | 19.03.2025       | Citibank NA                 | 4         | 4.211                          | 0,00                 |
| 616.461 US\$       | 970.000 AUD         | 19.03.2025       | Citibank NA                 | 13        | 15.822                         | 0,00                 |
| 33.719 US\$        | 1.970.000 PHP       | 19.03.2025       | Deutsche Bank AG            | 1         | 21                             | 0,00                 |
| 363.586 US\$       | 1.730.000 RON       | 19.03.2025       | Deutsche Bank AG            | 5         | 5.220                          | 0,00                 |
| 27.107 US\$        | 26.500.000 CLP      | 19.03.2025       | Deutsche Bank AG            | 1         | 485                            | 0,00                 |
| 222.745 US\$       | 1.370.000 BRL       | 19.03.2025       | Deutsche Bank AG            | 4         | 3.876                          | 0,00                 |
| 11.264 US\$        | 10.000 CHF          | 19.03.2025       | Deutsche Bank AG            | 1         | 137                            | 0,00                 |
| 543.985 US\$       | 81.740.000 ¥        | 19.03.2025       | Deutsche Bank AG            | 5         | 19.309                         | 0,00                 |
| 5.385.982 US\$     | 8.420.000 AUD       | 19.03.2025       | Deutsche Bank AG            | 3         | 172.182                        | 0,02                 |
| 3.569.252 US\$     | 6.120.000 NZD       | 19.03.2025       | Deutsche Bank AG            | 3         | 137.666                        | 0,02                 |
| 739.879 US\$       | 4.319.047 BRL       | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 2         | 42.535                         | 0,01                 |
| 20.163.600 US\$    | 18.000.000 €        | 31.01.2025       | Goldman Sachs International | 2         | 1.503.247                      | 0,19                 |
| 193.433 US\$       | 4.010.000 MXN       | 19.03.2025       | Goldman Sachs International | 2         | 3.023                          | 0,00                 |
| 126.265 US\$       | 120.000 €           | 19.03.2025       | Goldman Sachs International | 2         | 1.593                          | 0,00                 |
| 11.017.584 US\$    | 10.253.238 €        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 15        | 394.712                        | 0,05                 |
| 590.564 US\$       | 11.030.000 ZAR      | 19.03.2025       | Goldman Sachs International | 8         | 10.027                         | 0,00                 |
| 36.881 US\$        | 50.000 SGD          | 19.03.2025       | Goldman Sachs International | 1         | 118                            | 0,00                 |
| 74.507 US\$        | 11.160.000 ¥        | 19.03.2025       | Goldman Sachs International | 1         | 2.872                          | 0,00                 |
| 1.019.697 US\$     | 18.037.735 ZAR      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | 64.983                         | 0,01                 |
| 536.259 US\$       | 80.000.000 ¥        | 31.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | 25.476                         | 0,00                 |
| 2.001.800 US\$     | 737.364.754 HUF     | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | 146.893                        | 0,02                 |
| 737.261 US\$       | 62.328.766 INR      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 2         | 9.968                          | 0,00                 |
| 2.279.460 US\$     | 25.058.558 NOK      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 7         | 73.138                         | 0,01                 |
| 1.494.944 US\$     | 1.317.331 CHF       | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 2         | 39.161                         | 0,00                 |
| 247.973 US\$       | 5.842.445 CZK       | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | 7.609                          | 0,00                 |
| 1.568.443 US\$     | 1.522.120.000 CLP   | 19.03.2025       | Goldman Sachs International | 3         | 39.327                         | 0,00                 |
| 32.114.751 US\$    | 4.868.259.691 ¥     | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 11        | 1.089.497                      | 0,14                 |
| 1.136.158 US\$     | 4.492.854 PLN       | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 3         | 48.921                         | 0,01                 |
| 291.138 US\$       | 1.190.000 PLN       | 19.03.2025       | Goldman Sachs International | 2         | 3.854                          | 0,00                 |
| 1.336.400 US\$     | 1.000.000 £         | 31.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | 84.307                         | 0,01                 |
| 39.914 US\$        | 62.000 AUD          | 31.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | 1.526                          | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 3,16 % (31. Dezember 2023: 5,65 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 6.972.884 US\$     | 5.460.914 £         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 6         | 134.414                        | 0,01                 |
| 3.656.543 US\$     | 5.089.109 CAD       | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 6         | 116.284                        | 0,02                 |
| 2.649.145 US\$     | 4.453.812 NZD       | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 4         | 153.712                        | 0,02                 |
| 3.018.646 US\$     | 62.204.661 MXN      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 4         | 34.029                         | 0,00                 |
| 1.048.200 US\$     | 1.000.000 €         | 06.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | 12.573                         | 0,00                 |
| 18.205.112 US\$    | 27.658.806 AUD      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 15        | 1.079.838                      | 0,14                 |
| 692.302 US\$       | 16.510.000 CZK      | 19.03.2025       | Goldman Sachs International | 7         | 12.328                         | 0,00                 |
| 5.402.692 US\$     | 58.444.106 SEK      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 9         | 109.613                        | 0,01                 |
| 913.611 US\$       | 720.000 £           | 19.03.2025       | Goldman Sachs International | 4         | 12.395                         | 0,00                 |
| 259.118 US\$       | 22.300.000 INR      | 19.03.2025       | HSBC Bank Plc               | 1         | 432                            | 0,00                 |
| 39.547 US\$        | 740.000 ZAR         | 19.03.2025       | HSBC Bank Plc               | 1         | 598                            | 0,00                 |
| 74.630 US\$        | 331.890.000 COP     | 19.03.2025       | HSBC Bank Plc               | 1         | 62                             | 0,00                 |
| 125.581 US\$       | 100.000 £           | 19.03.2025       | HSBC Bank Plc               | 2         | 412                            | 0,00                 |
| 4.836.229 US\$     | 34.960.000 CNY      | 19.03.2025       | HSBC Bank Plc               | 3         | 66.001                         | 0,02                 |
| 5.022.738 US\$     | 4.500.000 CHF       | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 6         | 45.098                         | 0,01                 |
| 500.000 US\$       | 717.453.662 KRW     | 21.01.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 4         | 14.262                         | 0,00                 |
| 2.642.894 US\$     | 224.604.232 INR     | 17.01.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 22.347                         | 0,00                 |
| 600.000 US\$       | 51.103.656 INR      | 21.01.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 3         | 4.007                          | 0,00                 |
| 17.398.094 US\$    | 25.000.000 CAD      | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 1.308                          | 0,00                 |
| 100.000 US\$       | 3.243.820 TWD       | 17.01.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 1.337                          | 0,00                 |
| 4.019.153 US\$     | 130.404.614 TWD     | 13.01.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 5         | 52.827                         | 0,01                 |
| 927.083 US\$       | 78.690.871 INR      | 13.01.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 2         | 8.574                          | 0,00                 |
| 16.100.000 US\$    | 21.848.264 SGD      | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 5         | 69.941                         | 0,00                 |
| 827.083 US\$       | 70.957.105 INR      | 03.02.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 681                            | 0,00                 |
| 100.000 US\$       | 98.024.150 CLP      | 02.01.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 1.436                          | 0,00                 |
| 1.000.000 US\$     | 1.414.583.100 KRW   | 06.01.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 40.542                         | 0,01                 |
| 608.396 US\$       | 848.630.272 KRW     | 03.01.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 4         | 31.939                         | 0,00                 |
| 100.000 US\$       | 142.080.860 KRW     | 10.01.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 3.824                          | 0,00                 |
| 6.734.319 US\$     | 11.900.000 NZD      | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 2         | 66.491                         | 0,01                 |
| 400.000 US\$       | 389.086.013 CLP     | 13.01.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 4         | 8.801                          | 0,00                 |
| 11.200.000 US\$    | 16.195.935.851 KRW  | 23.01.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 3         | 234.492                        | 0,03                 |
| 8.321.711 US\$     | 1.300.000.000 ¥     | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 2         | 28.662                         | 0,00                 |
| 100.000 US\$       | 143.226.862 KRW     | 17.01.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 3.037                          | 0,00                 |
| 200.000 US\$       | 194.194.980 CLP     | 09.01.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 4.743                          | 0,00                 |
| 9.100.000 US\$     | 103.114.501 NOK     | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 21.298                         | 0,00                 |
| 10.900.000 US\$    | 15.593.960.947 KRW  | 16.01.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 4         | 343.258                        | 0,04                 |
| 800.000 US\$       | 1.143.390.820 KRW   | 13.01.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 6         | 25.989                         | 0,00                 |
| 11.900.000 US\$    | 16.829.461.000 KRW  | 09.01.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 3         | 502.284                        | 0,06                 |
| 500.000 US\$       | 42.426.410 INR      | 10.01.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 1         | 4.625                          | 0,00                 |
| 400.000 US\$       | 1.742.267.400 COP   | 13.01.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 3         | 5.089                          | 0,00                 |
| 200.000 US\$       | 16.972.004 INR      | 06.01.2025       | JPMorgan Chase Bank         | 2         | 1.792                          | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 3,16 % (31. Dezember 2023: 5,65 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei            | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 100.000 US\$       | 8.484.787 INR       | 09.01.2025       | JPMorgan Chase Bank    | 1         | 926                            | 0,00                 |
| 100.000 US\$       | 96.825.690 CLP      | 06.01.2025       | JPMorgan Chase Bank    | 1         | 2.643                          | 0,00                 |
| 700.000 US\$       | 692.452.394 CLP     | 21.01.2025       | JPMorgan Chase Bank    | 3         | 3.852                          | 0,00                 |
| 200.000 US\$       | 198.111.193 CLP     | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank    | 1         | 838                            | 0,00                 |
| 7.971.357 US\$     | 47.584.847 BRL      | 03.01.2025       | JPMorgan Chase Bank    | 48        | 268.863                        | 0,03                 |
| 100.000 US\$       | 437.292.449 COP     | 17.01.2025       | JPMorgan Chase Bank    | 1         | 938                            | 0,00                 |
| 9.856.943 US\$     | 15.800.000 AUD      | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank    | 4         | 74.073                         | 0,01                 |
| 100.000 US\$       | 434.614.444 COP     | 21.01.2025       | JPMorgan Chase Bank    | 1         | 1.602                          | 0,00                 |
| 200.000 US\$       | 196.993.191 CLP     | 17.01.2025       | JPMorgan Chase Bank    | 1         | 1.946                          | 0,00                 |
| 11.400.000 US\$    | 125.580.017 SEK     | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank    | 1         | 21.573                         | 0,00                 |
| 80.660.463 US\$    | 585.861.415 CNY     | 19.03.2025       | JPMorgan Chase Bank    | 2         | 720.722                        | 0,10                 |
| 200.000 US\$       | 195.525.197 CLP     | 16.01.2025       | JPMorgan Chase Bank    | 1         | 3.420                          | 0,00                 |
| 22.900.160 US\$    | 167.289.583 CNY     | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank    | 5         | 110.701                        | 0,01                 |
| 500.000 US\$       | 9.347.263 ZAR       | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank    | 3         | 5.654                          | 0,00                 |
| 600.000 US\$       | 2.610.948.000 COP   | 16.01.2025       | JPMorgan Chase Bank    | 1         | 8.446                          | 0,00                 |
| 200.171 US\$       | 6.502.034 TWD       | 02.01.2025       | JPMorgan Chase Bank    | 2         | 1.844                          | 0,00                 |
| 100.000 US\$       | 438.360.000 COP     | 23.01.2025       | JPMorgan Chase Bank    | 1         | 782                            | 0,00                 |
| 200.000 US\$       | 6.534.829 TWD       | 23.01.2025       | JPMorgan Chase Bank    | 2         | 1.238                          | 0,00                 |
| 100.000 US\$       | 440.018.000 COP     | 07.01.2025       | JPMorgan Chase Bank    | 1         | 178                            | 0,00                 |
| 300.000 US\$       | 297.885.849 CLP     | 27.01.2025       | JPMorgan Chase Bank    | 3         | 546                            | 0,00                 |
| 14.987.375 US\$    | 14.375.000 €        | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank    | 2         | 89.273                         | 0,01                 |
| 18.711.920 US\$    | 1.591.621.809 INR   | 16.01.2025       | JPMorgan Chase Bank    | 2         | 139.856                        | 0,02                 |
| 12.760.997 US\$    | 1.086.740.414 INR   | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank    | 1         | 91.012                         | 0,01                 |
| 200.000 US\$       | 195.029.275 CLP     | 10.01.2025       | JPMorgan Chase Bank    | 2         | 3.905                          | 0,00                 |
| 100.000 US\$       | 8.528.831 INR       | 27.01.2025       | JPMorgan Chase Bank    | 1         | 597                            | 0,00                 |
| 100.000 US\$       | 8.575.465 INR       | 30.01.2025       | JPMorgan Chase Bank    | 1         | 85                             | 0,00                 |
| 12.760.997 US\$    | 1.080.126.517 INR   | 03.01.2025       | JPMorgan Chase Bank    | 1         | 144.723                        | 0,02                 |
| 1.648.807 US\$     | 1.312.500 £         | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank    | 2         | 5.335                          | 0,00                 |
| 2.102.964 US\$     | 43.000.000 MXN      | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank    | 3         | 42.928                         | 0,01                 |
| 1.300.000 US\$     | 5.332.563 PLN       | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank    | 2         | 9.955                          | 0,00                 |
| 500.000 US\$       | 12.061.147 CZK      | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank    | 1         | 3.729                          | 0,00                 |
| 635.678 US\$       | 500.000 £           | 07.03.2025       | Nomura                 | 1         | 9.775                          | 0,00                 |
| 28.309 US\$        | 50.000 NZD          | 19.03.2025       | Royal Bank of Canada   | 1         | 273                            | 0,00                 |
| 401.862 US\$       | 320.000 £           | 19.03.2025       | Royal Bank of Canada   | 5         | 1.323                          | 0,00                 |
| 196.028 US\$       | 281.480.000 KRW     | 19.03.2025       | Royal Bank of Canada   | 2         | 5.039                          | 0,00                 |
| 379.460 US\$       | 540.000 CAD         | 19.03.2025       | Royal Bank of Canada   | 5         | 2.945                          | 0,00                 |
| 152.310 US\$       | 240.000 AUD         | 19.03.2025       | Royal Bank of Canada   | 5         | 3.699                          | 0,00                 |
| 48.827.349 US\$    | 354.490.459 CNY     | 19.03.2025       | Royal Bank of Canada   | 1         | 457.760                        | 0,06                 |
| 9.850.714 US\$     | 841.710.000 INR     | 19.03.2025       | Royal Bank of Canada   | 3         | 86.663                         | 0,02                 |
| 105.641 US\$       | 2.220.000 MXN       | 19.03.2025       | Royal Bank of Canada   | 1         | 227                            | 0,00                 |
| 14.262 US\$        | 160.000 NOK         | 19.03.2025       | Royal Bank of Scotland | 2         | 178                            | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 3,16 % (31. Dezember 2023: 5,65 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 36.478 US\$        | 53.540.000 KRW      | 19.03.2025       | Royal Bank of Scotland         | 1         | 150                            | 0,00                 |
| 69.408 US\$        | 120.000 NZD         | 19.03.2025       | Royal Bank of Scotland         | 2         | 2.122                          | 0,00                 |
| 1.253.134 US\$     | 1.100.000 CHF       | 19.03.2025       | Royal Bank of Scotland         | 15        | 29.191                         | 0,00                 |
| 110.624 US\$       | 9.470.000 INR       | 19.03.2025       | Société Générale               | 2         | 770                            | 0,00                 |
| 45.749 US\$        | 500.000 SEK         | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 312                            | 0,00                 |
| 295.171 US\$       | 400.000 SGD         | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 3         | 1.071                          | 0,00                 |
| 7.185.739 US\$     | 6.207.820 CHF       | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 10        | 325.472                        | 0,04                 |
| 5.410.285 US\$     | 59.233.733 NOK      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 11        | 194.956                        | 0,01                 |
| 6.022.450 US\$     | 63.951.771 SEK      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 9         | 230.559                        | 0,04                 |
| 255.075 US\$       | 360.000 CAD         | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 6         | 4.063                          | 0,00                 |
| 417.513 US\$       | 4.680.000 NOK       | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 12        | 5.523                          | 0,00                 |
| 1.250.073 US\$     | 22.392.094 ZAR      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 2         | 64.888                         | 0,01                 |
| 155.123 US\$       | 270.000 NZD         | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 4         | 3.729                          | 0,00                 |
| 2.631.919 US\$     | 4.424.533 NZD       | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 8         | 152.890                        | 0,01                 |
| 4.966.711 US\$     | 7.552.450 AUD       | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 14        | 290.524                        | 0,05                 |
| 190.871 US\$       | 780.000 PLN         | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 2.567                          | 0,00                 |
| 504.748 US\$       | 7.982.973.632 IDR   | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 2         | 11.394                         | 0,00                 |
| 29.504 US\$        | 11.600.000 HUF      | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 415                            | 0,00                 |
| 122.960 US\$       | 2.520.000 MXN       | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 2         | 3.301                          | 0,00                 |
| 512.505 US\$       | 3.003.432 BRL       | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 27.577                         | 0,01                 |
| 6.124.556 US\$     | 8.486.215 CAD       | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 8         | 221.084                        | 0,02                 |
| 1.012.983 US\$     | 7.168.461 CNY       | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 36.589                         | 0,01                 |
| 28.209 US\$        | 2.410.000 INR       | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 252                            | 0,00                 |
| 9.074.113 US\$     | 7.097.599 £         | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 14        | 186.093                        | 0,01                 |
| 1.334.730 US\$     | 1.270.000 €         | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 15        | 15.289                         | 0,00                 |
| 703.932 US\$       | 620.000 CHF         | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 8         | 14.073                         | 0,00                 |
| 5.502.749 US\$     | 5.125.574 €         | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 12        | 192.400                        | 0,03                 |
| 400.272 US\$       | 630.000 AUD         | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 13        | 10.165                         | 0,00                 |
| 90.620 US\$        | 88.650.000 CLP      | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 3         | 1.562                          | 0,00                 |
| 30.676 US\$        | 740.000 CZK         | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 199                            | 0,00                 |
| 1.356.700 US\$     | 1.080.000 £         | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 16        | 4.878                          | 0,00                 |
| 502.283 US\$       | 42.464.326 INR      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 2         | 6.782                          | 0,00                 |
| 59.352 US\$        | 1.100.000 ZAR       | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | 1.456                          | 0,00                 |
| 2.632.833 US\$     | 401.870.000 ¥       | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 46        | 53.290                         | 0,01                 |
| 622.070 US\$       | 851.860.246 KRW     | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 3         | 45.382                         | 0,01                 |
| 9.444.697 US\$     | 1.428.028.663 ¥     | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 17        | 343.917                        | 0,04                 |
| 2.456.895 US\$     | 9.816.777 PLN       | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 7         | 81.307                         | 0,00                 |
| 547.235 US\$       | 11.087.480 MXN      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 3         | 15.251                         | 0,00                 |
| 223.766 US\$       | 1.070.000 RON       | 19.03.2025       | UBS AG                         | 3         | 2.118                          | 0,00                 |
| 249.378 US\$       | 428.301 NZD         | 16.01.2025       | UBS AG                         | 1         | 9.405                          | 0,00                 |
| 489.651 US\$       | 660.000 SGD         | 19.03.2025       | UBS AG                         | 2         | 4.386                          | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 3,16 % (31. Dezember 2023: 5,65 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei          | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|----------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| 43.746.181 US\$    | 40.020.631 €        | 16.01.2025       | UBS AG               | 7         | 2.282.791                      | 0,28                 |
| 86.953 US\$        | 980.000 NOK         | 19.03.2025       | UBS AG               | 2         | 682                            | 0,00                 |
| 121.857 US\$       | 1.330.000 SEK       | 19.03.2025       | UBS AG               | 3         | 995                            | 0,00                 |
| 373.345 US\$       | 590.000 AUD         | 19.03.2025       | UBS AG               | 9         | 8.007                          | 0,00                 |
| 1.768.978 US\$     | 19.296.590 SEK      | 16.01.2025       | UBS AG               | 3         | 21.352                         | 0,00                 |
| 4.566.336 US\$     | 6.507.520.000 KRW   | 19.03.2025       | UBS AG               | 6         | 150.852                        | 0,02                 |
| 369.594 US\$       | 350.000 €           | 19.03.2025       | UBS AG               | 6         | 5.968                          | 0,00                 |
| 526.310 US\$       | 10.746.714 MXN      | 16.01.2025       | UBS AG               | 1         | 10.676                         | 0,00                 |
| 659.503 US\$       | 1.063.816 AUD       | 16.01.2025       | UBS AG               | 1         | 829                            | 0,00                 |
| 1.767.114 US\$     | 1.376.934 £         | 16.01.2025       | UBS AG               | 2         | 42.839                         | 0,00                 |
| 108.078 US\$       | 16.370.000 ¥        | 19.03.2025       | UBS AG               | 2         | 3.001                          | 0,00                 |
| 113.883 US\$       | 200.000 NZD         | 19.03.2025       | UBS AG               | 3         | 1.740                          | 0,00                 |
| 55.828 US\$        | 80.000 CAD          | 19.03.2025       | UBS AG               | 1         | 48                             | 0,00                 |
| 989.487 US\$       | 17.417.185 ZAR      | 16.01.2025       | UBS AG               | 1         | 67.618                         | 0,01                 |
| 248.412 US\$       | 348.777.550 KRW     | 16.01.2025       | UBS AG               | 1         | 12.298                         | 0,00                 |
| 204.469 US\$       | 80.120.000 HUF      | 19.03.2025       | UBS AG               | 6         | 3.555                          | 0,00                 |
| 894.940 US\$       | 340.524.944 HUF     | 16.01.2025       | UBS AG               | 3         | 38.319                         | 0,01                 |
| 112.834 US\$       | 90.000 £            | 19.03.2025       | UBS AG               | 1         | 182                            | 0,00                 |
| 1.512.845 US\$     | 2.100.812 CAD       | 16.01.2025       | UBS AG               | 1         | 51.406                         | 0,01                 |
| 1.255.078 US\$     | 189.753.635 ¥       | 16.01.2025       | UBS AG               | 2         | 45.784                         | 0,01                 |
| 1.254.762 US\$     | 13.857.998 NOK      | 16.01.2025       | UBS AG               | 3         | 34.613                         | 0,00                 |
| 281.088 US\$       | 24.040.000 INR      | 19.03.2025       | UBS AG               | 2         | 2.218                          | 0,00                 |
| 507.528 US\$       | 42.848.233 INR      | 16.01.2025       | UBS AG               | 1         | 7.548                          | 0,00                 |
| 1.404.312 US\$     | 5.780.000 PLN       | 19.03.2025       | UBS AG               | 11        | 8.936                          | 0,00                 |
| 206.180 US\$       | 3.790.000 ZAR       | 19.03.2025       | UBS AG               | 3         | 6.703                          | 0,00                 |
| 1.014.327 US\$     | 882.349 CHF         | 16.01.2025       | UBS AG               | 1         | 39.243                         | 0,01                 |
| 500.215 US\$       | 3.503.704 CNY       | 16.01.2025       | UBS AG               | 1         | 22.986                         | 0,00                 |
| 2.495.726 US\$     | 2.180.000 CHF       | 19.03.2025       | UBS AG               | 12        | 70.088                         | 0,01                 |
| 2.720.292 US\$     | 16.031.046 BRL      | 16.01.2025       | UBS AG               | 3         | 131.950                        | 0,03                 |
| 40.969 US\$        | 250.000 BRL         | 19.03.2025       | UBS AG               | 1         | 1.030                          | 0,00                 |
| 725.730 US\$       | 11.385.409.290 IDR  | 16.01.2025       | UBS AG               | 1         | 22.103                         | 0,00                 |
| 75.460 US\$        | 270.000 ILS         | 19.03.2025       | UBS AG               | 2         | 1.214                          | 0,00                 |
| 990.009 US\$       | 10.733.241 SEK      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp | 1         | 17.936                         | 0,00                 |
| 1.515.504 US\$     | 2.105.413 CAD       | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp | 2         | 50.865                         | 0,01                 |
| 25.464.496 US\$    | 23.695.984 €        | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp | 7         | 914.262                        | 0,12                 |
| 4.287.006 US\$     | 7.209.964 NZD       | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp | 7         | 247.324                        | 0,03                 |
| 1.012.331 US\$     | 155.073.486 ¥       | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp | 1         | 24.053                         | 0,00                 |
| 31.785.443 US\$    | 46.905.441 AUD      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp | 8         | 2.743.390                      | 0,34                 |
| 981.442 US\$       | 4.002.329 PLN       | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp | 1         | 12.908                         | 0,00                 |
| 243.047 US\$       | 213.655 CHF         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp | 1         | 6.937                          | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 3,16 % (31. Dezember 2023: 5,65 %) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i>   |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 20.865 US\$   | 18.160 CHF          | 16.01.2025       | UBS AG                         | 4         | 797                            | 0,00                 |
| 5.956.740 US\$  | 5.048.018 CHF       | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 3         | 378.172                        | 0,05                 |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>   |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 197.275 US\$  | 184.487 €           | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 2         | 6.137                          | 0,00                 |
| 244.298 US\$  | 221.904 €           | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 2         | 14.394                         | 0,00                 |
| 32.435.136 US\$   | 29.422.913 €        | 16.01.2025       | UBS AG                         | 2         | 1.951.515                      | 0,24                 |
| 1.405.273 US\$  | 1.300.613 €         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 30        | 57.774                         | 0,01                 |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>   |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 3.140.592 £   | 3.930.107 US\$      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | 2.722                          | 0,00                 |
| 148.662 £   | 185.968 US\$        | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 2         | 195                            | 0,00                 |
| 5.771.100 US\$  | 4.415.241 £         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | 242.082                        | 0,03                 |
| 8.825.478 US\$  | 6.933.389 £         | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 2         | 143.091                        | 0,02                 |
| 52.324.899 US\$   | 40.667.225 £        | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 99        | 1.399.078                      | 0,17                 |
| <i>Abgesicherte Klassen JPY</i>   |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 26.457.671 ¥  | 168.356 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                         | 1         | 258                            | 0,00                 |
| 935.010 US\$  | 141.869.257 ¥       | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 5         | 30.882                         | 0,01                 |
| 193.669 US\$  | 28.292.337 ¥        | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 1         | 13.363                         | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>   |                     |                  |                                |           |                                |                      |
| 71 US\$   | 96 SGD              | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | 1                              | 0,00                 |
| 93.951 US\$   | 126.175 SGD         | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 2         | 1.409                          | 0,00                 |
| 998 US\$  | 1.297 SGD           | 16.01.2025       | UBS AG                         | 2         | 47                             | 0,00                 |
| 859.259 US\$  | 1.148.965 SGD       | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 22        | 16.560                         | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                                |           | <b>25.462.747</b>              | <b>3,16</b>          |

### Futures-Kontrakte 2,32 % (31. Dezember 2023: 1,13 %)

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung  | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|------------------|---|--------------------------------|----------------------|
| 16               | 10-Year Mini Japanese Government Bond Future March 2025 | 514                            | 0,00                 |
| 421              | 3 Month CORRA Future December 2025                      | 109.190                        | 0,01                 |
| 2.000            | 3 Month CORRA Future June 2025                          | 516.244                        | 0,07                 |
| 19               | 3 Month CORRA Future June 2026                          | 791                            | 0,00                 |
| 94               | 3 Month CORRA Future March 2025                         | 17.192                         | 0,00                 |
| 95               | 3 Month CORRA Future March 2026                         | 19.764                         | 0,00                 |
| 67               | 3 Month CORRA Future September 2025                     | 13.533                         | 0,00                 |
| 42               | 3 Month SOFR Future December 2025                       | 23.613                         | 0,00                 |
| (60)             | 3 Month SOFR Future December 2026                       | 19.612                         | 0,00                 |
| 1.912            | 3 Month SOFR Future June 2025                           | 79.616                         | 0,01                 |
| (68)             | 3 Month SOFR Future June 2026                           | 15.187                         | 0,00                 |
| (52)             | 3 Month SOFR Future June 2027                           | 19.337                         | 0,00                 |
| 97               | 3 Month SOFR Future March 2025                          | 11.519                         | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Futures-Kontrakte 2,32 % (31. Dezember 2023: 1,13 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung   | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|------------------|--|--------------------------------|----------------------|
| (1.739)          | 3 Month SOFR Future March 2026                       | 339.320                        | 0,04                 |
| (56)             | 3 Month SOFR Future March 2027                       | 20.137                         | 0,00                 |
| (1.233)          | 3 Month SOFR Future September 2025                   | 271.418                        | 0,04                 |
| (41)             | 3 Month SOFR Future September 2026                   | 6.925                          | 0,00                 |
| (48)             | 3 Month SOFR Future September 2027                   | 20.900                         | 0,00                 |
| (48)             | 3 Month SOFR Future September 2028                   | 25.300                         | 0,00                 |
| (665)            | 3 Month SONIA Future June 2025                       | 407.084                        | 0,06                 |
| (248)            | 3 Month SONIA Future March 2026                      | 16.146                         | 0,00                 |
| (102)            | 3 Month SONIA Future September 2025                  | 23.772                         | 0,00                 |
| (1)              | 3-Month Euro EURIBOR Future December 2025            | 65                             | 0,00                 |
| (2.157)          | 3-Month Euro EURIBOR Future March 2025               | 217.036                        | 0,03                 |
| 277              | 90-Day Bank Bill Future December 2025                | 42.715                         | 0,01                 |
| 436              | 90-Day Bank Bill Future June 2025                    | 49.474                         | 0,01                 |
| 443              | 90-Day Bank Bill Future March 2025                   | 112.994                        | 0,02                 |
| 11               | 90-Day Bank Bill Future March 2026                   | 660                            | 0,00                 |
| 702              | 90-Day Bank Bill Future September 2025               | 77.527                         | 0,01                 |
| (1.435)          | Australian Dollar Currency Future March 2025         | 1.405.884                      | 0,18                 |
| 735              | Australian Government Bond 10-Year Future March 2025 | 673.389                        | 0,08                 |
| (254)            | BIST 30 Index Future February 2025                   | 17.619                         | 0,00                 |
| (8)              | Brazil Real Currency Future January 2025             | 535                            | 0,00                 |
| (46)             | British Pound Currency Future March 2025             | 64.148                         | 0,01                 |
| 536              | Canadian 10-Year Bond Future March 2025              | 175.163                        | 0,02                 |
| 2                | Canadian 5-Year Bond Future March 2025               | 299                            | 0,00                 |
| (811)            | CBOE VIX Index Future January 2025                   | 716.972                        | 0,09                 |
| 2                | CBOE VIX Index Future June 2025                      | 0                              | 0,00                 |
| 3                | Chinese Yuan Renminbi Currency Future March 2025     | 2.572                          | 0,00                 |
| (110)            | DAX Index Future March 2025                          | 55.580                         | 0,01                 |
| (1)              | DJIA Mini E-CBOT Future March 2025                   | 1.113                          | 0,00                 |
| 71               | Dollar Index Future March 2025                       | 126.321                        | 0,02                 |
| (15)             | E-Micro EUR/USD Currency Future March 2025           | 2.531                          | 0,00                 |
| (4)              | E-mini Euro Future March 2025                        | 2.531                          | 0,00                 |
| (5)              | E-mini Health Care Future March 2025                 | 4.260                          | 0,00                 |
| (2)              | E-mini Materials Future March 2025                   | 1.370                          | 0,00                 |
| (4)              | E-mini Russell 2000 Index Future March 2025          | 22.753                         | 0,00                 |
| (803)            | Euro FX Currency Future March 2025                   | 1.738.031                      | 0,22                 |
| (314)            | EURO STOXX 50 Future March 2025                      | 80.490                         | 0,01                 |
| 342              | EURO STOXX Bank Index Future March 2025              | 3.905                          | 0,00                 |
| 1                | Euro/Japanese Yen Currency Future March 2025         | 2.466                          | 0,00                 |
| (4)              | Euro/Pound Sterling Currency Future March 2025       | 23                             | 0,00                 |
| 22               | Euro-BTP Future January 2025                         | 2.700                          | 0,00                 |
| (188)            | Euro-BTP Future March 2025                           | 482.616                        | 0,06                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

**Futures-Kontrakte 2,32 % (31. Dezember 2023: 1,13 %) (Fortsetzung)**

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung  | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|------------------|---|--------------------------------|----------------------|
| (530)            | Euro-Bund Future March 2025   | 251.854                        | 0,03                 |
| (36)             | Euro-OAT Future March 2025  | 8.201                          | 0,00                 |
| (109)            | Euro-Schatz Future March 2025   | 4.173                          | 0,00                 |
| (6)              | FSC Nifty 50 Index Future January 2025  | 3.667                          | 0,00                 |
| (22)             | FTSE/JSE Top 40 Index Future March 2025   | 23.377                         | 0,00                 |
| 54               | FTSE/MIB Index Future March 2025  | 17.283                         | 0,00                 |
| (81)             | Hang Seng China Enterprises Index Call Option on Future January 2025, Strike Price HKD 7,700.00 | 244                            | 0,00                 |
| (55)             | Hang Seng China Enterprises Index Call Option on Future January 2025, Strike Price HKD 7,900.00 | 444                            | 0,00                 |
| (108)            | Hang Seng China Enterprises Index Put Option on Future January 2025, Strike Price HKD 7,100.00  | 67.012                         | 0,01                 |
| (54)             | Hang Seng China Enterprises Index Put Option on Future January 2025, Strike Price HKD 7,200.00  | 42.770                         | 0,01                 |
| (81)             | Hang Seng Index Put Option on Future January 2025, Strike Price HKD 19,800.00                   | 131.437                        | 0,01                 |
| (36)             | Hang Seng Index Call Option on Future January 2025, Strike Price HKD 20,600.00                  | 3.374                          | 0,01                 |
| (18)             | Hang Seng Index Call Option on Future January 2025, Strike Price HKD 20,800.00                  | 5.397                          | 0,00                 |
| (18)             | Hang Seng Index Call Option on Future January 2025, Strike Price HKD 21,400.00                  | 657                            | 0,00                 |
| 34               | IBEX 35 Index Future January 2025   | 97                             | 0,00                 |
| 9                | IBEX 35 Mini Index Future February 2025   | 1.311                          | 0,00                 |
| (3)              | Indian Rupee Currency Future January 2025   | 935                            | 0,00                 |
| (15)             | Indian Rupee Currency Future January 2025   | 1.766                          | 0,00                 |
| (95)             | Japan Government 10-Year Bond (OSE) Future March 2025   | 339.797                        | 0,04                 |
| (445)            | Japanese Yen Currency Future March 2025   | 21.081                         | 0,00                 |
| 2                | JPX-Nikkei Index 400 Futures March 2025   | 617                            | 0,00                 |
| 1                | Long Swiss Confederation Bond Future March 2025   | 353                            | 0,00                 |
| (34)             | Mexican Peso Currency Future March 2025   | 16.320                         | 0,00                 |
| 54               | Mini- TOPIX Index Future March 2025   | 14.476                         | 0,00                 |
| (11)             | MSCI EAFE Index Future March 2025   | 3.875                          | 0,00                 |
| (9)              | MSCI Emerging Markets Index Future March 2025   | 7.602                          | 0,00                 |
| (29)             | Nasdaq 100 E-mini Future March 2025   | 88.661                         | 0,01                 |
| (1.562)          | New Zealand Dollar Currency Future March 2025   | 2.245.324                      | 0,28                 |
| 194              | Nikkei 225 Mini Future March 2025   | 33.533                         | 0,01                 |
| 8                | Norwegian Krone Currency Future March 2025  | 20.100                         | 0,00                 |
| (7)              | OMXS30 Index Future January 2025  | 378                            | 0,00                 |
| (50)             | S&P 500 E-mini Call Option on Future March 2025, Strike Price \$6,200.00                        | 21.250                         | 0,00                 |
| (62)             | S&P 500 E-mini Future March 2025  | 428.695                        | 0,05                 |
| 125              | SK Hynix Inc January 2025   | 1.458                          | 0,00                 |
| 464              | SPI 200 Index Future March 2025   | 193.144                        | 0,02                 |
| (2)              | STOXX Europe 600 Index Future March 2025  | 207                            | 0,00                 |
| (16)             | STOXX Europe 600 Insurance Future March 2025  | 10.272                         | 0,00                 |
| 7                | STOXX Europe 600 Utilities March 2025   | 1.652                          | 0,00                 |
| 4                | Swedish Krona Currency Future March 2025  | 4.511                          | 0,00                 |
| (313)            | Swiss Franc Currency Future March 2025  | 737.809                        | 0,09                 |
| 25               | TOPIX Index Future March 2025   | 22.970                         | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Futures-Kontrakte 2,32 % (31. Dezember 2023: 1,13 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte  | Beschreibung   | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|--|--------------------------------|----------------------|
| (506)   | United Kingdom Long Gilt Future March 2025   | 634.946                        | 0,08                 |
| 2   | United States Dollar/Chinese Yuan Renminbi Currency Future March 2025              | 1.308                          | 0,00                 |
| (2.460)   | US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2025                                   | 3.703.881                      | 0,46                 |
| (290)   | US Treasury 10-Year Note Put Option on Future February 2025, Strike Price \$107.50 | 38.203                         | 0,01                 |
| (875)   | US Treasury 2-Year Note (CBT) Future March 2025                                    | 371.591                        | 0,04                 |
| (7)   | US Treasury 3-Year Note (CBT) Future March 2025                                    | 3.352                          | 0,00                 |
| (111)   | US Treasury 5-Year Note (CBT) Future March 2025                                    | 40.891                         | 0,01                 |
| (352)   | US Treasury Long Bond (CBT) Future March 2025                                      | 441.132                        | 0,06                 |
| (146)   | US Treasury Ultra 10-Year Future March 2025  | 229.250                        | 0,03                 |
| (78)  | US Treasury Ultra Bond (CBT) Future March 2025                                     | 263.937                        | 0,03                 |
| (54)  | WIG 20 Index Future March 2045   | 17.589                         | 0,00                 |
| (73)  | Yen Denominated Nikkei Future March 2025   | 162.259                        | 0,02                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten *</b> |  | <b>18.747.279</b>              | <b>2,32</b>          |

### Verkaufte Optionskontrakte 12,07 % (31. Dezember 2023: 17,42 %)

| Anzahl Kontrakte/<br>Nominalwert | Fälligkeit | Art  | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|----------------------------------|------------|--|---------------|----------------------|
| <b>Kaufoptionen</b>              |            |  |               |                      |
| 13                               | 17.01.2025 | AbbVie Inc, Strike Price \$180.00 ±              | 2.814         | 0,00                 |
| 11                               | 17.01.2025 | AbbVie Inc, Strike Price \$195.00 ±              | 121           | 0,00                 |
| 2.200.000 EUR                    | 15.08.2025 | Absolute Dispersion Basket, Strike Price 20% ∞   | 15.819        | 0,00                 |
| 53.892                           | 15.08.2025 | Akamai Technologies Inc, Strike Price \$104.07 ∞ | 421.694       | 0,05                 |
| 125.000                          | 15.08.2025 | Akamai Technologies Inc, Strike Price \$150.00 ∞ | 84.898        | 0,01                 |
| 668                              | 15.08.2025 | Akamai Technologies Inc, Strike Price \$95.00 ±  | 778.220       | 0,10                 |
| 30                               | 17.01.2025 | Apple Inc, Strike Price \$190.00 ±               | 183.225       | 0,02                 |
| 26                               | 17.01.2025 | Apple Inc, Strike Price \$205.00 ±               | 120.120       | 0,02                 |
| 184                              | 17.01.2025 | Apple Inc, Strike Price \$250.00 ±               | 85.100        | 0,01                 |
| 15                               | 17.01.2025 | ArcBest Corp, Strike Price \$130.00 ±            | 787           | 0,00                 |
| 13                               | 17.01.2025 | ArcBest Corp, Strike Price \$140.00 ±            | 0             | 0,00                 |
| 7                                | 17.01.2025 | Autodesk Inc, Strike Price \$280.00 ±            | 12.530        | 0,00                 |
| 6                                | 17.01.2025 | Autodesk Inc, Strike Price \$310.00 ±            | 885           | 0,00                 |
| 7                                | 17.01.2025 | Axon Enterprise Inc, Strike Price \$280.00 ±     | 220.500       | 0,03                 |
| 6                                | 17.01.2025 | Axon Enterprise Inc, Strike Price \$300.00 ±     | 176.880       | 0,02                 |
| 62                               | 17.01.2025 | Best Buy Co Inc, Strike Price \$82.50 ±          | 25.420        | 0,00                 |
| 52                               | 17.01.2025 | Best Buy Co Inc, Strike Price \$90.00 ±          | 3.848         | 0,00                 |
| 77                               | 17.01.2025 | Boston Scientific Corp, Strike Price \$75.00 ±   | 115.885       | 0,02                 |
| 67                               | 17.01.2025 | Boston Scientific Corp, Strike Price \$80.00 ±   | 60.635        | 0,01                 |
| 27                               | 17.01.2025 | Boyd Gaming Corp, Strike Price \$70.00 ±         | 11.205        | 0,00                 |
| 23                               | 17.01.2025 | Boyd Gaming Corp, Strike Price \$75.00 ±         | 1.150         | 0,00                 |
| 47                               | 17.01.2025 | Boyd Gaming Corp, Strike Price \$80.00 ±         | 470           | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 12,07 % (31. Dezember 2023: 17,42 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/<br>Nominalwert   | Fälligkeit | Art  | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|------------------------------------|------------|--|------------------|------------------------------|
| <b>Kaufsoptionen (Fortsetzung)</b> |            |  |                  |                              |
| 59                                 | 17.01.2025 | Bunge Global SA, Strike Price \$105.00 ±           | 236              | 0,00                         |
| 49                                 | 17.01.2025 | Bunge Global SA, Strike Price \$115.00 ±           | 294              | 0,00                         |
| 41                                 | 17.01.2025 | Bunge Global SA, Strike Price \$125.00 ±           | 205              | 0,00                         |
| 38                                 | 17.01.2025 | Callon Petroleum Co, Strike Price \$38.00 ±        | 0                | 0,00                         |
| 33                                 | 17.01.2025 | Callon Petroleum Co, Strike Price \$40.00 ±        | 0                | 0,00                         |
| 18                                 | 17.01.2025 | Cardinal Health Inc, Strike Price \$115.00 ±       | 9.180            | 0,00                         |
| 15                                 | 17.01.2025 | Cardinal Health Inc, Strike Price \$125.00 ±       | 337              | 0,00                         |
| 43                                 | 17.01.2025 | CarMax Inc, Strike Price \$90.00 ±                 | 645              | 0,00                         |
| 37                                 | 17.01.2025 | CarMax Inc, Strike Price \$97.50 ±                 | 647              | 0,00                         |
| 26                                 | 17.01.2025 | Charles Schwab Corp, Strike Price \$70.00 ±        | 11.895           | 0,00                         |
| 21                                 | 17.01.2025 | Charles Schwab Corp, Strike Price \$77.50 ±        | 850              | 0,00                         |
| 106                                | 17.01.2025 | Chemours Co, Strike Price \$35.00 ±                | 0                | 0,00                         |
| 95                                 | 17.01.2025 | Chemours Co, Strike Price \$37.00 ±                | 475              | 0,00                         |
| 150                                | 17.01.2025 | Chipotle Mexican Grill Inc, Strike Price \$50.00 ± | 158.250          | 0,02                         |
| 100                                | 17.01.2025 | Chipotle Mexican Grill Inc, Strike Price \$54.00 ± | 66.500           | 0,01                         |
| 85                                 | 17.01.2025 | Cleveland-Cliffs Inc, Strike Price \$20.00 ±       | 85               | 0,00                         |
| 71                                 | 17.01.2025 | Cleveland-Cliffs Inc, Strike Price \$22.00 ±       | 213              | 0,00                         |
| 55                                 | 17.01.2025 | Cleveland-Cliffs Inc, Strike Price \$25.00 ±       | 55               | 0,00                         |
| 117.000                            | 20.11.2026 | Confluent Inc, Strike Price \$138.02 ∞             | 24.421           | 0,00                         |
| 117.000                            | 18.12.2026 | Confluent Inc, Strike Price \$138.02 ∞             | 27.370           | 0,00                         |
| 116.000                            | 15.01.2027 | Confluent Inc, Strike Price \$138.02 ∞             | 57.945           | 0,01                         |
| 900                                | 20.06.2025 | Confluent Inc, Strike Price \$30.00 ±              | 360.000          | 0,05                         |
| 500                                | 17.01.2025 | Confluent Inc, Strike Price \$45.00 ±              | 1.500            | 0,00                         |
| 11.700                             | 20.11.2026 | Confluent Inc, Strike Price \$76.14 ∞              | 16.823           | 0,00                         |
| 11.700                             | 18.12.2026 | Confluent Inc, Strike Price \$76.28 ∞              | 17.992           | 0,00                         |
| 11.600                             | 15.01.2027 | Confluent Inc, Strike Price \$76.41 ∞              | 22.052           | 0,00                         |
| 60.469                             | 15.01.2027 | Conmed Corp, Strike Price \$110.88 ∞               | 416.507          | 0,05                         |
| 10.078                             | 19.01.2027 | Conmed Corp, Strike Price \$110.88 ∞               | 69.882           | 0,01                         |
| 210.000                            | 15.01.2027 | Conmed Corp, Strike Price \$249.05 ∞               | 147.005          | 0,02                         |
| 1.104                              | 16.05.2025 | Conmed Corp, Strike Price \$80.00 ±                | 394.680          | 0,05                         |
| 48                                 | 17.01.2025 | ConocoPhillips, Strike Price \$130.00 ±            | 192              | 0,00                         |
| 38                                 | 17.01.2025 | ConocoPhillips, Strike Price \$145.00 ±            | 152              | 0,00                         |
| 34                                 | 17.01.2025 | ConocoPhillips, Strike Price \$155.00 ±            | 0                | 0,00                         |
| 20                                 | 17.01.2025 | Constellation Brands Inc, Strike Price \$280.00 ±  | 1.000            | 0,00                         |
| 17                                 | 17.01.2025 | Constellation Brands Inc, Strike Price \$310.00 ±  | 0                | 0,00                         |
| 160                                | 17.01.2025 | Coming Inc, Strike Price \$35.00 ±                 | 202.400          | 0,03                         |
| 144                                | 17.01.2025 | Coming Inc, Strike Price \$37.00 ±                 | 153.360          | 0,02                         |
| 62                                 | 17.01.2025 | Coterra Energy Inc, Strike Price \$27.00 ±         | 1.085            | 0,00                         |
| 50                                 | 17.01.2025 | Coterra Energy Inc, Strike Price \$30.00 ±         | 250              | 0,00                         |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 12,07 % (31. Dezember 2023: 17,42 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/<br>Nominalwert   | Fälligkeit | Art  | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|------------------------------------|------------|--|------------------|------------------------------|
| <b>Kaufsoptionen (Fortsetzung)</b> |            |  |                  |                              |
| 162                                | 17.01.2025 | CSX Corp, Strike Price \$37.50 <sup>±</sup>  | 486              | 0,00                         |
| 126                                | 17.01.2025 | CSX Corp, Strike Price \$42.50 <sup>±</sup>  | 630              | 0,00                         |
| 130.000.000 JPY                    | 16.11.2029 | Cybag, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 170bps. <sup>∞</sup>   | 87.670           | 0,01                         |
| 35                                 | 17.01.2025 | Darden Restaurants Inc, Strike Price \$170.00 <sup>±</sup>   | 61.425           | 0,01                         |
| 29                                 | 17.01.2025 | Darden Restaurants Inc, Strike Price \$185.00 <sup>±</sup>   | 12.760           | 0,00                         |
| 2.173.493                          | 21.03.2025 | Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR21.13 <sup>∞</sup>  | 17.873.144       | 2,22                         |
| 2.173.493                          | 21.03.2025 | Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR21.97 <sup>∞</sup>  | 16.000.761       | 1,98                         |
| 33                                 | 17.01.2025 | Devon Energy Corp, Strike Price \$47.50 <sup>±</sup>   | 33               | 0,00                         |
| 27                                 | 17.01.2025 | Devon Energy Corp, Strike Price \$52.50 <sup>±</sup>   | 54               | 0,00                         |
| 91                                 | 17.01.2025 | Devon Energy Corp, Strike Price \$57.50 <sup>±</sup>   | 91               | 0,00                         |
| 77                                 | 17.01.2025 | Devon Energy Corp, Strike Price \$62.50 <sup>±</sup>   | 154              | 0,00                         |
| 24                                 | 17.01.2025 | Diamondback Energy Inc, Strike Price \$222.78 <sup>±</sup>   | 264              | 0,00                         |
| 19                                 | 17.01.2025 | Diamondback Energy Inc, Strike Price \$242.78 <sup>±</sup>   | 0                | 0,00                         |
| 125.000 EUR                        | 21.03.2025 | Dual digital option: EURO STOXX 50 Index and EUR/USD spot rate, Down and In, Strike Price 4,690.53 and 1.07 <sup>∞</sup> | 26.410           | 0,00                         |
| 500.000 EUR                        | 17.01.2025 | Dual digital option: EURO STOXX 50 Index and EUR/USD spot rate, Down and In, Strike Price 4,500.00 and 1.02 <sup>∞</sup> | 3.269            | 0,00                         |
| 600.000 USD                        | 21.03.2025 | Dual digital option: S&P 500 Index and EUR/USD spot rate, Down and In, Strike Price 5,741.50 and 1.03 <sup>∞</sup>       | 51.506           | 0,01                         |
| 300.000 USD                        | 21.02.2025 | Dual digital option: S&P 500 Index and SOFR rate, Down and In, Strike Price 5,500.00 and 4.00% <sup>∞</sup>              | 12.626           | 0,00                         |
| 1.250.000 USD                      | 21.03.2025 | Dual digital option: S&P 500 Index and SOFR rate, Down and In, Strike Price 5,500.00 and 0.41% <sup>∞</sup>              | 7.029            | 0,00                         |
| 600.000 USD                        | 21.03.2025 | Dual digital option: S&P 500 Index and USD/JPY spot rate, Down and In, Strike Price 5,741.50 and 146.05 <sup>∞</sup>     | 18.157           | 0,00                         |
| 600.000 USD                        | 21.03.2025 | Dual digital option: S&P 500 Index and USD/JPY spot rate, Down and In, Strike Price 5,620.44 and 147.27 <sup>∞</sup>     | 16.209           | 0,00                         |
| 12                                 | 19.12.2025 | Dynatrace Inc, Strike Price \$55.00 <sup>±</sup>   | 9.120            | 0,00                         |
| 30                                 | 17.01.2025 | EOG Resources Inc, Strike Price \$158.50 <sup>±</sup>  | 300              | 0,00                         |
| 77                                 | 17.01.2025 | EQT Corp, Strike Price \$40.00 <sup>±</sup>  | 44.660           | 0,01                         |
| 67                                 | 17.01.2025 | EQT Corp, Strike Price \$43.00 <sup>±</sup>  | 17.185           | 0,00                         |
| 180                                | 17.01.2025 | EURO STOXX 50 Index, Strike Price EUR4,850.00 <sup>±</sup>   | 129.914          | 0,02                         |
| 270                                | 17.01.2025 | EURO STOXX 50 Index, Strike Price EUR4,875.00 <sup>±</sup>   | 154.890          | 0,02                         |
| 599                                | 17.01.2025 | EURO STOXX 50 Index, Strike Price EUR5,000.00 <sup>±</sup>   | 75.672           | 0,01                         |
| 9                                  | 17.01.2025 | FedEx Corp, Strike Price \$270.00 <sup>±</sup>   | 12.150           | 0,00                         |
| 15                                 | 17.01.2025 | FedEx Corp, Strike Price \$280.00 <sup>±</sup>   | 9.787            | 0,00                         |
| 22                                 | 17.01.2025 | FedEx Corp, Strike Price \$300.00 <sup>±</sup>   | 1.309            | 0,00                         |
| 36                                 | 17.01.2025 | Fiserv Inc, Strike Price \$165.00 <sup>±</sup>   | 148.320          | 0,02                         |
| 30                                 | 17.01.2025 | Fiserv Inc, Strike Price \$180.00 <sup>±</sup>   | 79.050           | 0,01                         |
| 69                                 | 17.01.2025 | Freeport-McMoRan Inc, Strike Price \$45.00 <sup>±</sup>  | 172              | 0,00                         |
| 66                                 | 17.01.2025 | Freeport-McMoRan Inc, Strike Price \$47.00 <sup>±</sup>  | 132              | 0,00                         |
| 125                                | 17.12.2027 | FTSE 100 Index, Strike Price GBP8,800.00 <sup>±</sup>  | 1.077.847        | 0,13                         |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 12,07 % (31. Dezember 2023: 17,42 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/<br>Nominalwert   | Fälligkeit | Art   | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|------------------------------------|------------|---|------------------|------------------------------|
| <b>Kaufsoptionen (Fortsetzung)</b> |            |   |                  |                              |
| 800.000.000 JPY                    | 08.06.2026 | GMO Payment Gateway Inc, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 70bps. <sup>∞</sup> | 0                | 0,00                         |
| 41                                 | 17.01.2025 | Halliburton Co, Strike Price \$40.00 <sup>±</sup>   | 41               | 0,00                         |
| 32                                 | 17.01.2025 | Halliburton Co, Strike Price \$45.00 <sup>±</sup>   | 160              | 0,00                         |
| 45                                 | 17.01.2025 | Hershey Co, Strike Price \$220.00 <sup>±</sup>  | 900              | 0,00                         |
| 67                                 | 17.01.2025 | HF Sinclair, Strike Price \$55.00 <sup>±</sup>  | 670              | 0,00                         |
| 29                                 | 17.01.2025 | HF Sinclair, Strike Price \$60.00 <sup>±</sup>  | 58               | 0,00                         |
| 48                                 | 17.01.2025 | HF Sinclair, Strike Price \$65.00 <sup>±</sup>  | 960              | 0,00                         |
| 21                                 | 17.01.2025 | HF Sinclair, Strike Price \$70.00 <sup>±</sup>  | 0                | 0,00                         |
| 26                                 | 17.01.2025 | Hilton Worldwide Holdings Inc, Strike Price \$220.00 <sup>±</sup>                                       | 73.580           | 0,01                         |
| 22                                 | 17.01.2025 | Hilton Worldwide Holdings Inc, Strike Price \$240.00 <sup>±</sup>                                       | 22.770           | 0,00                         |
| 30.000.000 JPY                     | 21.12.2029 | Hosiden Corp, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 100bps. <sup>∞</sup>           | 26.304           | 0,00                         |
| 66                                 | 17.01.2025 | HP Inc, Strike Price \$32.00 <sup>±</sup>   | 7.722            | 0,00                         |
| 50                                 | 17.01.2025 | HP Inc, Strike Price \$37.00 <sup>±</sup>   | 175              | 0,00                         |
| 50.000.000 JPY                     | 30.03.2029 | Infroneer Holdings Inc, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 140bps. <sup>∞</sup>           | 15.234           | 0,00                         |
| 150.000.000 JPY                    | 30.03.2029 | Infroneer Holdings Inc, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 160bps. <sup>∞</sup>           | 53.703           | 0,01                         |
| 10.659                             | 17.07.2026 | Insulet Corp, Strike Price \$321.48 <sup>∞</sup>  | 341.115          | 0,04                         |
| 50.000                             | 17.07.2026 | Insulet Corp, Strike Price \$335.00 <sup>∞</sup>  | 1.413.628        | 0,18                         |
| 135                                | 17.01.2025 | Intel Corp, Strike Price \$25.00 <sup>±</sup>   | 473              | 0,00                         |
| 100.000.000 JPY                    | 28.09.2028 | JAFCO Group Co Ltd, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 167bps. <sup>∞</sup>               | 151.756          | 0,02                         |
| 350.000.000 JPY                    | 28.09.2028 | JFE Holdings Inc, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 90bps. <sup>∞</sup>                  | 44.479           | 0,01                         |
| 50.000.000 JPY                     | 12.03.2029 | Kansai, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 69bps. <sup>∞</sup>                  | 34.196           | 0,01                         |
| 40.000.000 JPY                     | 12.03.2029 | Kansai, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 142bps. <sup>∞</sup>                           | 26.825           | 0,00                         |
| 55                                 | 09.01.2025 | KOSPI 200 Index, Strike Price KRW342.50 <sup>±</sup>  | 654              | 0,00                         |
| 157                                | 17.01.2025 | Kraft Heinz Co, Strike Price \$40.00 <sup>±</sup>   | 471              | 0,00                         |
| 138                                | 17.01.2025 | Kraft Heinz Co, Strike Price \$42.50 <sup>±</sup>   | 138              | 0,00                         |
| 12.952                             | 15.12.2028 | Live Nation Entertainment Inc, Strike Price \$101.56 <sup>∞</sup>                                       | 752.673          | 0,09                         |
| 280                                | 17.01.2025 | Live Nation Entertainment Inc, Strike Price \$105.00 <sup>±</sup>                                       | 711.200          | 0,09                         |
| 80.000                             | 15.12.2028 | Live Nation Entertainment Inc, Strike Price \$145.00 <sup>∞</sup>                                       | 3.015.545        | 0,37                         |
| 11                                 | 17.01.2025 | Lowe's Companies Inc, Strike Price \$240.00 <sup>±</sup>  | 10.285           | 0,00                         |
| 10                                 | 17.01.2025 | Lowe's Companies Inc, Strike Price \$260.00 <sup>±</sup>  | 595              | 0,00                         |
| 21                                 | 17.01.2025 | LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$105.00 <sup>±</sup>  | 105              | 0,00                         |
| 51                                 | 17.01.2025 | LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$110.00 <sup>±</sup>  | 255              | 0,00                         |
| 18                                 | 17.01.2025 | LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$115.00 <sup>±</sup>  | 90               | 0,00                         |
| 44                                 | 17.01.2025 | LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$120.00 <sup>±</sup>  | 220              | 0,00                         |
| 12                                 | 17.01.2025 | Mastercard Inc, Strike Price \$500.00 <sup>±</sup>  | 34.260           | 0,01                         |
| 9                                  | 17.01.2025 | Mastercard Inc, Strike Price \$560.00 <sup>±</sup>  | 329              | 0,00                         |
| 530.000.000 JPY                    | 29.01.2025 | Menicon Co Ltd, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 50bps. <sup>∞</sup>          | 0                | 0,00                         |
| 5                                  | 17.01.2025 | Meta Platforms Inc, Strike Price \$440.00 <sup>±</sup>  | 73.600           | 0,01                         |
| 4                                  | 17.01.2025 | Meta Platforms Inc, Strike Price \$480.00 <sup>±</sup>  | 43.010           | 0,01                         |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 12,07 % (31. Dezember 2023: 17,42 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/<br>Nominalwert   | Fälligkeit | Art   | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|------------------------------------|------------|---|------------------|------------------------------|
| <b>Kaufsoptionen (Fortsetzung)</b> |            |   |                  |                              |
| 606                                | 18.07.2025 | Middleby Corp, Strike Price \$130.00 ±  | 1.069.242        | 0,14                         |
| 45.713                             | 18.07.2025 | Middleby Corp, Strike Price \$150.83 ∞  | 352.711          | 0,04                         |
| 112.500                            | 18.07.2025 | Middleby Corp, Strike Price \$210.00 ∞  | 61.676           | 0,01                         |
| 18                                 | 17.01.2025 | Morgan Stanley, Strike Price \$105.00 ±                                       | 38.250           | 0,01                         |
| 21                                 | 17.01.2025 | Morgan Stanley, Strike Price \$95.00 ±  | 65.205           | 0,01                         |
| 4                                  | 17.01.2025 | Netflix Inc, Strike Price \$620.00 ±  | 109.370          | 0,01                         |
| 4                                  | 17.01.2025 | Netflix Inc, Strike Price \$680.00 ±  | 85.480           | 0,01                         |
| 27                                 | 17.01.2025 | Netflix Inc, Strike Price \$900.00 ±  | 46.575           | 0,01                         |
| 9                                  | 10.01.2025 | Nikkei 225 Index, Strike Price JPY40,500.00 ±                                 | 10.594           | 0,00                         |
| 9                                  | 10.01.2025 | Nikkei 225 Index, Strike Price JPY43,000.00 ±                                 | 172              | 0,00                         |
| 70.000.000 JPY                     | 12.12.2028 | Nikkon, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 130bps. ∞            | 60.031           | 0,01                         |
| 29                                 | 17.01.2025 | NRG Energy Inc, Strike Price \$60.00 ±  | 87.580           | 0,01                         |
| 26                                 | 17.01.2025 | NRG Energy Inc, Strike Price \$65.00 ±  | 65.260           | 0,01                         |
| 11                                 | 17.01.2025 | Nucor Corp, Strike Price \$190.00 ±   | 44               | 0,00                         |
| 9                                  | 17.01.2025 | Nucor Corp, Strike Price \$210.00 ±   | 9                | 0,00                         |
| 8                                  | 17.01.2025 | Nucor Corp, Strike Price \$230.00 ±   | 0                | 0,00                         |
| 104                                | 17.01.2025 | NVIDIA Corp, Strike Price \$140.00 ±  | 29.588           | 0,00                         |
| 72                                 | 17.01.2025 | ONEOK Inc, Strike Price \$85.00 ±   | 112.680          | 0,01                         |
| 58                                 | 17.01.2025 | ONEOK Inc, Strike Price \$95.00 ±   | 34.800           | 0,01                         |
| 50.000.000 JPY                     | 14.12.2028 | OSG Corp, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 60bps. ∞ | 27.838           | 0,00                         |
| 98                                 | 17.01.2025 | PG&E Corp, Strike Price \$20.00 ±   | 4.802            | 0,00                         |
| 82                                 | 17.01.2025 | PG&E Corp, Strike Price \$22.00 ±   | 82               | 0,00                         |
| 20                                 | 17.01.2025 | Prudential Financial Inc, Strike Price \$115.00 ±                             | 10.300           | 0,00                         |
| 15                                 | 17.01.2025 | Prudential Financial Inc, Strike Price \$125.00 ±                             | 525              | 0,00                         |
| 94                                 | 17.01.2025 | Range Resources Corp, Strike Price \$32.00 ±                                  | 40.890           | 0,01                         |
| 39                                 | 17.01.2025 | Range Resources Corp, Strike Price \$35.00 ±                                  | 6.337            | 0,00                         |
| 36                                 | 17.01.2025 | Range Resources Corp, Strike Price \$37.00 ±                                  | 2.160            | 0,00                         |
| 39                                 | 17.01.2025 | Ross Stores Inc, Strike Price \$145.00 ±                                      | 29.055           | 0,00                         |
| 13                                 | 17.01.2025 | Ross Stores Inc, Strike Price \$155.00 ±                                      | 1.950            | 0,00                         |
| 33                                 | 17.01.2025 | Ross Stores Inc, Strike Price \$160.00 ±                                      | 1.238            | 0,00                         |
| 11                                 | 17.01.2025 | Ross Stores Inc, Strike Price \$170.00 ±                                      | 55               | 0,00                         |
| 135                                | 31.01.2025 | S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$6,080.00 ±                              | 194.063          | 0,02                         |
| 91                                 | 21.02.2025 | S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$6,100.00 ±                              | 196.788          | 0,03                         |
| 23                                 | 17.01.2025 | S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$6,150.00 ±                              | 5.233            | 0,00                         |
| 260                                | 31.01.2025 | S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$6,150.00 ±                              | 172.250          | 0,02                         |
| 6                                  | 17.12.2027 | S&P 500 Index, Strike Price \$5,800.00 ±                                      | 644.610          | 0,08                         |
| 58.277                             | 21.01.2028 | Semtech Corp, Strike Price \$41.74 ∞  | 2.082.914        | 0,26                         |
| 400.000                            | 21.01.2028 | Semtech Corp, Strike Price \$51.00 ∞  | 12.654.462       | 1,57                         |
| 18                                 | 17.01.2025 | Skyworks Solutions Inc, Strike Price \$115.00 ±                               | 180              | 0,00                         |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 12,07 % (31. Dezember 2023: 17,42 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/<br>Nominalwert   | Fälligkeit | Art  | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|------------------------------------|------------|--|------------------|------------------------------|
| <b>Kaufsoptionen (Fortsetzung)</b> |            |  |                  |                              |
| 16                                 | 17.01.2025 | Skyworks Solutions Inc, Strike Price \$125.00 ±                                    | 0                | 0,00                         |
| 23                                 | 17.01.2025 | State Street Corp, Strike Price \$82.50 ±  | 36.800           | 0,01                         |
| 19                                 | 17.01.2025 | State Street Corp, Strike Price \$90.00 ±  | 15.675           | 0,00                         |
| 16                                 | 17.01.2025 | T Rowe Price Group Inc, Strike Price \$120.00 ±                                    | 360              | 0,00                         |
| 14                                 | 17.01.2025 | T Rowe Price Group Inc, Strike Price \$130.00 ±                                    | 42               | 0,00                         |
| 9                                  | 15.01.2025 | Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD 23,400.00 ±                          | 1.977            | 0,00                         |
| 18                                 | 15.01.2025 | Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD 23,600.00 ±                          | 2.443            | 0,00                         |
| 54                                 | 15.01.2025 | Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD 24,200.00 ±                          | 1.647            | 0,00                         |
| 55                                 | 15.01.2025 | Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD 24,600.00 ±                          | 671              | 0,00                         |
| 10                                 | 17.01.2025 | Take-Two Interactive Software Inc, Strike Price \$185.00 ±                         | 3.475            | 0,00                         |
| 9                                  | 17.01.2025 | Take-Two Interactive Software Inc, Strike Price \$200.00 ±                         | 288              | 0,00                         |
| 67                                 | 17.01.2025 | Tanger Inc, Strike Price \$30.00 ±   | 29.145           | 0,00                         |
| 50                                 | 17.01.2025 | Tanger Inc, Strike Price \$35.00 ±   | 1.500            | 0,00                         |
| 16                                 | 17.01.2025 | Targa Resources Corp, Strike Price \$105.00 ±                                      | 118.080          | 0,02                         |
| 45                                 | 17.01.2025 | Targa Resources Corp, Strike Price \$125.00 ±                                      | 241.650          | 0,03                         |
| 38                                 | 17.01.2025 | Targa Resources Corp, Strike Price \$135.00 ±                                      | 165.680          | 0,02                         |
| 19                                 | 17.01.2025 | Targa Resources Corp, Strike Price \$95.00 ±                                       | 158.840          | 0,02                         |
| 14                                 | 17.01.2025 | Thor Industries Inc, Strike Price \$125.00 ±                                       | 210              | 0,00                         |
| 13                                 | 17.01.2025 | Thor Industries Inc, Strike Price \$135.00 ±                                       | 0                | 0,00                         |
| 30.000.000 JPY                     | 29.09.2028 | Tokyu Corp, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 85bps. ∞              | 8.135            | 0,00                         |
| 74                                 | 20.06.2025 | TripAdvisor Inc, Strike Price \$20.00 ±  | 4.810            | 0,00                         |
| 28.385.000 USD                     | 15.01.2025 | United States Dollar/Chinese Yuan Renminbi Currency Option, Strike Price CNY7.15 ∞ | 751.777          | 0,09                         |
| 87.750.000 USD                     | 16.04.2025 | United States Dollar/Hong Kong Dollar Currency Option, Strike Price HKD7.77 ∞      | 133.380          | 0,02                         |
| 57.000.000 USD                     | 05.03.2026 | United States Dollar/Japanese Yen Currency Option, Strike Price JPY137.00 ∞        | 5.607.774        | 0,70                         |
| 27.975.000 USD                     | 05.03.2026 | United States Dollar/Japanese Yen Currency Option, Strike Price JPY141.50 ∞        | 2.149.123        | 0,27                         |
| 66                                 | 17.01.2025 | Unum Group, Strike Price \$52.50 ±   | 140.250          | 0,02                         |
| 56                                 | 17.01.2025 | Unum Group, Strike Price \$57.50 ±   | 93.240           | 0,01                         |
| 300                                | 24.01.2025 | US Treasury 10-Year Note Futures, Strike Price \$110.00 ±                          | 75.000           | 0,01                         |
| 100                                | 24.01.2025 | US Treasury 10-Year Note Futures, Strike Price \$110.50 ±                          | 17.188           | 0,00                         |
| 214                                | 17.01.2025 | Viatis Inc, Strike Price \$12.00 ±   | 13.910           | 0,00                         |
| 137                                | 17.01.2025 | Viatis Inc, Strike Price \$15.00 ±   | 137              | 0,00                         |
| 1.090                              | 22.01.2025 | VIX Index, Strike Price \$20.00 ±  | 113.905          | 0,01                         |
| 200                                | 19.02.2025 | VIX Index, Strike Price \$37.00 ±  | 15.200           | 0,00                         |
| 200                                | 19.02.2025 | VIX Index, Strike Price \$38.00 ±  | 14.600           | 0,00                         |
| 168                                | 18.03.2025 | VIX Index, Strike Price \$45.00 ±  | 13.020           | 0,00                         |
| 35                                 | 17.01.2025 | Western Digital Corp, Strike Price \$55.00 ±                                       | 18.200           | 0,00                         |
| 30                                 | 17.01.2025 | Western Digital Corp, Strike Price \$60.00 ±                                       | 5.865            | 0,00                         |
| 26                                 | 17.01.2025 | Western Digital Corp, Strike Price \$65.00 ±                                       | 1.313            | 0,00                         |
| 22                                 | 17.01.2025 | Western Digital Corp, Strike Price \$70.00 ±                                       | 231              | 0,00                         |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Verkaufte Optionskontrakte 12,07 % (31. Dezember 2023: 17,42 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/<br>Nominalwert   | Fälligkeit | Art  | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|------------------------------------|------------|--|------------------|------------------------------|
| <b>Kaufsoptionen (Fortsetzung)</b> |            |  |                  |                              |
| 8                                  | 17.01.2025 | Wingstop Inc, Strike Price \$300.00 ±                      | 2.840            | 0,00                         |
| 6                                  | 17.01.2025 | Wingstop Inc, Strike Price \$330.00 ±                      | 300              | 0,00                         |
| 46                                 | 17.01.2025 | Winnebago Industries Inc, Strike Price \$75.00 ±           | 0                | 0,00                         |
| 41                                 | 17.01.2025 | Winnebago Industries Inc, Strike Price \$80.00 ±           | 0                | 0,00                         |
| 21.739                             | 19.10.2029 | Wolfspeed Inc, Strike Price \$107.31 ∞                     | 66.596           | 0,01                         |
| 120.000                            | 19.10.2029 | Wolfspeed Inc, Strike Price \$200.00 ∞                     | 361.180          | 0,05                         |
| 20                                 | 17.01.2025 | Wynn Resorts Ltd, Strike Price \$105.00 ±                  | 180              | 0,00                         |
| 15                                 | 17.01.2025 | Wynn Resorts Ltd, Strike Price \$115.00 ±                  | 30               | 0,00                         |
| <b>Verkaufsoptionen</b>            |            |  |                  |                              |
| 29                                 | 17.01.2025 | AbbVie Inc, Strike Price \$115.00 ±                        | 899              | 0,00                         |
| 21                                 | 17.01.2025 | AbbVie Inc, Strike Price \$140.00 ±                        | 304              | 0,00                         |
| 16                                 | 17.01.2025 | AbbVie Inc, Strike Price \$165.00 ±                        | 632              | 0,00                         |
| 46                                 | 17.01.2025 | AbbVie Inc, Strike Price \$90.00 ±                         | 230              | 0,00                         |
| 378                                | 16.05.2025 | Akamai Technologies Inc, Strike Price \$65.00 ±            | 51.975           | 0,01                         |
| 493                                | 17.01.2025 | Akamai Technologies Inc, Strike Price \$80.00 ±            | 4.930            | 0,00                         |
| 45                                 | 20.06.2025 | Alibaba Group Holding, Strike Price \$60.00 ±              | 3.668            | 0,00                         |
| 328                                | 20.06.2025 | Alibaba Group Holding, Strike Price \$70.00 ±              | 72.980           | 0,01                         |
| 77                                 | 17.01.2025 | Apple Inc, Strike Price \$120.00 ±                         | 77               | 0,00                         |
| 52                                 | 17.01.2025 | Apple Inc, Strike Price \$145.00 ±                         | 52               | 0,00                         |
| 38                                 | 17.01.2025 | Apple Inc, Strike Price \$170.00 ±                         | 114              | 0,00                         |
| 184                                | 17.01.2025 | Apple Inc, Strike Price \$250.00 ±                         | 65.320           | 0,01                         |
| 25                                 | 17.01.2025 | ArcBest Corp, Strike Price \$100.00 ±                      | 17.625           | 0,00                         |
| 19                                 | 17.01.2025 | ArcBest Corp, Strike Price \$115.00 ±                      | 41.230           | 0,01                         |
| 55                                 | 17.01.2025 | ArcBest Corp, Strike Price \$65.00 ±                       | 0                | 0,00                         |
| 37                                 | 17.01.2025 | ArcBest Corp, Strike Price \$80.00 ±                       | 1.480            | 0,00                         |
| 23                                 | 17.01.2025 | Autodesk Inc, Strike Price \$140.00 ±                      | 0                | 0,00                         |
| 15                                 | 17.01.2025 | Autodesk Inc, Strike Price \$180.00 ±                      | 0                | 0,00                         |
| 10                                 | 17.01.2025 | Autodesk Inc, Strike Price \$220.00 ±                      | 125              | 0,00                         |
| 8                                  | 17.01.2025 | Autodesk Inc, Strike Price \$260.00 ±                      | 1.860            | 0,00                         |
| 23                                 | 17.01.2025 | Axon Enterprise Inc, Strike Price \$140.00 ±               | 0                | 0,00                         |
| 14                                 | 17.01.2025 | Axon Enterprise Inc, Strike Price \$180.00 ±               | 0                | 0,00                         |
| 11                                 | 17.01.2025 | Axon Enterprise Inc, Strike Price \$220.00 ±               | 0                | 0,00                         |
| 9                                  | 17.01.2025 | Axon Enterprise Inc, Strike Price \$250.00 ±               | 0                | 0,00                         |
| 8.000                              | 20.06.2025 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Strike Price EUR5.50 ± | 37.278           | 0,01                         |
| 30                                 | 19.09.2025 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Strike Price EUR6.00 ± | 342              | 0,00                         |
| 800                                | 19.09.2025 | Banco Santander SA, Strike Price EUR3.20 ±                 | 6.213            | 0,00                         |
| 139                                | 17.01.2025 | Best Buy Co Inc, Strike Price \$55.00 ±                    | 1.529            | 0,00                         |
| 100                                | 17.01.2025 | Best Buy Co Inc, Strike Price \$65.00 ±                    | 1.050            | 0,00                         |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 12,07 % (31. Dezember 2023: 17,42 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/<br>Nominalwert      | Fälligkeit | Art  | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|---------------------------------------|------------|--|------------------|------------------------------|
| <b>Verkaufsoptionen (Fortsetzung)</b> |            |  |                  |                              |
| 74                                    | 17.01.2025 | Best Buy Co Inc, Strike Price \$75.00 ±            | 851              | 0,00                         |
| 195                                   | 17.01.2025 | Boston Scientific Corp, Strike Price \$47.00 ±     | 0                | 0,00                         |
| 130                                   | 17.01.2025 | Boston Scientific Corp, Strike Price \$57.50 ±     | 1.690            | 0,00                         |
| 94                                    | 17.01.2025 | Boston Scientific Corp, Strike Price \$67.50 ±     | 0                | 0,00                         |
| 100                                   | 17.01.2025 | Boyd Gaming Corp, Strike Price \$35.00 ±           | 0                | 0,00                         |
| 207                                   | 17.01.2025 | Boyd Gaming Corp, Strike Price \$45.00 ±           | 0                | 0,00                         |
| 137                                   | 17.01.2025 | Boyd Gaming Corp, Strike Price \$55.00 ±           | 0                | 0,00                         |
| 36                                    | 17.01.2025 | Boyd Gaming Corp, Strike Price \$60.00 ±           | 1.368            | 0,00                         |
| 70                                    | 17.01.2025 | Boyd Gaming Corp, Strike Price \$65.00 ±           | 875              | 0,00                         |
| 124                                   | 17.01.2025 | Bunge Global SA, Strike Price \$72.50 ±            | 4.030            | 0,00                         |
| 85                                    | 17.01.2025 | Bunge Global SA, Strike Price \$87.50 ±            | 83.300           | 0,01                         |
| 133                                   | 17.01.2025 | Callon Petroleum Co, Strike Price \$20.00 ±        | 798              | 0,00                         |
| 101                                   | 17.01.2025 | Callon Petroleum Co, Strike Price \$23.00 ±        | 4.747            | 0,00                         |
| 70                                    | 17.01.2025 | Callon Petroleum Co, Strike Price \$28.00 ±        | 28.490           | 0,00                         |
| 51                                    | 17.01.2025 | Callon Petroleum Co, Strike Price \$33.00 ±        | 42.458           | 0,01                         |
| 21                                    | 17.01.2025 | Cardinal Health Inc, Strike Price \$105.00 ±       | 21               | 0,00                         |
| 67                                    | 17.01.2025 | Cardinal Health Inc, Strike Price \$57.50 ±        | 0                | 0,00                         |
| 41                                    | 17.01.2025 | Cardinal Health Inc, Strike Price \$75.00 ±        | 0                | 0,00                         |
| 28                                    | 17.01.2025 | Cardinal Health Inc, Strike Price \$90.00 ±        | 588              | 0,00                         |
| 101                                   | 17.01.2025 | CarMax Inc, Strike Price \$57.50 ±                 | 505              | 0,00                         |
| 68                                    | 17.01.2025 | CarMax Inc, Strike Price \$70.00 ±                 | 680              | 0,00                         |
| 53                                    | 17.01.2025 | CarMax Inc, Strike Price \$80.00 ±                 | 6.360            | 0,00                         |
| 572                                   | 17.04.2025 | Carnival Corp, Strike Price \$11.00 ±              | 2.288            | 0,00                         |
| 1.575                                 | 17.04.2025 | Carnival Corp, Strike Price \$13.00 ±              | 40.950           | 0,01                         |
| 7                                     | 02.01.2025 | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$5,800.00 ±      | 1.155            | 0,00                         |
| 99                                    | 17.01.2025 | Charles Schwab Corp, Strike Price \$35.00 ±        | 396              | 0,00                         |
| 137                                   | 17.01.2025 | Charles Schwab Corp, Strike Price \$42.50 ±        | 0                | 0,00                         |
| 61                                    | 17.01.2025 | Charles Schwab Corp, Strike Price \$45.00 ±        | 610              | 0,00                         |
| 100                                   | 17.01.2025 | Charles Schwab Corp, Strike Price \$50.00 ±        | 650              | 0,00                         |
| 41                                    | 17.01.2025 | Charles Schwab Corp, Strike Price \$55.00 ±        | 266              | 0,00                         |
| 70                                    | 17.01.2025 | Charles Schwab Corp, Strike Price \$60.00 ±        | 525              | 0,00                         |
| 29                                    | 17.01.2025 | Charles Schwab Corp, Strike Price \$65.00 ±        | 333              | 0,00                         |
| 300                                   | 17.01.2025 | Chipotle Mexican Grill Inc, Strike Price \$24.80 ± | 0                | 0,00                         |
| 150                                   | 17.01.2025 | Chipotle Mexican Grill Inc, Strike Price \$31.60 ± | 0                | 0,00                         |
| 200                                   | 17.01.2025 | Chipotle Mexican Grill Inc, Strike Price \$38.20 ± | 0                | 0,00                         |
| 150                                   | 17.01.2025 | Chipotle Mexican Grill Inc, Strike Price \$45.00 ± | 1.500            | 0,00                         |
| 341                                   | 17.01.2025 | Cleveland-Cliffs Inc, Strike Price \$10.00 ±       | 27.792           | 0,00                         |
| 151                                   | 17.01.2025 | Cleveland-Cliffs Inc, Strike Price \$15.00 ±       | 84.560           | 0,01                         |
| 119                                   | 17.01.2025 | Cleveland-Cliffs Inc, Strike Price \$17.00 ±       | 90.440           | 0,01                         |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Verkaufte Optionskontrakte 12,07 % (31. Dezember 2023: 17,42 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/<br>Nominalwert      | Fälligkeit | Art   | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|---------------------------------------|------------|---|------------------|------------------------------|
| <b>Verkaufsoptionen (Fortsetzung)</b> |            |   |                  |                              |
| 444                                   | 20.06.2025 | Commerzbank AG, Strike Price EUR10.00 ±           | 7.586            | 0,00                         |
| 67                                    | 17.01.2025 | ConocoPhillips, Strike Price \$110.00 ±           | 76.883           | 0,01                         |
| 100                                   | 17.01.2025 | ConocoPhillips, Strike Price \$90.00 ±            | 2.550            | 0,00                         |
| 50                                    | 17.01.2025 | Constellation Brands Inc, Strike Price \$180.00 ± | 1.625            | 0,00                         |
| 34                                    | 17.01.2025 | Constellation Brands Inc, Strike Price \$220.00 ± | 13.430           | 0,00                         |
| 24                                    | 17.01.2025 | Constellation Brands Inc, Strike Price \$260.00 ± | 95.040           | 0,01                         |
| 371                                   | 17.01.2025 | Corning Inc, Strike Price \$23.00 ±               | 0                | 0,00                         |
| 250                                   | 17.01.2025 | Corning Inc, Strike Price \$28.00 ±               | 0                | 0,00                         |
| 192                                   | 17.01.2025 | Corning Inc, Strike Price \$32.00 ±               | 0                | 0,00                         |
| 197                                   | 17.01.2025 | Coterra Energy Inc, Strike Price \$15.00 ±        | 0                | 0,00                         |
| 137                                   | 17.01.2025 | Coterra Energy Inc, Strike Price \$18.00 ±        | 1.096            | 0,00                         |
| 85                                    | 17.01.2025 | Coterra Energy Inc, Strike Price \$23.00 ±        | 850              | 0,00                         |
| 71                                    | 17.01.2025 | Coterra Energy Inc, Strike Price \$25.00 ±        | 2.485            | 0,00                         |
| 9.827                                 | 19.12.2025 | Crédit Agricole SA, Strike Price EUR8.00 ±        | 167.902          | 0,02                         |
| 600                                   | 19.09.2025 | Crédit Agricole SA, Strike Price EUR9.00 ±        | 10.562           | 0,00                         |
| 366                                   | 17.01.2025 | CSX Corp, Strike Price \$25.00 ±                  | 1.464            | 0,00                         |
| 255                                   | 17.01.2025 | CSX Corp, Strike Price \$30.00 ±                  | 2.550            | 0,00                         |
| 187                                   | 17.01.2025 | CSX Corp, Strike Price \$35.00 ±                  | 50.958           | 0,01                         |
| 83                                    | 17.01.2025 | Darden Restaurants Inc, Strike Price \$110.00 ±   | 0                | 0,00                         |
| 60                                    | 17.01.2025 | Darden Restaurants Inc, Strike Price \$130.00 ±   | 1.320            | 0,00                         |
| 41                                    | 17.01.2025 | Darden Restaurants Inc, Strike Price \$155.00 ±   | 615              | 0,00                         |
| 202                                   | 19.09.2025 | Davide Campari-Milano NV, Strike Price EUR4.20 ±  | 26.983           | 0,00                         |
| 840                                   | 19.06.2025 | Davide Campari-Milano NV, Strike Price EUR4.80 ±  | 63.062           | 0,01                         |
| 326                                   | 20.06.2025 | Deutsche Bank AG, Strike Price EUR9.00 ±          | 1.688            | 0,00                         |
| 1.395.000                             | 21.03.2025 | Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR15.50 ∞      | 2.973            | 0,00                         |
| 113                                   | 17.01.2025 | Devon Energy Corp, Strike Price \$25.00 ±         | 339              | 0,00                         |
| 79                                    | 17.01.2025 | Devon Energy Corp, Strike Price \$30.00 ±         | 948              | 0,00                         |
| 266                                   | 17.01.2025 | Devon Energy Corp, Strike Price \$37.50 ±         | 111.720          | 0,01                         |
| 40                                    | 17.01.2025 | Devon Energy Corp, Strike Price \$42.50 ±         | 35.800           | 0,01                         |
| 149                                   | 17.01.2025 | Devon Energy Corp, Strike Price \$45.00 ±         | 183.643          | 0,02                         |
| 59                                    | 17.01.2025 | Diamondback Energy Inc, Strike Price \$140.63 ±   | 2.360            | 0,00                         |
| 40                                    | 17.01.2025 | Diamondback Energy Inc, Strike Price \$170.63 ±   | 32.400           | 0,00                         |
| 28                                    | 17.01.2025 | Diamondback Energy Inc, Strike Price \$202.78 ±   | 108.780          | 0,01                         |
| 61                                    | 17.01.2025 | EOG Resources Inc, Strike Price \$112.50 ±        | 1.678            | 0,00                         |
| 91                                    | 17.01.2025 | EOG Resources Inc, Strike Price \$92.50 ±         | 0                | 0,00                         |
| 304                                   | 17.01.2025 | EQT Corp, Strike Price \$20.00 ±                  | 0                | 0,00                         |
| 195                                   | 17.01.2025 | EQT Corp, Strike Price \$25.00 ±                  | 0                | 0,00                         |
| 137                                   | 17.01.2025 | EQT Corp, Strike Price \$30.00 ±                  | 753              | 0,00                         |
| 101                                   | 17.01.2025 | EQT Corp, Strike Price \$35.00 ±                  | 909              | 0,00                         |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 12,07 % (31. Dezember 2023: 17,42 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/<br>Nominalwert      | Fälligkeit | Art  | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|---------------------------------------|------------|--|------------------|------------------------------|
| <b>Verkaufsoptionen (Fortsetzung)</b> |            |  |                  |                              |
| 752                                   | 19.12.2025 | Erste Group Bank AG, Strike Price EUR36.00 ±           | 38.935           | 0,01                         |
| 371                                   | 17.01.2025 | EURO STOXX 50 Index, Strike Price EUR4,650.00 ±        | 44.564           | 0,01                         |
| 451                                   | 17.01.2025 | EURO STOXX 50 Index, Strike Price EUR4,850.00 ±        | 242.845          | 0,03                         |
| 928                                   | 17.01.2025 | EURO STOXX 50 Index, Strike Price EUR4,900.00 ±        | 724.552          | 0,09                         |
| 497                                   | 17.01.2025 | EURO STOXX 50 Index, Strike Price EUR5,000.00 ±        | 743.145          | 0,09                         |
| 29                                    | 17.01.2025 | FedEx Corp, Strike Price \$135.00 ±                    | 1.885            | 0,00                         |
| 55                                    | 17.01.2025 | FedEx Corp, Strike Price \$175.00 ±                    | 165              | 0,00                         |
| 13                                    | 17.01.2025 | FedEx Corp, Strike Price \$210.00 ±                    | 65               | 0,00                         |
| 24                                    | 17.01.2025 | FedEx Corp, Strike Price \$220.00 ±                    | 408              | 0,00                         |
| 28                                    | 17.01.2025 | FedEx Corp, Strike Price \$250.00 ±                    | 770              | 0,00                         |
| 90                                    | 17.01.2025 | Fiserv Inc, Strike Price \$105.00 ±                    | 0                | 0,00                         |
| 63                                    | 17.01.2025 | Fiserv Inc, Strike Price \$125.00 ±                    | 0                | 0,00                         |
| 44                                    | 17.01.2025 | Fiserv Inc, Strike Price \$150.00 ±                    | 0                | 0,00                         |
| 260                                   | 17.01.2025 | Freeport-McMoRan Inc, Strike Price \$23.00 ±           | 520              | 0,00                         |
| 176                                   | 17.01.2025 | Freeport-McMoRan Inc, Strike Price \$28.00 ±           | 1.584            | 0,00                         |
| 113                                   | 17.01.2025 | Freeport-McMoRan Inc, Strike Price \$35.00 ±           | 2.429            | 0,00                         |
| 88                                    | 17.01.2025 | Freeport-McMoRan Inc, Strike Price \$40.00 ±           | 20.504           | 0,00                         |
| 125                                   | 17.12.2027 | FTSE 100 Index, Strike Price GBP8,800.00 ±             | 1.491.921        | 0,19                         |
| 157                                   | 17.01.2025 | Halliburton Co, Strike Price \$20.00 ±                 | 863              | 0,00                         |
| 100                                   | 17.01.2025 | Halliburton Co, Strike Price \$25.00 ±                 | 850              | 0,00                         |
| 61                                    | 17.01.2025 | Halliburton Co, Strike Price \$32.00 ±                 | 34.007           | 0,00                         |
| 47                                    | 17.01.2025 | Halliburton Co, Strike Price \$37.00 ±                 | 45.942           | 0,01                         |
| 219                                   | 17.01.2025 | HF Sinclair, Strike Price \$30.00 ±                    | 2.737            | 0,00                         |
| 127                                   | 17.01.2025 | HF Sinclair, Strike Price \$40.00 ±                    | 64.770           | 0,01                         |
| 51                                    | 17.01.2025 | HF Sinclair, Strike Price \$45.00 ±                    | 51.255           | 0,01                         |
| 39                                    | 17.01.2025 | HF Sinclair, Strike Price \$50.00 ±                    | 55.770           | 0,01                         |
| 60                                    | 17.01.2025 | Hilton Worldwide Holdings Inc, Strike Price \$145.00 ± | 0                | 0,00                         |
| 41                                    | 17.01.2025 | Hilton Worldwide Holdings Inc, Strike Price \$175.00 ± | 0                | 0,00                         |
| 31                                    | 17.01.2025 | Hilton Worldwide Holdings Inc, Strike Price \$200.00 ± | 682              | 0,00                         |
| 204                                   | 17.01.2025 | HP Inc, Strike Price \$15.00 ±                         | 0                | 0,00                         |
| 165                                   | 17.01.2025 | HP Inc, Strike Price \$20.00 ±                         | 0                | 0,00                         |
| 105                                   | 17.01.2025 | HP Inc, Strike Price \$25.00 ±                         | 1.050            | 0,00                         |
| 75                                    | 17.01.2025 | HP Inc, Strike Price \$30.00 ±                         | 750              | 0,00                         |
| 413                                   | 19.12.2025 | HSBC Holdings Plc, Strike Price GBP480.00 ±            | 25.862           | 0,00                         |
| 42                                    | 17.01.2025 | Insulet Corp, Strike Price \$150.00 ±                  | 210              | 0,00                         |
| 123                                   | 18.07.2025 | Insulet Corp, Strike Price \$160.00 ±                  | 32.595           | 0,00                         |
| 5                                     | 20.06.2025 | Insulet Corp, Strike Price \$165.00 ±                  | 1.250            | 0,00                         |
| 1.760                                 | 19.06.2026 | Intesa Sanpaolo SpA, Strike Price EUR2.60 ±            | 210.496          | 0,03                         |
| 87                                    | 19.09.2025 | KBC Group NV, Strike Price EUR50.00 ±                  | 5.766            | 0,00                         |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 12,07 % (31. Dezember 2023: 17,42 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/<br>Nominalwert      | Fälligkeit | Art   | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|---------------------------------------|------------|---|------------------|------------------------------|
| <b>Verkaufsoptionen (Fortsetzung)</b> |            |   |                  |                              |
| 368                                   | 19.12.2025 | KBC Group NV, Strike Price EUR50.00 ±                     | 40.012           | 0,01                         |
| 27                                    | 09.01.2025 | KOSPI 200 Index, Strike Price KRW302.50 ±                 | 2.889            | 0,00                         |
| 868                                   | 09.01.2025 | KOSPI 200 Index, Strike Price KRW327.50 ±                 | 1.469.612        | 0,18                         |
| 401                                   | 17.01.2025 | Kraft Heinz Co, Strike Price \$25.00 ±                    | 1.203            | 0,00                         |
| 278                                   | 17.01.2025 | Kraft Heinz Co, Strike Price \$30.00 ±                    | 6.116            | 0,00                         |
| 178                                   | 17.01.2025 | Kraft Heinz Co, Strike Price \$37.50 ±                    | 121.040          | 0,02                         |
| 341                                   | 17.04.2025 | Live Nation Entertainment Inc, Strike Price \$65.00 ±     | 6.138            | 0,00                         |
| 614                                   | 17.01.2025 | Live Nation Entertainment Inc, Strike Price \$70.00 ±     | 0                | 0,00                         |
| 378                                   | 17.04.2025 | Live Nation Entertainment Inc, Strike Price \$80.00 ±     | 11.340           | 0,00                         |
| 37                                    | 17.01.2025 | Lowe's Companies Inc, Strike Price \$120.00 ±             | 0                | 0,00                         |
| 25                                    | 17.01.2025 | Lowe's Companies Inc, Strike Price \$150.00 ±             | 25               | 0,00                         |
| 17                                    | 17.01.2025 | Lowe's Companies Inc, Strike Price \$185.00 ±             | 0                | 0,00                         |
| 12                                    | 17.01.2025 | Lowe's Companies Inc, Strike Price \$220.00 ±             | 282              | 0,00                         |
| 62                                    | 17.01.2025 | LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$100.00 ±     | 159.960          | 0,02                         |
| 85                                    | 17.01.2025 | LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$50.00 ±      | 0                | 0,00                         |
| 51                                    | 17.01.2025 | LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$65.00 ±      | 255              | 0,00                         |
| 128                                   | 17.01.2025 | LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$70.00 ±      | 3.200            | 0,00                         |
| 34                                    | 17.01.2025 | LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$80.00 ±      | 19.380           | 0,00                         |
| 86                                    | 17.01.2025 | LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$85.00 ±      | 92.450           | 0,01                         |
| 24                                    | 17.01.2025 | LyondellBasell Industries NV, Strike Price \$95.00 ±      | 49.680           | 0,01                         |
| 29                                    | 17.01.2025 | Mastercard Inc, Strike Price \$320.00 ±                   | 290              | 0,00                         |
| 20                                    | 17.01.2025 | Mastercard Inc, Strike Price \$390.00 ±                   | 550              | 0,00                         |
| 14                                    | 17.01.2025 | Mastercard Inc, Strike Price \$460.00 ±                   | 336              | 0,00                         |
| 16                                    | 17.01.2025 | Meta Platforms Inc, Strike Price \$220.00 ±               | 16               | 0,00                         |
| 10                                    | 17.01.2025 | Meta Platforms Inc, Strike Price \$280.00 ±               | 20               | 0,00                         |
| 8                                     | 17.01.2025 | Meta Platforms Inc, Strike Price \$340.00 ±               | 16               | 0,00                         |
| 6                                     | 17.01.2025 | Meta Platforms Inc, Strike Price \$400.00 ±               | 72               | 0,00                         |
| 99                                    | 17.01.2025 | Middleby Corp, Strike Price \$100.00 ±                    | 0                | 0,00                         |
| 500                                   | 17.01.2025 | Middleby Corp, Strike Price \$110.00 ±                    | 12.500           | 0,00                         |
| 100                                   | 21.03.2025 | Middleby Corp, Strike Price \$95.00 ±                     | 9.250            | 0,00                         |
| 70                                    | 17.01.2025 | Morgan Stanley, Strike Price \$50.00 ±                    | 140              | 0,00                         |
| 49                                    | 17.01.2025 | Morgan Stanley, Strike Price \$60.00 ±                    | 122              | 0,00                         |
| 32                                    | 17.01.2025 | Morgan Stanley, Strike Price \$75.00 ±                    | 32               | 0,00                         |
| 24                                    | 17.01.2025 | Morgan Stanley, Strike Price \$87.50 ±                    | 108              | 0,00                         |
| 45                                    | 17.01.2025 | Nasdaq 100 E-mini Future, Strike Price \$21,500.00 ±      | 429.750          | 0,05                         |
| 617.072                               | 18.09.2025 | National Storage Affiliates Trust, Strike Price AUD1.69 ∞ | 4.627            | 0,00                         |
| 32                                    | 17.01.2025 | Netflix Inc, Strike Price \$310.00 ±                      | 0                | 0,00                         |
| 14                                    | 17.01.2025 | Netflix Inc, Strike Price \$380.00 ±                      | 77               | 0,00                         |
| 8                                     | 17.01.2025 | Netflix Inc, Strike Price \$400.00 ±                      | 8                | 0,00                         |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 12,07 % (31. Dezember 2023: 17,42 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/<br>Nominalwert      | Fälligkeit | Art   | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|---------------------------------------|------------|---|------------------|------------------------------|
| <b>Verkaufsoptionen (Fortsetzung)</b> |            |   |                  |                              |
| 11                                    | 17.01.2025 | Netflix Inc, Strike Price \$440.00 ±              | 264              | 0,00                         |
| 6                                     | 17.01.2025 | Netflix Inc, Strike Price \$480.00 ±              | 18               | 0,00                         |
| 6                                     | 17.01.2025 | Netflix Inc, Strike Price \$570.00 ±              | 27               | 0,00                         |
| 27                                    | 17.01.2025 | Netflix Inc, Strike Price \$900.00 ±              | 64.395           | 0,01                         |
| 18                                    | 10.01.2025 | Nikkei 225 Index, Strike Price JPY38,500.00 ±     | 12.026           | 0,00                         |
| 180                                   | 10.01.2025 | Nikkei 225 Index, Strike Price JPY40,000.00 ±     | 555.485          | 0,07                         |
| 113                                   | 17.01.2025 | NRG Energy Inc, Strike Price \$30.00 ±            | 0                | 0,00                         |
| 71                                    | 17.01.2025 | NRG Energy Inc, Strike Price \$38.00 ±            | 0                | 0,00                         |
| 51                                    | 17.01.2025 | NRG Energy Inc, Strike Price \$45.00 ±            | 255              | 0,00                         |
| 34                                    | 17.01.2025 | NRG Energy Inc, Strike Price \$55.00 ±            | 340              | 0,00                         |
| 31                                    | 17.01.2025 | Nucor Corp, Strike Price \$105.00 ±               | 1.163            | 0,00                         |
| 21                                    | 17.01.2025 | Nucor Corp, Strike Price \$130.00 ±               | 28.350           | 0,00                         |
| 14                                    | 17.01.2025 | Nucor Corp, Strike Price \$160.00 ±               | 60.340           | 0,01                         |
| 104                                   | 17.01.2025 | NVIDIA Corp, Strike Price \$140.00 ±              | 85.020           | 0,01                         |
| 172                                   | 17.01.2025 | ONEOK Inc, Strike Price \$55.00 ±                 | 0                | 0,00                         |
| 123                                   | 17.01.2025 | ONEOK Inc, Strike Price \$65.00 ±                 | 0                | 0,00                         |
| 86                                    | 17.01.2025 | ONEOK Inc, Strike Price \$77.50 ±                 | 0                | 0,00                         |
| 387                                   | 17.01.2025 | PG&E Corp, Strike Price \$10.00 ±                 | 0                | 0,00                         |
| 873                                   | 17.01.2025 | PG&E Corp, Strike Price \$12.00 ±                 | 0                | 0,00                         |
| 559                                   | 17.01.2025 | PG&E Corp, Strike Price \$15.00 ±                 | 0                | 0,00                         |
| 435                                   | 17.01.2025 | PG&E Corp, Strike Price \$17.00 ±                 | 870              | 0,00                         |
| 23                                    | 17.01.2025 | Prudential Financial Inc, Strike Price \$105.00 ± | 460              | 0,00                         |
| 77                                    | 17.01.2025 | Prudential Financial Inc, Strike Price \$55.00 ±  | 0                | 0,00                         |
| 44                                    | 17.01.2025 | Prudential Financial Inc, Strike Price \$72.50 ±  | 0                | 0,00                         |
| 31                                    | 17.01.2025 | Prudential Financial Inc, Strike Price \$87.50 ±  | 155              | 0,00                         |
| 210                                   | 17.01.2025 | Range Resources Corp, Strike Price \$15.00 ±      | 0                | 0,00                         |
| 150                                   | 17.01.2025 | Range Resources Corp, Strike Price \$18.00 ±      | 0                | 0,00                         |
| 240                                   | 17.01.2025 | Range Resources Corp, Strike Price \$20.00 ±      | 0                | 0,00                         |
| 155                                   | 17.01.2025 | Range Resources Corp, Strike Price \$25.00 ±      | 0                | 0,00                         |
| 107                                   | 17.01.2025 | Range Resources Corp, Strike Price \$30.00 ±      | 1.070            | 0,00                         |
| 29                                    | 17.01.2025 | Ross Stores Inc, Strike Price \$100.00 ±          | 0                | 0,00                         |
| 62                                    | 17.01.2025 | Ross Stores Inc, Strike Price \$115.00 ±          | 0                | 0,00                         |
| 21                                    | 17.01.2025 | Ross Stores Inc, Strike Price \$120.00 ±          | 231              | 0,00                         |
| 46                                    | 17.01.2025 | Ross Stores Inc, Strike Price \$135.00 ±          | 920              | 0,00                         |
| 15                                    | 17.01.2025 | Ross Stores Inc, Strike Price \$140.00 ±          | 1.275            | 0,00                         |
| 46                                    | 17.01.2025 | Ross Stores Inc, Strike Price \$80.00 ±           | 0                | 0,00                         |
| 92                                    | 17.01.2025 | Ross Stores Inc, Strike Price \$95.00 ±           | 0                | 0,00                         |
| 54                                    | 17.01.2025 | S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,750.00 ±  | 4.185            | 0,00                         |
| 49                                    | 21.02.2025 | S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,750.00 ±  | 17.150           | 0,00                         |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Verkaufte Optionskontrakte 12,07 % (31. Dezember 2023: 17,42 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/<br>Nominalwert      | Fälligkeit | Art  | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|---------------------------------------|------------|--|------------------|------------------------------|
| <b>Verkaufsoptionen (Fortsetzung)</b> |            |  |                  |                              |
| 29                                    | 17.01.2025 | S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,850.00 ±           | 2.465            | 0,00                         |
| 19                                    | 21.03.2025 | S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,850.00 ±           | 14.488           | 0,00                         |
| 19                                    | 17.01.2025 | S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$4,875.00 ±           | 1.615            | 0,00                         |
| 130                                   | 17.01.2025 | S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$5,700.00 ±           | 97.500           | 0,01                         |
| 261                                   | 21.03.2025 | S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$5,900.00 ±           | 1.807.425        | 0,22                         |
| 4                                     | 31.01.2025 | S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$5,950.00 ±           | 20.100           | 0,00                         |
| 118                                   | 31.01.2025 | S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$6,000.00 ±           | 730.125          | 0,09                         |
| 246                                   | 31.01.2025 | S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$6,050.00 ±           | 1.872.675        | 0,23                         |
| 225                                   | 31.01.2025 | S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$6,080.00 ±           | 1.937.813        | 0,24                         |
| 227                                   | 31.01.2025 | S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$6,100.00 ±           | 2.119.613        | 0,26                         |
| 91                                    | 21.02.2025 | S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$6,100.00 ±           | 938.438          | 0,12                         |
| 157                                   | 31.01.2025 | S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$6,150.00 ±           | 1.778.025        | 0,22                         |
| 6                                     | 17.12.2027 | S&P 500 Index, Strike Price \$5,800.00 ±                   | 246.780          | 0,03                         |
| 275                                   | 20.06.2025 | Seagate Technology Holdings Plc, Strike Price \$70.00 ±    | 56.375           | 0,01                         |
| 92                                    | 21.03.2025 | Semtech Corp, Strike Price \$32.00 ±                       | 3.680            | 0,00                         |
| 3.925                                 | 17.01.2025 | Sibanye Stillwater Ltd, Strike Price \$2.50 ±              | 11.775           | 0,00                         |
| 21                                    | 17.01.2025 | Skyworks Solutions Inc, Strike Price \$105.00 ±            | 34.125           | 0,00                         |
| 61                                    | 17.01.2025 | Skyworks Solutions Inc, Strike Price \$60.00 ±             | 305              | 0,00                         |
| 38                                    | 17.01.2025 | Skyworks Solutions Inc, Strike Price \$75.00 ±             | 570              | 0,00                         |
| 28                                    | 17.01.2025 | Skyworks Solutions Inc, Strike Price \$90.00 ±             | 8.330            | 0,00                         |
| 2.223                                 | 19.12.2025 | Société Générale SA, Strike Price EUR18.00 ±               | 133.511          | 0,02                         |
| 88                                    | 17.01.2025 | State Street Corp, Strike Price \$40.00 ±                  | 0                | 0,00                         |
| 56                                    | 17.01.2025 | State Street Corp, Strike Price \$50.00 ±                  | 0                | 0,00                         |
| 37                                    | 17.01.2025 | State Street Corp, Strike Price \$62.50 ±                  | 0                | 0,00                         |
| 26                                    | 17.01.2025 | State Street Corp, Strike Price \$75.00 ±                  | 130              | 0,00                         |
| 19                                    | 17.01.2025 | T Rowe Price Group Inc, Strike Price \$110.00 ±            | 1.757            | 0,00                         |
| 61                                    | 17.01.2025 | T Rowe Price Group Inc, Strike Price \$60.00 ±             | 0                | 0,00                         |
| 122                                   | 17.01.2025 | T Rowe Price Group Inc, Strike Price \$75.00 ±             | 0                | 0,00                         |
| 76                                    | 17.01.2025 | T Rowe Price Group Inc, Strike Price \$95.00 ±             | 760              | 0,00                         |
| 18                                    | 15.01.2025 | Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD22,200.00 ±   | 1.894            | 0,00                         |
| 54                                    | 15.01.2025 | Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD22,300.00 ±   | 6.836            | 0,00                         |
| 54                                    | 15.01.2025 | Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD22,400.00 ±   | 8.153            | 0,00                         |
| 24                                    | 17.01.2025 | Take-Two Interactive Software Inc, Strike Price \$115.00 ± | 0                | 0,00                         |
| 18                                    | 17.01.2025 | Take-Two Interactive Software Inc, Strike Price \$140.00 ± | 414              | 0,00                         |
| 13                                    | 17.01.2025 | Take-Two Interactive Software Inc, Strike Price \$165.00 ± | 266              | 0,00                         |
| 39                                    | 17.01.2025 | Take-Two Interactive Software Inc, Strike Price \$90.00 ±  | 0                | 0,00                         |
| 263                                   | 17.01.2025 | Tanger Inc, Strike Price \$15.00 ±                         | 0                | 0,00                         |
| 149                                   | 17.01.2025 | Tanger Inc, Strike Price \$20.00 ±                         | 0                | 0,00                         |
| 123                                   | 17.01.2025 | Tanger Inc, Strike Price \$22.00 ±                         | 0                | 0,00                         |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 12,07 % (31. Dezember 2023: 17,42 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/<br>Nominalwert      | Fälligkeit | Art  | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|---------------------------------------|------------|--|------------------|------------------------------|
| <b>Verkaufsoptionen (Fortsetzung)</b> |            |  |                  |                              |
| 82                                    | 17.01.2025 | Tanger Inc, Strike Price \$27.00 ±               | 1.230            | 0,00                         |
| 52                                    | 17.01.2025 | Targa Resources Corp, Strike Price \$115.00 ±    | 0                | 0,00                         |
| 69                                    | 17.01.2025 | Targa Resources Corp, Strike Price \$47.50 ±     | 0                | 0,00                         |
| 44                                    | 17.01.2025 | Targa Resources Corp, Strike Price \$60.00 ±     | 0                | 0,00                         |
| 31                                    | 17.01.2025 | Targa Resources Corp, Strike Price \$72.50 ±     | 0                | 0,00                         |
| 110                                   | 17.01.2025 | Targa Resources Corp, Strike Price \$80.00 ±     | 0                | 0,00                         |
| 22                                    | 17.01.2025 | Targa Resources Corp, Strike Price \$85.00 ±     | 0                | 0,00                         |
| 73                                    | 17.01.2025 | Targa Resources Corp, Strike Price \$97.50 ±     | 0                | 0,00                         |
| 15                                    | 17.01.2025 | Thor Industries Inc, Strike Price \$115.00 ±     | 29.700           | 0,00                         |
| 46                                    | 17.01.2025 | Thor Industries Inc, Strike Price \$65.00 ±      | 1.656            | 0,00                         |
| 32                                    | 17.01.2025 | Thor Industries Inc, Strike Price \$80.00 ±      | 1.280            | 0,00                         |
| 22                                    | 17.01.2025 | Thor Industries Inc, Strike Price \$95.00 ±      | 5.225            | 0,00                         |
| 1.035                                 | 19.12.2025 | UBS Group AG, Strike Price CHF18.00 ±            | 99.360           | 0,01                         |
| 148                                   | 17.01.2025 | Unum Group, Strike Price \$25.00 ±               | 0                | 0,00                         |
| 116                                   | 17.01.2025 | Unum Group, Strike Price \$27.50 ±               | 0                | 0,00                         |
| 171                                   | 17.01.2025 | Unum Group, Strike Price \$32.50 ±               | 0                | 0,00                         |
| 112                                   | 17.01.2025 | Unum Group, Strike Price \$40.00 ±               | 0                | 0,00                         |
| 80                                    | 17.01.2025 | Unum Group, Strike Price \$47.50 ±               | 0                | 0,00                         |
| 120                                   | 16.05.2025 | Ventas Inc, Strike Price \$42.50 ±               | 3.600            | 0,00                         |
| 307                                   | 17.01.2025 | Viatis Inc, Strike Price \$10.00 ±               | 1.535            | 0,00                         |
| 214                                   | 17.01.2025 | Viatis Inc, Strike Price \$12.00 ±               | 2.675            | 0,00                         |
| 625                                   | 17.01.2025 | Viatis Inc, Strike Price \$7.00 ±                | 0                | 0,00                         |
| 550                                   | 22.01.2025 | VIX Index, Strike Price \$19.00 ±                | 148.225          | 0,02                         |
| 3                                     | 21.03.2025 | Webuild SpA, Strike Price EUR1.50 ±              | 0                | 0,00                         |
| 54                                    | 20.03.2025 | Webuild SpA, Strike Price EUR1.60 ±              | 266              | 0,00                         |
| 30                                    | 21.03.2025 | Webuild SpA, Strike Price EUR1.60 ±              | 0                | 0,00                         |
| 104                                   | 17.01.2025 | WEC Energy Group Inc, Strike Price \$55.00 ±     | 0                | 0,00                         |
| 134                                   | 17.01.2025 | Western Digital Corp, Strike Price \$27.50 ±     | 0                | 0,00                         |
| 98                                    | 17.01.2025 | Western Digital Corp, Strike Price \$32.50 ±     | 0                | 0,00                         |
| 83                                    | 17.01.2025 | Western Digital Corp, Strike Price \$35.00 ±     | 0                | 0,00                         |
| 115                                   | 17.01.2025 | Western Digital Corp, Strike Price \$42.50 ±     | 3.795            | 0,00                         |
| 84                                    | 17.01.2025 | Western Digital Corp, Strike Price \$50.00 ±     | 2.142            | 0,00                         |
| 29                                    | 17.01.2025 | Western Digital Corp, Strike Price \$60.00 ±     | 6.119            | 0,00                         |
| 22                                    | 17.01.2025 | Wingstop Inc, Strike Price \$150.00 ±            | 110              | 0,00                         |
| 14                                    | 17.01.2025 | Wingstop Inc, Strike Price \$190.00 ±            | 245              | 0,00                         |
| 10                                    | 17.01.2025 | Wingstop Inc, Strike Price \$230.00 ±            | 475              | 0,00                         |
| 8                                     | 17.01.2025 | Wingstop Inc, Strike Price \$270.00 ±            | 2.880            | 0,00                         |
| 91                                    | 17.01.2025 | Winnebago Industries Inc, Strike Price \$35.00 ± | 455              | 0,00                         |
| 86                                    | 17.01.2025 | Winnebago Industries Inc, Strike Price \$40.00 ± | 1.505            | 0,00                         |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Verkaufte Optionskontrakte 12,07 % (31. Dezember 2023: 17,42 %) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/<br>Nominalwert  | Fälligkeit | Art  | Zeitwert<br>US\$  | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|---|------------|--|-------------------|------------------------------|
| <b>Verkaufsoptionen (Fortsetzung)</b>   |            |  |                   |                              |
| 56  | 17.01.2025 | Winnebago Industries Inc, Strike Price \$45.00 ± | 3.640             | 0,00                         |
| 56  | 17.01.2025 | Winnebago Industries Inc, Strike Price \$50.00 ± | 18.480            | 0,00                         |
| 37  | 17.01.2025 | Winnebago Industries Inc, Strike Price \$55.00 ± | 29.415            | 0,00                         |
| 39  | 17.01.2025 | Winnebago Industries Inc, Strike Price \$60.00 ± | 49.530            | 0,01                         |
| 27  | 17.01.2025 | Winnebago Industries Inc, Strike Price \$65.00 ± | 49.005            | 0,01                         |
| 29  | 17.01.2025 | Winnebago Industries Inc, Strike Price \$70.00 ± | 65.830            | 0,01                         |
| 1.300   | 21.03.2025 | Wolfspeed Inc, Strike Price \$6.00 ±             | 152.750           | 0,02                         |
| 70  | 17.01.2025 | Wynn Resorts Ltd, Strike Price \$52.50 ±         | 0                 | 0,00                         |
| 44  | 17.01.2025 | Wynn Resorts Ltd, Strike Price \$67.50 ±         | 132               | 0,00                         |
| 31  | 17.01.2025 | Wynn Resorts Ltd, Strike Price \$80.00 ±         | 1.178             | 0,00                         |
| 22  | 17.01.2025 | Wynn Resorts Ltd, Strike Price \$95.00 ±         | 19.965            | 0,00                         |
| 23.950  | 20.03.2025 | Xero Ltd, Strike Price AUD89.74 ∞                | 62                | 0,00                         |
| <b>Beizulegender Zeitwert aus gekauften Optionskontrakten insgesamt (Prämie: (77.301.368) US\$)</b> |            |  | <b>97.381.861</b> | <b>12,07</b>                 |

Die Gegenparteien von OTC-Optionskontrakten sind ank of America Merrill Lynch, BNP Paribas, Daiwa, Goldman Sachs International, JPMorgan Chase Bank, Morgan Stanley, Nomura International, Royal Bank of Canada und SMBC Nikko Capital Markets Ltd

### Differenzkontrakte 2,45 % (31. Dezember 2023: 6,57 %)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung         | Gegenpartei                 | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|-------------|-------------------------------|-----------------------------|--------------------------------------|------------------------------|
| 39.554      | 10X Genomics Inc Class A      | Morgan Stanley              | 9.347                                | 0,00                         |
| (96.976)    | 3M Co                         | Goldman Sachs International | 56                                   | 0,00                         |
| (800)       | AAON Inc                      | Goldman Sachs International | 4.074                                | 0,00                         |
| 62.198      | Abbott Laboratories           | Morgan Stanley              | 1.771                                | 0,00                         |
| (60)        | Abbott Laboratories           | Goldman Sachs International | 86                                   | 0,00                         |
| (32.473)    | AbbVie Inc                    | Morgan Stanley              | 2.161                                | 0,00                         |
| 157.106     | AbbVie Inc                    | Goldman Sachs International | 204                                  | 0,00                         |
| (1.598.065) | Absa Group Ltd                | Goldman Sachs International | 11.247                               | 0,00                         |
| (5.841.099) | Absa Group Ltd                | JPMorgan Chase Bank         | 45.050                               | 0,01                         |
| 3.000       | Acadia Healthcare Co Inc      | Goldman Sachs International | 4.869                                | 0,00                         |
| (100)       | Acuity Brands Inc             | Goldman Sachs International | 2.575                                | 0,00                         |
| (49.774)    | Acuity Brands Inc             | Morgan Stanley              | 14.857                               | 0,00                         |
| (6.200)     | AdaptHealth Corp              | Goldman Sachs International | 2.976                                | 0,00                         |
| 44.280      | Adobe Inc                     | JPMorgan Chase Bank         | 3.018                                | 0,00                         |
| 21.704      | Adobe Inc                     | Goldman Sachs International | 851                                  | 0,00                         |
| 35.819      | Advanced Drainage Systems Inc | Morgan Stanley              | 5.450                                | 0,00                         |
| 64.259      | Advanced Micro Devices Inc    | Morgan Stanley              | 11.312                               | 0,00                         |
| (41.776)    | Adyen NV                      | JPMorgan Chase Bank         | 1.350                                | 0,00                         |
| (42.557)    | Adyen NV                      | Goldman Sachs International | 2.028                                | 0,00                         |
| (600)       | AECOM                         | Goldman Sachs International | 2.322                                | 0,00                         |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,45 % (31. Dezember 2023: 6,57 %) (Fortsetzung)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung               | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|-------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 34.797    | AGCO Corp                           | Morgan Stanley              | 1.966                          | 0,00                 |
| 4.753     | Agilent Technologies Inc            | Goldman Sachs International | 353                            | 0,00                 |
| 65.005    | Agios Pharmaceuticals Inc           | Goldman Sachs International | 16.259                         | 0,00                 |
| 29.816    | Agios Pharmaceuticals Inc           | JPMorgan Chase Bank         | 4.646                          | 0,00                 |
| 32.794    | AGNC Investment Corp                | Morgan Stanley              | 1.751                          | 0,00                 |
| (34.729)  | AIB Group Plc                       | Goldman Sachs International | 356                            | 0,00                 |
| (300)     | Air Lease Corp                      | Goldman Sachs International | 396                            | 0,00                 |
| (50)      | Air Products & Chemicals Inc        | Goldman Sachs International | 207                            | 0,00                 |
| 26.352    | Airbnb Inc Class A                  | Morgan Stanley              | 270                            | 0,00                 |
| 106.272   | Airbnb Inc Class A                  | Goldman Sachs International | 8.495                          | 0,00                 |
| 2.659.570 | Akamai Technologies Inc             | Nomura                      | 0                              | 0,00                 |
| (600)     | Akamai Technologies Inc             | Goldman Sachs International | 981                            | 0,00                 |
| 62.150    | Akamai Technologies Inc             | Morgan Stanley              | 1.195                          | 0,00                 |
| (149.968) | Alarm.com Holdings Inc              | Morgan Stanley              | 3.837                          | 0,00                 |
| (57.561)  | Alaska Air Group Inc                | Morgan Stanley              | 26.461                         | 0,01                 |
| 49.111    | Albemarle Corp                      | Morgan Stanley              | 1.977                          | 0,00                 |
| (1.630)   | Albemarle Corp                      | Goldman Sachs International | 5.134                          | 0,00                 |
| (747.587) | Albertsons Cos Inc Class A          | Goldman Sachs International | 31.696                         | 0,01                 |
| (32.460)  | Albertsons Cos Inc Class A          | Morgan Stanley              | 514                            | 0,00                 |
| (4.704)   | Alcon Inc                           | Goldman Sachs International | 245                            | 0,00                 |
| (1.900)   | Alexandria Real Estate Equities Inc | Goldman Sachs International | 6.873                          | 0,00                 |
| (29.785)  | Alibaba Group Holding Ltd           | Morgan Stanley              | 463                            | 0,00                 |
| 1.867.930 | Alibaba Group Holding Ltd           | Nomura                      | 0                              | 0,00                 |
| 213.111   | Alimentation Couche-Tard Inc        | Goldman Sachs International | 394                            | 0,00                 |
| (109.906) | Alkermes Plc                        | Goldman Sachs International | 7.890                          | 0,00                 |
| (350.616) | Alkermes Plc                        | JPMorgan Chase Bank         | 28.142                         | 0,01                 |
| 620.744   | Allegion Plc                        | Goldman Sachs International | 37.443                         | 0,01                 |
| 40.811    | Allegro MicroSystems Inc            | Morgan Stanley              | 7.017                          | 0,00                 |
| 410.076   | Allegro.eu SA                       | Goldman Sachs International | 19.642                         | 0,00                 |
| 397.170   | Allegro.eu SA                       | JPMorgan Chase Bank         | 14.997                         | 0,00                 |
| (825)     | Allient Inc                         | Goldman Sachs International | 1.287                          | 0,00                 |
| (46.834)  | Allison Transmission Holdings Inc   | Morgan Stanley              | 20.400                         | 0,00                 |
| (10)      | Allstate Corp                       | Goldman Sachs International | 21                             | 0,00                 |
| 14.853    | Allurion Techno                     | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 465.983   | Alynlyam Pharmaceuticals Inc        | Goldman Sachs International | 55.707                         | 0,01                 |
| 35.690    | Alynlyam Pharmaceuticals Inc        | Morgan Stanley              | 2.184                          | 0,00                 |
| 128.940   | Alynlyam Pharmaceuticals Inc        | JPMorgan Chase Bank         | 7.802                          | 0,00                 |
| (1.000)   | Alpha Metallurgical Resources Inc   | Goldman Sachs International | 1.999                          | 0,00                 |
| (102.539) | Alpha Services & Holdings SA        | Morgan Stanley              | 12.400                         | 0,00                 |
| (1.100)   | Alphabet Inc Class A                | Goldman Sachs International | 3.632                          | 0,00                 |
| (102.530) | Alphabet Inc Class A                | Morgan Stanley              | 15.911                         | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,45 % (31. Dezember 2023: 6,57 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung               | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|-------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (425.121)   | Alphabet Inc Class C                | Morgan Stanley              | 53.783                         | 0,01                 |
| (600)       | Alphabet Inc Class C                | Goldman Sachs International | 2.660                          | 0,00                 |
| (443.941)   | Amazon.com Inc                      | Morgan Stanley              | 57.482                         | 0,01                 |
| (448.485)   | Amazon.com Inc                      | Goldman Sachs International | 22.031                         | 0,00                 |
| (2.710)     | Amcor Plc                           | Goldman Sachs International | 145                            | 0,00                 |
| (68.448)    | Amdocs Ltd                          | Morgan Stanley              | 631                            | 0,00                 |
| 1.600       | Amedisys Inc                        | Goldman Sachs International | 8.480                          | 0,00                 |
| 15.000      | Amentum Holdings Inc                | Goldman Sachs International | 18.390                         | 0,00                 |
| (2.200)     | Ameren Corp                         | Goldman Sachs International | 3.085                          | 0,00                 |
| (63.135)    | American Airlines Group Inc         | Morgan Stanley              | 18.473                         | 0,00                 |
| (90.881)    | American Express Co                 | Morgan Stanley              | 1.405                          | 0,00                 |
| (192.489)   | American Express Co                 | Goldman Sachs International | 6.282                          | 0,00                 |
| (30.600)    | American Express Co                 | JPMorgan Chase Bank         | 162                            | 0,00                 |
| 5.980       | American International Group Inc    | Goldman Sachs International | 3.612                          | 0,00                 |
| (600)       | American States Water Co            | Goldman Sachs International | 766                            | 0,00                 |
| (5.800)     | American Tower Corp                 | Goldman Sachs International | 54.858                         | 0,01                 |
| 38.138      | Americold Realty Trust Inc          | Morgan Stanley              | 6.294                          | 0,00                 |
| (74.932)    | Ameriprise Financial Inc            | Morgan Stanley              | 26.571                         | 0,01                 |
| (30)        | AMETEK Inc                          | Goldman Sachs International | 102                            | 0,00                 |
| 557.052     | Amgen Inc                           | Goldman Sachs International | 31.540                         | 0,01                 |
| 2.539       | Amicus Therapeutics Inc             | Goldman Sachs International | 434                            | 0,00                 |
| 39.292      | AMN Healthcare Services Inc         | Goldman Sachs International | 4.178                          | 0,00                 |
| 113.434.200 | ANA Holdings Inc                    | Nomura                      | 2.460                          | 0,00                 |
| 64.148      | Analog Devices Inc                  | Morgan Stanley              | 4.093                          | 0,00                 |
| 419.983     | Anheuser-Busch InBev SA             | Goldman Sachs International | 68.347                         | 0,01                 |
| 54.928      | Anheuser-Busch InBev SA             | JPMorgan Chase Bank         | 9.096                          | 0,00                 |
| (1.000)     | ANI Pharmaceuticals Inc             | Goldman Sachs International | 514                            | 0,00                 |
| (304.975)   | APA Corp                            | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 34.416      | Apellis Pharmaceuticals Inc         | Morgan Stanley              | 2.702                          | 0,00                 |
| (3.010)     | Apollo Global Management Inc        | Goldman Sachs International | 20.180                         | 0,00                 |
| (34.457)    | Appfolio Inc Class A                | Morgan Stanley              | 11.739                         | 0,00                 |
| 118.453     | Appfolio Inc Class A                | Goldman Sachs International | 5.177                          | 0,00                 |
| (426.670)   | Apple Inc                           | Morgan Stanley              | 81.648                         | 0,02                 |
| 1.570.562   | Apple Inc                           | Goldman Sachs International | 4.952                          | 0,00                 |
| (700)       | Applied Industrial Technologies Inc | Goldman Sachs International | 3.131                          | 0,00                 |
| (12.200)    | Arbor Realty Trust Inc              | Goldman Sachs International | 1.374                          | 0,00                 |
| (186.886)   | ARC Resources Ltd                   | JPMorgan Chase Bank         | 3.406                          | 0,00                 |
| (186.531)   | ARC Resources Ltd                   | Goldman Sachs International | 3.654                          | 0,00                 |
| (304.471)   | ArcBest Corp                        | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 150.001     | Arcellx Inc                         | Goldman Sachs International | 13.002                         | 0,00                 |
| (840.680)   | Argenx SE                           | Goldman Sachs International | 164.438                        | 0,02                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,45 % (31. Dezember 2023: 6,57 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung         | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|-------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (1.400)     | Arista Networks Inc           | Goldman Sachs International | 6.099                          | 0,00                 |
| (11.397)    | Arlo Technologies Inc         | Goldman Sachs International | 6.870                          | 0,00                 |
| (1.500)     | Armada Hoffler Properties Inc | Goldman Sachs International | 464                            | 0,00                 |
| (43.248)    | Arqit Quantum Inc             | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 56.020      | Arrowhead Pharmaceuticals Inc | Morgan Stanley              | 6.998                          | 0,00                 |
| 11.835      | Arrowhead Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs International | 13.194                         | 0,00                 |
| 19.245      | Arrowhead Pharmaceuticals Inc | JPMorgan Chase Bank         | 3.866                          | 0,00                 |
| 62.832      | Assurant Inc                  | Morgan Stanley              | 3.835                          | 0,00                 |
| (60.321)    | Assured Guaranty Ltd          | Morgan Stanley              | 9.285                          | 0,00                 |
| (5.500)     | Astrana Health Inc            | Goldman Sachs International | 9.805                          | 0,00                 |
| (571.117)   | AstraZeneca Plc               | Goldman Sachs International | 29.546                         | 0,01                 |
| (106.807)   | AstraZeneca Plc               | JPMorgan Chase Bank         | 1.148                          | 0,00                 |
| (13.500)    | AT&T Inc                      | Goldman Sachs International | 1.664                          | 0,00                 |
| (242.693)   | AT&T Inc                      | Morgan Stanley              | 21.965                         | 0,00                 |
| 35.332      | ATI Inc                       | Morgan Stanley              | 3.340                          | 0,00                 |
| 20.000      | Atlas Energy Solutions Inc    | Goldman Sachs International | 9.829                          | 0,00                 |
| (200)       | Atmos Energy Corp             | Goldman Sachs International | 117                            | 0,00                 |
| (139.623)   | Autodesk Inc                  | Morgan Stanley              | 20.623                         | 0,00                 |
| 274.539     | Autodesk Inc                  | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (230.837)   | Automatic Data Processing Inc | JPMorgan Chase Bank         | 9.257                          | 0,00                 |
| (60)        | Automatic Data Processing Inc | Goldman Sachs International | 211                            | 0,00                 |
| 1.891       | Avadel Pharmaceuticals Plc    | Goldman Sachs International | 379                            | 0,00                 |
| 62.899      | Avalonbay Communities Inc     | Morgan Stanley              | 2.682                          | 0,00                 |
| (2.100)     | AvalonBay Communities Inc     | Goldman Sachs International | 14.759                         | 0,00                 |
| 61.924      | Avantor Inc                   | Morgan Stanley              | 2.095                          | 0,00                 |
| (600)       | Avient Corp                   | Goldman Sachs International | 255                            | 0,00                 |
| (400)       | Avis Budget Group Inc         | Goldman Sachs International | 4.072                          | 0,00                 |
| (60.997)    | Aviva Plc                     | JPMorgan Chase Bank         | 2.589                          | 0,00                 |
| (273.022)   | AXA SA                        | JPMorgan Chase Bank         | 12.319                         | 0,00                 |
| (372.386)   | AXA SA                        | Goldman Sachs International | 2.862                          | 0,00                 |
| (1.500)     | Axalta Coating Systems Ltd    | Goldman Sachs International | 473                            | 0,00                 |
| (59.406)    | Axis Capital Holdings Ltd     | Morgan Stanley              | 8.149                          | 0,00                 |
| 883.443     | Axon Enterprise Inc           | Goldman Sachs International | 344                            | 0,00                 |
| (300)       | Axos Financial Inc            | Goldman Sachs International | 2.805                          | 0,00                 |
| (900)       | Azenta Inc                    | Goldman Sachs International | 1.193                          | 0,00                 |
| (1.200)     | AZZ Inc                       | Goldman Sachs International | 3.666                          | 0,00                 |
| (1.900.000) | Balder Finland OYJ            | BNP Paribas                 | 106.386                        | 0,02                 |
| 57.177      | Ball Corp                     | Morgan Stanley              | 2.560                          | 0,00                 |
| 121.489     | Baloise Holding AG            | JPMorgan Chase Bank         | 8.346                          | 0,00                 |
| (34.451)    | Banca Generali SpA            | Goldman Sachs International | 4.421                          | 0,00                 |
| (24.763)    | Banca Generali SpA            | JPMorgan Chase Bank         | 2.619                          | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,45 % (31. Dezember 2023: 6,57 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung               | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|-------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (176.188)   | Banca Mediolanum SpA                | Goldman Sachs International | 8.557                          | 0,00                 |
| (39.192)    | Banca Mediolanum SpA                | JPMorgan Chase Bank         | 3.397                          | 0,00                 |
| (137.281)   | Banca Monte dei Paschi di Siena SpA | JPMorgan Chase Bank         | 40.812                         | 0,01                 |
| (18.143)    | Banca Monte dei Paschi di Siena SpA | Goldman Sachs International | 8.440                          | 0,00                 |
| (300)       | BancFirst Corp                      | Goldman Sachs International | 3.027                          | 0,00                 |
| (210.098)   | Banco Bilbao Vizcaya Argentina SA   | Goldman Sachs International | 10.872                         | 0,00                 |
| 926.779     | Banco BTG Pactual SA                | Morgan Stanley              | 30.954                         | 0,01                 |
| 229.092     | Banco Comercial Portugues SA        | Goldman Sachs International | 22.709                         | 0,01                 |
| 49.377      | Banco Comercial Portugues SA        | JPMorgan Chase Bank         | 1.243                          | 0,00                 |
| 206.315     | Banco Santander SA                  | Goldman Sachs International | 3.771                          | 0,00                 |
| (2.600)     | Bancorp Inc                         | Goldman Sachs International | 5.486                          | 0,00                 |
| 251.114     | Bank of Hawaii Corp                 | Goldman Sachs International | 3.869                          | 0,00                 |
| (103.643)   | Bank Of Ireland Group Plc           | Goldman Sachs International | 1.800                          | 0,00                 |
| (20)        | Bank of New York Mellon Corp        | Goldman Sachs International | 24                             | 0,00                 |
| 62.241      | Bank of New York Mellon Corp        | Morgan Stanley              | 3.397                          | 0,00                 |
| 259.208     | Bankinter SA                        | Goldman Sachs International | 2.319                          | 0,00                 |
| (2.800)     | BankUnited Inc                      | Goldman Sachs International | 1.634                          | 0,00                 |
| (1.600)     | Banner Corp                         | Goldman Sachs International | 1.679                          | 0,00                 |
| (93.940)    | Barclays Plc                        | Goldman Sachs International | 18.724                         | 0,00                 |
| (324.706)   | Bath & Body Works Inc               | JPMorgan Chase Bank         | 29.615                         | 0,01                 |
| (574.073)   | Bath & Body Works Inc               | Goldman Sachs International | 131.440                        | 0,02                 |
| (59.656)    | Bath & Body Works Inc               | Morgan Stanley              | 12.787                         | 0,00                 |
| 61.018      | Baxter International Inc            | Morgan Stanley              | 7.852                          | 0,00                 |
| (20)        | Baxter International Inc            | Goldman Sachs International | 3                              | 0,00                 |
| (823.848)   | BB Seguridade Participacoes SA      | Morgan Stanley              | 4.037                          | 0,00                 |
| 47.207      | Beauty Health Co                    | Goldman Sachs International | 34.981                         | 0,01                 |
| 4.880       | Beauty Health Co                    | JPMorgan Chase Bank         | 3.830                          | 0,00                 |
| (108.142)   | Beazley Plc                         | Goldman Sachs International | 26.130                         | 0,01                 |
| (32.303)    | Beazley Plc                         | JPMorgan Chase Bank         | 3.055                          | 0,00                 |
| (107.363)   | Becton Dickinson & Co               | Morgan Stanley              | 2.410                          | 0,00                 |
| 220.056     | Becton Dickinson & Co               | Goldman Sachs International | 285                            | 0,00                 |
| (1.756.980) | BellRing Brands Inc                 | Goldman Sachs International | 840.124                        | 0,11                 |
| 60.466      | Berkshire Hathaway Inc Class B      | Morgan Stanley              | 313                            | 0,00                 |
| (3.400)     | Berkshire Hills Bancorp Inc         | Goldman Sachs International | 593                            | 0,00                 |
| 35.598      | Berry Global Group Inc              | Morgan Stanley              | 3.636                          | 0,00                 |
| 700.533     | Best Buy Co Inc                     | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (1.900)     | BILL Holdings Inc                   | Goldman Sachs International | 8.113                          | 0,00                 |
| 2.261       | Biogen Inc                          | Goldman Sachs International | 590                            | 0,00                 |
| 1.567       | Biogen Inc                          | JPMorgan Chase Bank         | 503                            | 0,00                 |
| 2.360       | BioMarin Pharmaceutical Inc         | Goldman Sachs International | 94                             | 0,00                 |
| (500)       | Bio-Rad Laboratories Inc Class A    | Goldman Sachs International | 3.136                          | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,45 % (31. Dezember 2023: 6,57 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung                 | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|---------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (810)       | Bio-Techne Corp                       | Goldman Sachs International | 911                            | 0,00                 |
| (413.570)   | Birkenstock Holding Plc               | Goldman Sachs International | 52.304                         | 0,01                 |
| (123.525)   | Birkenstock Holding Plc               | JPMorgan Chase Bank         | 6.942                          | 0,00                 |
| 86.037      | BJ's Wholesale Club Holdings Inc      | JPMorgan Chase Bank         | 6.522                          | 0,00                 |
| 255.682     | BJ's Wholesale Club Holdings Inc      | Goldman Sachs International | 17.137                         | 0,00                 |
| 30.000      | Black Stone Minerals LP               | Goldman Sachs International | 13.294                         | 0,00                 |
| (300)       | Blackbaud Inc                         | Goldman Sachs International | 1.338                          | 0,00                 |
| (920)       | Blackstone Inc                        | Goldman Sachs International | 2.347                          | 0,00                 |
| (5.800)     | Blackstone Mortgage Trust Inc Class A | Goldman Sachs International | 4.221                          | 0,00                 |
| (51.950)    | Block Inc                             | Goldman Sachs International | 17.107                         | 0,00                 |
| 46.108      | Blueprint Medicines Corp              | Goldman Sachs International | 412                            | 0,00                 |
| 39.897      | Blueprint Medicines Corp              | JPMorgan Chase Bank         | 1.702                          | 0,00                 |
| (243.124)   | BNP Paribas SA                        | Goldman Sachs International | 14.472                         | 0,00                 |
| (190)       | Boeing Co                             | Goldman Sachs International | 227                            | 0,00                 |
| (89.059)    | Booking Holdings Inc                  | Morgan Stanley              | 15.256                         | 0,00                 |
| 503.000     | Booking Holdings Inc                  | Goldman Sachs International | 6.257                          | 0,00                 |
| (1.600)     | Boot Barn Holdings Inc                | Goldman Sachs International | 3.911                          | 0,00                 |
| 62.424      | Boston Properties Inc                 | Morgan Stanley              | 4.543                          | 0,00                 |
| 1.386.729   | Boston Scientific Corp                | Goldman Sachs International | 313                            | 0,00                 |
| (2.776.405) | Boxer Retail Ltd                      | Morgan Stanley              | 28.871                         | 0,01                 |
| 941.109     | Boyd Gaming Corp                      | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (23.627)    | Brandywine Realty Trust               | Goldman Sachs International | 278                            | 0,00                 |
| 35.485      | Bright Horizons Family Solutions Inc  | Morgan Stanley              | 1.102                          | 0,00                 |
| (8.368)     | BrightSpring Health Services Inc      | JPMorgan Chase Bank         | 369                            | 0,00                 |
| 200         | Brink's Co                            | Goldman Sachs International | 155                            | 0,00                 |
| (85.883)    | Bristol-Myers Squibb Co               | Morgan Stanley              | 13.014                         | 0,00                 |
| (19.637)    | Bristol-Myers Squibb Co               | Goldman Sachs International | 5.442                          | 0,00                 |
| (82.555)    | Broadcom Inc                          | Morgan Stanley              | 54.921                         | 0,01                 |
| 67.301      | Brown-Forman Corp Class B             | Morgan Stanley              | 11.424                         | 0,00                 |
| 42.703      | Bruker Corp                           | Morgan Stanley              | 6.690                          | 0,00                 |
| 35.359      | Brunswick Corp                        | Morgan Stanley              | 6.385                          | 0,00                 |
| (1.500)     | Brunswick Corp                        | Goldman Sachs International | 3.719                          | 0,00                 |
| (20)        | Builders FirstSource Inc              | Goldman Sachs International | 108                            | 0,00                 |
| (726.226)   | Bunge Global SA                       | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (41.805)    | Burlington Stores Inc                 | JPMorgan Chase Bank         | 1.088                          | 0,00                 |
| 63.037      | Burlington Stores Inc                 | Morgan Stanley              | 544                            | 0,00                 |
| (454.281)   | Burlington Stores Inc                 | Goldman Sachs International | 38.847                         | 0,01                 |
| (42.444)    | BWX Technologies Inc                  | Morgan Stanley              | 1.712                          | 0,00                 |
| 4.500       | BXP Inc                               | Goldman Sachs International | 194                            | 0,00                 |
| (400)       | Cable One Inc                         | Goldman Sachs International | 3.761                          | 0,00                 |
| 256.798     | Cadence Bank                          | Goldman Sachs International | 24.201                         | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

**Differenzkontrakte 2,45 % (31. Dezember 2023: 6,57 %) (Fortsetzung)**

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung                        | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|--|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 34.074      | Caesars Entertainment Inc                    | Morgan Stanley              | 2.270                          | 0,00                 |
| (111.678)   | CaixaBank SA                                 | JPMorgan Chase Bank         | 2.790                          | 0,00                 |
| (75.340)    | CaixaBank SA                                 | Goldman Sachs International | 940                            | 0,00                 |
| (1.300)     | Camden Property Trust                        | Goldman Sachs International | 5.198                          | 0,00                 |
| 61.297      | Campbell Soup Co                             | Morgan Stanley              | 5.292                          | 0,00                 |
| 613.331     | Canadian National Railway Co                 | Goldman Sachs International | 24.771                         | 0,01                 |
| 489.270     | Canadian Pacific Kansas City Ltd             | Goldman Sachs International | 2.545                          | 0,00                 |
| (10)        | Capital One Financial Corp                   | Goldman Sachs International | 29                             | 0,00                 |
| (535.718)   | Capital Power Corp                           | Goldman Sachs International | 19.999                         | 0,00                 |
| (439.248)   | Capital Power Corp                           | JPMorgan Chase Bank         | 87.075                         | 0,01                 |
| (4.776.368) | Capitec Bank Holdings Ltd                    | Goldman Sachs International | 81.469                         | 0,01                 |
| (10.856)    | Capitol Federal Financial Inc                | Goldman Sachs International | 616                            | 0,00                 |
| 34.353      | Capri Holdings Ltd                           | Morgan Stanley              | 2.759                          | 0,00                 |
| (4.300)     | Capri Holdings Ltd                           | Goldman Sachs International | 3.123                          | 0,00                 |
| 241.107     | Cardinal Health Inc                          | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (96.668)    | Cardinal Health Inc                          | Morgan Stanley              | 6.295                          | 0,00                 |
| (1.900)     | CareTrust REIT Inc                           | Goldman Sachs International | 824                            | 0,00                 |
| (4.000)     | Carlyle Group Inc                            | Goldman Sachs International | 5.705                          | 0,00                 |
| (70.584)    | CarMax Inc                                   | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (5.800)     | Carnival Corp                                | Goldman Sachs International | 4.679                          | 0,00                 |
| 12.428.918  | Carnival Corp                                | Nomura                      | 1.478.950                      | 0,19                 |
| 1.348.510   | Carrier Global Corp                          | Goldman Sachs International | 125.320                        | 0,02                 |
| 50.921      | Carrier Global Corp                          | JPMorgan Chase Bank         | 5.386                          | 0,00                 |
| 119.947     | Caterpillar Inc                              | Goldman Sachs International | 5.631                          | 0,00                 |
| 116.946     | CBOE Global Markets Inc                      | Goldman Sachs International | 1.861                          | 0,00                 |
| 89.178      | CBOE Global Markets Inc                      | Morgan Stanley              | 4.614                          | 0,00                 |
| 33.283      | CCC Intelligent Solutions Holdings Inc       | Morgan Stanley              | 2.112                          | 0,00                 |
| 629         | CDW Corp                                     | JPMorgan Chase Bank         | 110                            | 0,00                 |
| 47.273      | CDW Corp                                     | Goldman Sachs International | 11.108                         | 0,00                 |
| 154.637     | CDW Corp                                     | Morgan Stanley              | 18.973                         | 0,00                 |
| 1.479       | Celldex Therapeutics Inc                     | Goldman Sachs International | 241                            | 0,00                 |
| 191.846     | Celsius Holdings Inc                         | JPMorgan Chase Bank         | 11.070                         | 0,00                 |
| 46.915      | Celsius Holdings Inc                         | Morgan Stanley              | 14.475                         | 0,00                 |
| 221.875     | Celsius Holdings Inc                         | Goldman Sachs International | 25.657                         | 0,00                 |
| 134.811     | Cenovus Energy Inc                           | Goldman Sachs International | 3.967                          | 0,00                 |
| (20)        | Centene Corp                                 | Goldman Sachs International | 5                              | 0,00                 |
| (105.826)   | Centene Corp                                 | Morgan Stanley              | 1.835                          | 0,00                 |
| 61.131      | CenterPoint Energy Inc                       | Morgan Stanley              | 1.576                          | 0,00                 |
| (20.000)    | Centuri Holdings Inc                         | Goldman Sachs International | 23.600                         | 0,01                 |
| (93.796)    | CF Industries Holdings Inc                   | Morgan Stanley              | 3.846                          | 0,00                 |
| 72.790      | Charles River Laboratories International Inc | Goldman Sachs International | 452                            | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,45 % (31. Dezember 2023: 6,57 %) (Fortsetzung)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                       | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|---|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 406.202   | Charles Schwab Corp                         | Goldman Sachs International | 7.124                          | 0,00                 |
| 53.529    | Charles Schwab Corp                         | Morgan Stanley              | 2.495                          | 0,00                 |
| (600)     | Chart Industries Inc                        | Goldman Sachs International | 2.497                          | 0,00                 |
| 70.369    | Charter Communications Inc Class A          | Morgan Stanley              | 9.192                          | 0,00                 |
| (3.000)   | Charter Communications Inc Class A          | Goldman Sachs International | 43                             | 0,00                 |
| 147.552   | Chemours Co                                 | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (86.699)  | Cheniere Energy Inc                         | Morgan Stanley              | 17.028                         | 0,00                 |
| (189.490) | Chesapeake Energy Corp                      | Morgan Stanley              | 32.248                         | 0,01                 |
| (384.113) | Chesapeake Energy Corp                      | Goldman Sachs International | 59.362                         | 0,01                 |
| 59.150    | Chevron Corp                                | Morgan Stanley              | 3.340                          | 0,00                 |
| (24.392)  | Chewy Inc Class A                           | Morgan Stanley              | 2.250                          | 0,00                 |
| 1.496.613 | Chipotle Mexican Grill Inc                  | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (300)     | Church & Dwight Co Inc                      | Goldman Sachs International | 325                            | 0,00                 |
| 1.800     | Churchill Downs Inc                         | Goldman Sachs International | 2.169                          | 0,00                 |
| 36.619    | Churchill Downs Inc                         | Morgan Stanley              | 2.291                          | 0,00                 |
| 178.580   | Cigna Group                                 | Goldman Sachs International | 46                             | 0,00                 |
| (92.937)  | Cincinnati Financial Corp                   | Morgan Stanley              | 5.384                          | 0,00                 |
| (60)      | Cintas Corp                                 | Goldman Sachs International | 281                            | 0,00                 |
| (89.929)  | Citigroup Inc                               | Morgan Stanley              | 14.712                         | 0,00                 |
| 30.897    | Clarivate Plc                               | Morgan Stanley              | 5.377                          | 0,00                 |
| (6.500)   | Clear Secure Inc Class A                    | Goldman Sachs International | 1.282                          | 0,00                 |
| 34.641    | Clearway Energy Inc Class C                 | Morgan Stanley              | 3.290                          | 0,00                 |
| (9.900)   | Clearway Energy Inc Class C                 | Goldman Sachs International | 5.010                          | 0,00                 |
| (147.714) | Cleveland-Cliffs Inc                        | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (10)      | CME Group Inc                               | Goldman Sachs International | 69                             | 0,00                 |
| 62.736    | CME Group Inc                               | Morgan Stanley              | 1.923                          | 0,00                 |
| 34.907    | Coca-Cola Consolidated Inc                  | Morgan Stanley              | 914                            | 0,00                 |
| 36.323    | Cognex Corp                                 | Morgan Stanley              | 4.322                          | 0,00                 |
| 141.270   | Cognizant Technology Solutions Corp Class A | Goldman Sachs International | 8.679                          | 0,00                 |
| 86.708    | Cognizant Technology Solutions Corp Class A | Morgan Stanley              | 334                            | 0,00                 |
| (2.800)   | Cohu Inc                                    | Goldman Sachs International | 2.085                          | 0,00                 |
| 42.909    | Coinbase Global Inc Class A                 | Goldman Sachs International | 1.115                          | 0,00                 |
| 681.025   | Colgate-Palmolive Co                        | Goldman Sachs International | 33.673                         | 0,01                 |
| 61.625    | Colgate-Palmolive Co                        | Morgan Stanley              | 1.385                          | 0,00                 |
| (2.700)   | Collegium Pharmaceutical Inc                | Goldman Sachs International | 2.478                          | 0,00                 |
| (3.600)   | Comcast Corp Class A                        | Goldman Sachs International | 2.313                          | 0,00                 |
| (50.040)  | Comfort Systems USA Inc                     | Morgan Stanley              | 12.150                         | 0,00                 |
| (189.080) | Commerzbank AG                              | Goldman Sachs International | 10.052                         | 0,00                 |
| (39.582)  | Commerzbank AG                              | JPMorgan Chase Bank         | 182                            | 0,00                 |
| (381.890) | Conagra Brands Inc                          | JPMorgan Chase Bank         | 3.256                          | 0,00                 |
| (21.276)  | Concentra Group Holdings Parent Inc         | Goldman Sachs International | 31.131                         | 0,01                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,45 % (31. Dezember 2023: 6,57 %) (Fortsetzung)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung            | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|----------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 1.754.826 | Confluent Inc Class A            | Nomura                      | 0                              | 0,00                 |
| 6.167.186 | CONMED Corp                      | Nomura                      | 0                              | 0,00                 |
| (667.851) | ConocoPhillips                   | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (1.000)   | Consolidated Edison Inc          | Goldman Sachs International | 366                            | 0,00                 |
| (706.420) | Constellation Brands Inc Class A | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 64.908    | Constellation Brands Inc Class A | Morgan Stanley              | 6.608                          | 0,00                 |
| 255.740   | Constellation Energy Corp        | Goldman Sachs International | 22.301                         | 0,00                 |
| 209       | Contra Inhibrx Inc               | Morgan Stanley              | 156                            | 0,00                 |
| (10)      | Cooper Cos Inc                   | Goldman Sachs International | 2                              | 0,00                 |
| 62.367    | Cooper Cos Inc                   | Morgan Stanley              | 6.717                          | 0,00                 |
| (110)     | Copart Inc                       | Goldman Sachs International | 147                            | 0,00                 |
| (2.607)   | Corcept Therapeutics Inc         | Goldman Sachs International | 505                            | 0,00                 |
| (15.000)  | Corebridge Financial Inc         | Goldman Sachs International | 10.850                         | 0,00                 |
| 1.921.509 | Corning Inc                      | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 62.137    | Corteva Inc                      | Morgan Stanley              | 5.337                          | 0,00                 |
| (140)     | Corteva Inc                      | Goldman Sachs International | 67                             | 0,00                 |
| (100)     | CorVel Corp                      | Goldman Sachs International | 1.083                          | 0,00                 |
| 31.084    | CoStar Group Inc                 | JPMorgan Chase Bank         | 2.354                          | 0,00                 |
| 193.791   | CoStar Group Inc                 | Goldman Sachs International | 9.625                          | 0,00                 |
| 26.884    | CoStar Group Inc                 | Morgan Stanley              | 695                            | 0,00                 |
| 46.454    | Coterra Energy Inc               | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 236.161   | Coty Inc Class A                 | Goldman Sachs International | 7.381                          | 0,00                 |
| 34.331    | Coupang Inc                      | Morgan Stanley              | 2.463                          | 0,00                 |
| (3.800)   | Cousins Properties Inc           | Goldman Sachs International | 344                            | 0,00                 |
| (400)     | Crane Co                         | Goldman Sachs International | 2.592                          | 0,00                 |
| 36.211    | Credit Acceptance Corp           | Morgan Stanley              | 1.076                          | 0,00                 |
| 313.282   | Credit Agricole SA               | Goldman Sachs International | 3.701                          | 0,00                 |
| 375.975   | CRISPR Therapeutics AG           | Goldman Sachs International | 118.771                        | 0,02                 |
| 117.945   | CRISPR Therapeutics AG           | JPMorgan Chase Bank         | 25.191                         | 0,01                 |
| (47.903)  | Criteo SA                        | Goldman Sachs International | 1.453                          | 0,00                 |
| 59.542    | Crown Castle Inc                 | Morgan Stanley              | 5.776                          | 0,00                 |
| (4.700)   | Crown Castle Inc                 | Goldman Sachs International | 19.295                         | 0,00                 |
| 323       | Crown LNG Holdings Ltd           | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 18.266    | CSL Ltd                          | Goldman Sachs International | 17                             | 0,00                 |
| (457.980) | CSX Corp                         | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 57.272    | CSX Corp                         | Morgan Stanley              | 2.331                          | 0,00                 |
| (105.073) | Cullinan Therapeutics Inc        | JPMorgan Chase Bank         | 4.413                          | 0,00                 |
| (85.712)  | Cummins Inc                      | Morgan Stanley              | 5.360                          | 0,00                 |
| (20)      | Cummins Inc                      | Goldman Sachs International | 71                             | 0,00                 |
| (63.750)  | Curtiss-Wright Corp              | Morgan Stanley              | 5.254                          | 0,00                 |
| 3.600     | Cushman & Wakefield Plc          | Goldman Sachs International | 193                            | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,45 % (31. Dezember 2023: 6,57 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung           | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|---------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 73.417      | CVC Capital Partners Plc        | JPMorgan Chase Bank         | 498                            | 0,00                 |
| (60)        | CVS Health Corp                 | Goldman Sachs International | 6                              | 0,00                 |
| 62.059      | CVS Health Corp                 | Morgan Stanley              | 15.492                         | 0,00                 |
| 43.750.725  | CyberAgent Inc                  | Nomura                      | 3.363                          | 0,00                 |
| 3.546       | Danaher Corp                    | Goldman Sachs International | 575                            | 0,00                 |
| (872.980)   | Danske Bank A/S                 | Goldman Sachs International | 3.810                          | 0,00                 |
| 1.215.903   | Darden Restaurants Inc          | Goldman Sachs International | 834                            | 0,00                 |
| 36.460      | Darling Ingredients Inc         | Morgan Stanley              | 5.208                          | 0,00                 |
| 62.558      | Datadog Inc Class A             | Morgan Stanley              | 5.234                          | 0,00                 |
| (191.918)   | Davide Campari-Milano NV        | Société Générale            | 943                            | 0,00                 |
| 63.542      | DaVita Inc                      | Goldman Sachs International | 408                            | 0,00                 |
| (20)        | Dayforce Inc                    | Goldman Sachs International | 30                             | 0,00                 |
| (331.817)   | Deckers Outdoor Corp            | Goldman Sachs International | 30.061                         | 0,01                 |
| (83.352)    | Deckers Outdoor Corp            | Morgan Stanley              | 23.594                         | 0,01                 |
| (30)        | Deere & Co                      | Goldman Sachs International | 244                            | 0,00                 |
| (900)       | Dell Technologies Inc Class C   | Goldman Sachs International | 3.522                          | 0,00                 |
| (90)        | Delta Air Lines Inc             | Goldman Sachs International | 192                            | 0,00                 |
| 85.662      | Denali Therapeutics Inc         | Goldman Sachs International | 21.650                         | 0,00                 |
| 9.265       | Denali Therapeutics Inc         | JPMorgan Chase Bank         | 2.230                          | 0,00                 |
| 174.966     | DENTSPLY SIRONA Inc             | Goldman Sachs International | 3.455                          | 0,00                 |
| 214.603     | Deutsche Bank AG                | JPMorgan Chase Bank         | 3.586                          | 0,00                 |
| 43.148      | Deutsche Bank AG                | Goldman Sachs International | 953                            | 0,00                 |
| 188.564     | Deutsche Lufthansa AG           | JPMorgan Chase Bank         | 3.653                          | 0,00                 |
| 252.902     | Deutsche Lufthansa AG           | Goldman Sachs International | 4.463                          | 0,00                 |
| 78.682.376  | Deutsche Telekom AG             | Société Générale            | 0                              | 0,00                 |
| (209.436)   | Devon Energy Corp               | JPMorgan Chase Bank         | 4.741                          | 0,00                 |
| (1.170.647) | Devon Energy Corp               | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 222.088     | Dexcom Inc                      | Goldman Sachs International | 6.021                          | 0,00                 |
| 272.745     | Diageo Plc                      | Goldman Sachs International | 26.791                         | 0,01                 |
| (182.726)   | Diageo Plc                      | JPMorgan Chase Bank         | 30.088                         | 0,00                 |
| 61.432      | Diamondback Energy Inc          | Morgan Stanley              | 2.976                          | 0,00                 |
| (359.117)   | Diamondback Energy Inc          | Goldman Sachs International | 16.532                         | 0,00                 |
| (105.185)   | Dick's Sporting Goods Inc       | Morgan Stanley              | 10.330                         | 0,00                 |
| (12.669)    | Direct Line Insurance Group Plc | JPMorgan Chase Bank         | 1.627                          | 0,00                 |
| (12.337)    | Direct Line Insurance Group Plc | Goldman Sachs International | 22.844                         | 0,01                 |
| (10)        | Discover Financial Services     | Goldman Sachs International | 23                             | 0,00                 |
| (1.252.453) | Discovery Ltd                   | Goldman Sachs International | 37.731                         | 0,01                 |
| (2.992.559) | Discovery Ltd                   | JPMorgan Chase Bank         | 45.122                         | 0,01                 |
| (28.559)    | Dlocal Ltd                      | Goldman Sachs International | 7.259                          | 0,00                 |
| (106.974)   | Dlocal Ltd                      | JPMorgan Chase Bank         | 7.127                          | 0,00                 |
| (69.498)    | DocuSign Inc                    | Morgan Stanley              | 49.059                         | 0,01                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,45 % (31. Dezember 2023: 6,57 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung              | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (700)       | Dolby Laboratories Inc Class A     | Goldman Sachs International | 219                            | 0,00                 |
| 68.183      | Dollar General Corp                | Goldman Sachs International | 845                            | 0,00                 |
| 84.572      | Dollar General Corp                | Morgan Stanley              | 24.941                         | 0,01                 |
| 195.183     | Domino's Pizza Inc                 | Goldman Sachs International | 6.741                          | 0,00                 |
| (97.446)    | Domino's Pizza Inc                 | Morgan Stanley              | 544                            | 0,00                 |
| 64.194      | DoubleVerify Holdings Inc          | Goldman Sachs International | 1.934                          | 0,00                 |
| 59.264      | Dover Corp                         | Morgan Stanley              | 1.231                          | 0,00                 |
| (20)        | Dover Corp                         | Goldman Sachs International | 70                             | 0,00                 |
| 61.277      | DR Horton Inc                      | Morgan Stanley              | 8.803                          | 0,00                 |
| 80.063      | DR Horton Inc                      | Goldman Sachs International | 4.610                          | 0,00                 |
| (53.543)    | Dropbox Inc Class A                | Morgan Stanley              | 19.551                         | 0,00                 |
| (400)       | DT Midstream Inc                   | Goldman Sachs International | 370                            | 0,00                 |
| (300)       | Duke Energy Corp                   | Goldman Sachs International | 200                            | 0,00                 |
| 62.440      | Duke Energy Corp                   | Morgan Stanley              | 3.840                          | 0,00                 |
| 83.474      | Duolingo Inc                       | Goldman Sachs International | 4.929                          | 0,00                 |
| (90)        | DuPont de Nemours Inc              | Goldman Sachs International | 89                             | 0,00                 |
| (2.700)     | DXC Technology Co                  | Goldman Sachs International | 1.818                          | 0,00                 |
| (2.400)     | DXP Enterprises Inc                | Goldman Sachs International | 543                            | 0,00                 |
| 132.761     | Dynatrace Inc                      | Goldman Sachs International | 4.934                          | 0,00                 |
| (53.580)    | Dynatrace Inc                      | Morgan Stanley              | 4.038                          | 0,00                 |
| (20.381)    | Dynavax Technologies Corp          | Goldman Sachs International | 4.864                          | 0,00                 |
| 1.700       | Easterly Government Properties Inc | Goldman Sachs International | 174                            | 0,00                 |
| (60)        | Eaton Corp Plc                     | Goldman Sachs International | 497                            | 0,00                 |
| 179.345     | eBay Inc                           | Goldman Sachs International | 518                            | 0,00                 |
| 110.812     | eBay Inc                           | Morgan Stanley              | 3.174                          | 0,00                 |
| (2.800)     | EchoStar Corp Class A              | Goldman Sachs International | 2.352                          | 0,00                 |
| 406.935     | Edgewell Personal Care Co          | Goldman Sachs International | 25.515                         | 0,01                 |
| 30.842      | Edgewell Personal Care Co          | JPMorgan Chase Bank         | 1.502                          | 0,00                 |
| (332.990)   | Edwards Lifesciences Corp          | Goldman Sachs International | 511                            | 0,00                 |
| 37.349      | Elanco Animal Health Inc           | Morgan Stanley              | 7.396                          | 0,00                 |
| (5.561)     | Electronic Arts Inc                | Morgan Stanley              | 3.738                          | 0,00                 |
| 109.538     | Electronic Arts Inc                | Goldman Sachs International | 5.847                          | 0,00                 |
| 63.132      | Elevance Health Inc                | Morgan Stanley              | 6.844                          | 0,00                 |
| 114.485     | Elevance Health Inc                | Goldman Sachs International | 69                             | 0,00                 |
| 47.339      | elf Beauty Inc                     | JPMorgan Chase Bank         | 2.501                          | 0,00                 |
| 496.020     | elf Beauty Inc                     | Goldman Sachs International | 17.139                         | 0,00                 |
| (330)       | Eli Lilly & Co                     | Goldman Sachs International | 3.818                          | 0,00                 |
| (57.256)    | Embecka Corp                       | Goldman Sachs International | 7.491                          | 0,00                 |
| (70)        | Emerson Electric Co                | Goldman Sachs International | 180                            | 0,00                 |
| (1.458.292) | Energy Transfer LP                 | Goldman Sachs International | 216.689                        | 0,03                 |
| (2.200)     | Enerpac Tool Group Corp            | Goldman Sachs International | 2.856                          | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,45 % (31. Dezember 2023: 6,57 %) (Fortsetzung)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                      | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|--|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 87.685    | Enphase Energy Inc                         | Morgan Stanley              | 30.225                         | 0,01                 |
| (700)     | Enpro Inc                                  | Goldman Sachs International | 2.728                          | 0,00                 |
| 62.982    | Entegris Inc                               | Morgan Stanley              | 6.107                          | 0,00                 |
| 872.757   | Enterprise Products Partners LP            | Goldman Sachs International | 53.037                         | 0,01                 |
| 104.632   | Envista Holdings Corp                      | Goldman Sachs International | 2.976                          | 0,00                 |
| (88.650)  | EPAM Systems Inc                           | Morgan Stanley              | 15.421                         | 0,00                 |
| (12.101)  | EQT Corp                                   | JPMorgan Chase Bank         | 304                            | 0,00                 |
| 292.870   | EQT Corp                                   | Goldman Sachs International | 93.799                         | 0,01                 |
| (1.000)   | Equitable Holdings Inc                     | Goldman Sachs International | 741                            | 0,00                 |
| 4.900     | Equity LifeStyle Properties Inc            | Goldman Sachs International | 1.485                          | 0,00                 |
| (3.700)   | Equity Residential                         | Goldman Sachs International | 5.163                          | 0,00                 |
| (100)     | Erie Indemnity Co Class A                  | Goldman Sachs International | 1.082                          | 0,00                 |
| (200)     | ESCO Technologies Inc                      | Goldman Sachs International | 884                            | 0,00                 |
| 1.200     | Essent Group Ltd                           | Goldman Sachs International | 102                            | 0,00                 |
| 61.451    | Essential Utilities Inc                    | Morgan Stanley              | 6.069                          | 0,00                 |
| (800)     | Essex Property Trust Inc                   | Goldman Sachs International | 8.886                          | 0,00                 |
| 100       | Everest Group Ltd                          | Goldman Sachs International | 469                            | 0,00                 |
| (1.100)   | Evergy Inc                                 | Goldman Sachs International | 47                             | 0,00                 |
| (900)     | EVERTEC Inc                                | Goldman Sachs International | 464                            | 0,00                 |
| (35.741)  | Everus Construction Group Inc              | Morgan Stanley              | 14.756                         | 0,00                 |
| 35.250    | Exact Sciences Corp                        | Morgan Stanley              | 3.019                          | 0,00                 |
| 101.507   | Exelixis Inc                               | Goldman Sachs International | 4.446                          | 0,00                 |
| (23.090)  | Exelixis Inc                               | Morgan Stanley              | 9.436                          | 0,00                 |
| 13.740    | Exelixis Inc                               | JPMorgan Chase Bank         | 820                            | 0,00                 |
| (34.831)  | Expedia Group Inc                          | JPMorgan Chase Bank         | 753                            | 0,00                 |
| (127.378) | Expedia Group Inc                          | Morgan Stanley              | 34.971                         | 0,01                 |
| (426.355) | Expedia Group Inc                          | Goldman Sachs International | 41.089                         | 0,01                 |
| (2.600)   | Extra Space Storage Inc                    | Goldman Sachs International | 14.218                         | 0,00                 |
| 993.586   | Exxon Mobil Corp                           | Goldman Sachs International | 34.165                         | 0,01                 |
| 1.000     | EZCORP Inc Class A                         | Goldman Sachs International | 230                            | 0,00                 |
| (400)     | Fabrinet                                   | Goldman Sachs International | 6.531                          | 0,00                 |
| 88.866    | FactSet Research Systems Inc               | Goldman Sachs International | 679                            | 0,00                 |
| (100)     | Fair Isaac Corp                            | Goldman Sachs International | 7.568                          | 0,00                 |
| (690)     | Fastenal Co                                | Goldman Sachs International | 1.819                          | 0,00                 |
| (2.370)   | FB Financial Corp                          | Goldman Sachs International | 2.162                          | 0,00                 |
| 61.707    | FedEx Corp                                 | Morgan Stanley              | 35                             | 0,00                 |
| 725.214   | FedEx Corp                                 | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 55.369    | Ferguson Enterprises Inc                   | Morgan Stanley              | 7.913                          | 0,00                 |
| 24        | Ferrovial SE                               | Goldman Sachs International | 124                            | 0,00                 |
| 9.549     | Fidelity National Information Services Inc | JPMorgan Chase Bank         | 376                            | 0,00                 |
| 177.976   | Fidelity National Information Services Inc | Goldman Sachs International | 10.459                         | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,45 % (31. Dezember 2023: 6,57 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung                      | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|--|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (9.670)     | Fidelity National Information Services Inc | Morgan Stanley              | 3.652                          | 0,00                 |
| 264.716     | Fifth Third Bancorp                        | Goldman Sachs International | 26.856                         | 0,01                 |
| 6.389       | First American Financial Corp              | Morgan Stanley              | 675                            | 0,00                 |
| (500)       | First Financial Bancorp                    | Goldman Sachs International | 274                            | 0,00                 |
| (463.739)   | First Horizon Corp                         | Goldman Sachs International | 3.249                          | 0,00                 |
| (64.044)    | First Industrial Realty Trust Inc          | Morgan Stanley              | 3.166                          | 0,00                 |
| 1.700       | FirstCash Holdings Inc                     | Goldman Sachs International | 88                             | 0,00                 |
| 45.206      | FirstEnergy Corp                           | Morgan Stanley              | 3.518                          | 0,00                 |
| 6.756.283   | FirstRand Ltd                              | Goldman Sachs International | 14.272                         | 0,00                 |
| 3.223.286   | FirstRand Ltd                              | JPMorgan Chase Bank         | 854                            | 0,00                 |
| (84.606)    | Fiserv Inc                                 | Morgan Stanley              | 3.499                          | 0,00                 |
| (38.846)    | Fiserv Inc                                 | JPMorgan Chase Bank         | 198                            | 0,00                 |
| 1.633.331   | Fiserv Inc                                 | Goldman Sachs International | 5.692                          | 0,00                 |
| (357.773)   | Five Below Inc                             | Goldman Sachs International | 1.201                          | 0,00                 |
| (52.669)    | Five9 Inc                                  | Morgan Stanley              | 16.146                         | 0,00                 |
| (251.304)   | Flex Ltd                                   | Morgan Stanley              | 54.696                         | 0,01                 |
| 30.846      | Floor & Decor Holdings Inc Class A         | Morgan Stanley              | 151                            | 0,00                 |
| 122.326     | Flowers Foods Inc                          | JPMorgan Chase Bank         | 7.315                          | 0,00                 |
| 349.032     | Flowers Foods Inc                          | Goldman Sachs International | 18.866                         | 0,00                 |
| (54.253)    | Flowserve Corp                             | Morgan Stanley              | 9.389                          | 0,00                 |
| (800)       | Flowserve Corp                             | Goldman Sachs International | 1.005                          | 0,00                 |
| (3.100)     | Fluor Corp                                 | Goldman Sachs International | 6.566                          | 0,00                 |
| (24.273)    | Flutter Entertainment Plc                  | Morgan Stanley              | 2.501                          | 0,00                 |
| (172.303)   | Flutter Entertainment Plc                  | JPMorgan Chase Bank         | 54.591                         | 0,01                 |
| (510.652)   | Flutter Entertainment Plc                  | Goldman Sachs International | 171.606                        | 0,02                 |
| (30)        | FMC Corp                                   | Goldman Sachs International | 32                             | 0,00                 |
| 345.563     | Foot Locker Inc                            | Goldman Sachs International | 11.444                         | 0,00                 |
| 1.047.640   | Ford Motor Co                              | Goldman Sachs International | 72.181                         | 0,01                 |
| (800)       | FormFactor Inc                             | Goldman Sachs International | 2.070                          | 0,00                 |
| (1.500)     | Fortinet Inc                               | Goldman Sachs International | 4.098                          | 0,00                 |
| (58.911)    | Fortrea Holdings Inc                       | Morgan Stanley              | 182                            | 0,00                 |
| 80.422      | Fortrea Holdings Inc                       | Goldman Sachs International | 619                            | 0,00                 |
| 66.868      | Fortune Brands Innovations Inc             | Morgan Stanley              | 12.802                         | 0,00                 |
| (1.962.988) | Foschini Group Ltd                         | JPMorgan Chase Bank         | 10.811                         | 0,00                 |
| (6.465.514) | Foschini Group Ltd                         | Goldman Sachs International | 48.333                         | 0,01                 |
| (3.000)     | Four Corners Property Trust Inc            | Goldman Sachs International | 1.953                          | 0,00                 |
| (5.400)     | Fox Corp Class A                           | Goldman Sachs International | 5.845                          | 0,00                 |
| (4.300)     | Fox Corp Class B                           | Goldman Sachs International | 4.425                          | 0,00                 |
| (55.910)    | Fox Corp Class B                           | Morgan Stanley              | 10.216                         | 0,00                 |
| 56.131      | Franklin Resources Inc                     | Morgan Stanley              | 1.463                          | 0,00                 |
| 61.393      | Freeport-McMoRan Inc                       | Morgan Stanley              | 8.442                          | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,45 % (31. Dezember 2023: 6,57 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung        | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 153.010     | Freeport-McMoRan Inc         | Goldman Sachs International | 365                            | 0,00                 |
| (857.922)   | Freshpet Inc                 | JPMorgan Chase Bank         | 120.213                        | 0,02                 |
| (1.064.999) | Freshpet Inc                 | Goldman Sachs International | 141.303                        | 0,02                 |
| (700)       | Frontdoor Inc                | Goldman Sachs International | 1.427                          | 0,00                 |
| 500         | GameStop Corp Class A        | Goldman Sachs International | 701                            | 0,00                 |
| 482.632     | Gap Inc                      | Goldman Sachs International | 34.840                         | 0,01                 |
| (60.377)    | Gap Inc                      | Morgan Stanley              | 4.865                          | 0,00                 |
| 62.411      | Gap Inc                      | JPMorgan Chase Bank         | 5.677                          | 0,00                 |
| (700)       | Garmin Ltd                   | Goldman Sachs International | 3.192                          | 0,00                 |
| 34.464      | Garmin Ltd                   | Morgan Stanley              | 390                            | 0,00                 |
| (99.117)    | Gartner Inc                  | Morgan Stanley              | 2.412                          | 0,00                 |
| (30)        | GE Vernova Inc               | Goldman Sachs International | 485                            | 0,00                 |
| (57.405)    | Generac Holdings Inc         | Morgan Stanley              | 671                            | 0,00                 |
| (1.160)     | General Electric Co          | Goldman Sachs International | 3.473                          | 0,00                 |
| 376.719     | General Mills Inc            | Goldman Sachs International | 37.761                         | 0,01                 |
| 194.506     | General Mills Inc            | JPMorgan Chase Bank         | 25.027                         | 0,01                 |
| 768.927     | Genmab A/S                   | Goldman Sachs International | 17.125                         | 0,00                 |
| (53.408)    | Genpact Ltd                  | Morgan Stanley              | 14.802                         | 0,00                 |
| 36.014      | Gentex Corp                  | Morgan Stanley              | 2.904                          | 0,00                 |
| 67.085      | Genuine Parts Co             | Morgan Stanley              | 9.668                          | 0,00                 |
| 400         | Genuine Parts Co             | Goldman Sachs International | 68                             | 0,00                 |
| (10.200)    | GEO Group Inc                | Goldman Sachs International | 2.553                          | 0,00                 |
| (700)       | Getty Realty Corp            | Goldman Sachs International | 68                             | 0,00                 |
| (300)       | G-III Apparel Group Ltd      | Goldman Sachs International | 696                            | 0,00                 |
| (27.048)    | Gilead Sciences Inc          | Morgan Stanley              | 7.764                          | 0,00                 |
| (14.836)    | Gilead Sciences Inc          | JPMorgan Chase Bank         | 1.793                          | 0,00                 |
| (10)        | Global Payments Inc          | Goldman Sachs International | 18                             | 0,00                 |
| 43.444      | GlobalFoundries Inc          | Morgan Stanley              | 3.923                          | 0,00                 |
| (71.293)    | Globe Life Inc               | Morgan Stanley              | 1.650                          | 0,00                 |
| 35.068.000  | GMO Payment Gateway Inc      | Nomura                      | 1.171                          | 0,00                 |
| (300)       | GMS Inc                      | Goldman Sachs International | 1.731                          | 0,00                 |
| (1.100)     | GoDaddy Inc Class A          | Goldman Sachs International | 10.218                         | 0,00                 |
| (88.261)    | Goldman Sachs Group Inc      | Morgan Stanley              | 12.344                         | 0,00                 |
| 62.529      | Graco Inc                    | Morgan Stanley              | 4.475                          | 0,00                 |
| (100)       | Graham Holdings Co Class B   | Goldman Sachs International | 1.553                          | 0,00                 |
| (58.487)    | Grand Canyon Education Inc   | Morgan Stanley              | 12.168                         | 0,00                 |
| 33.931      | Graphic Packaging Holding Co | Morgan Stanley              | 2.670                          | 0,00                 |
| (9.598)     | Green Dot Corp Class A       | Goldman Sachs International | 100                            | 0,00                 |
| (25.000)    | Grid Dynamics Holdings Inc   | Goldman Sachs International | 378                            | 0,00                 |
| (700)       | Griffon Corp                 | Goldman Sachs International | 1.778                          | 0,00                 |
| 33.893      | Grocery Outlet Holding Corp  | Morgan Stanley              | 7.493                          | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,45 % (31. Dezember 2023: 6,57 %) (Fortsetzung)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                  | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|--|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 15.117    | GSK Plc                                | Goldman Sachs International | 1.761                          | 0,00                 |
| (22.474)  | Guidewire Software Inc                 | Goldman Sachs International | 149                            | 0,00                 |
| 36.722    | GXO Logistics Inc                      | Morgan Stanley              | 10.499                         | 0,00                 |
| 1.961.789 | H & M Hennes & Mauritz AB              | JPMorgan Chase Bank         | 2.184                          | 0,00                 |
| 2.366.303 | H & M Hennes & Mauritz AB              | Goldman Sachs International | 27.881                         | 0,01                 |
| 32.969    | H Lundbeck A/S                         | Goldman Sachs International | 49                             | 0,00                 |
| (63.701)  | H&R Block Inc                          | Morgan Stanley              | 788                            | 0,00                 |
| (168.857) | Haleon Plc                             | Goldman Sachs International | 3.841                          | 0,00                 |
| 8.704     | Halliburton Co                         | Morgan Stanley              | 1.266                          | 0,00                 |
| (48.617)  | Halliburton Co                         | Goldman Sachs International | 5.256                          | 0,00                 |
| 705       | Halozyme Therapeutics Inc              | Goldman Sachs International | 408                            | 0,00                 |
| (700)     | Hamilton Lane Inc Class A              | Goldman Sachs International | 6.175                          | 0,00                 |
| (19.300)  | Hanesbrands Inc                        | Goldman Sachs International | 5.706                          | 0,00                 |
| 103.020   | Hannover Rueckversicheru SE            | JPMorgan Chase Bank         | 5.610                          | 0,00                 |
| 236.394   | Hannover Rueckversicheru SE            | Goldman Sachs International | 5.561                          | 0,00                 |
| (55.944)  | Hanover Insurance Group Inc            | Morgan Stanley              | 11.666                         | 0,00                 |
| (500)     | Hasbro Inc                             | Goldman Sachs International | 2.414                          | 0,00                 |
| (10)      | HCA Healthcare Inc                     | Goldman Sachs International | 25                             | 0,00                 |
| (8.600)   | Healthpeak Properties Inc              | Goldman Sachs International | 3.394                          | 0,00                 |
| (3.600)   | Heidrick & Struggles International Inc | Goldman Sachs International | 1.811                          | 0,00                 |
| 25.868    | Helen of Troy Ltd                      | Goldman Sachs International | 4.689                          | 0,00                 |
| 57.537    | Henry Schein Inc                       | Morgan Stanley              | 862                            | 0,00                 |
| 3.527     | Henry Schein Inc                       | Goldman Sachs International | 117                            | 0,00                 |
| 65.896    | Hershey Co                             | Morgan Stanley              | 7.479                          | 0,00                 |
| (95.140)  | Hess Midstream LP Class A              | Goldman Sachs International | 2.141                          | 0,00                 |
| (6.900)   | Hewlett Packard Enterprise Co          | Goldman Sachs International | 4.410                          | 0,00                 |
| (24.311)  | Hewlett Packard Enterprise Co          | Morgan Stanley              | 1.879                          | 0,00                 |
| (635.611) | HF Sinclair Corp                       | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 34.983    | Highwoods Properties Inc               | Morgan Stanley              | 907                            | 0,00                 |
| (400)     | Hillenbrand Inc                        | Goldman Sachs International | 69                             | 0,00                 |
| 1.126.674 | Hilton Worldwide Holdings Inc          | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (5.900)   | Hims & Hers Health Inc                 | Goldman Sachs International | 36.039                         | 0,01                 |
| (29.012)  | Hims & Hers Health Inc                 | Morgan Stanley              | 3.996                          | 0,00                 |
| (68.061)  | Hiscox Ltd                             | Goldman Sachs International | 3.130                          | 0,00                 |
| (72.489)  | Hiscox Ltd                             | JPMorgan Chase Bank         | 2.151                          | 0,00                 |
| (10)      | Hologic Inc                            | Goldman Sachs International | 5                              | 0,00                 |
| (90)      | Honeywell International Inc            | Goldman Sachs International | 215                            | 0,00                 |
| (1.800)   | Horace Mann Educators Corp             | Goldman Sachs International | 3.324                          | 0,00                 |
| 26.050    | Hormel Foods Corp                      | Morgan Stanley              | 630                            | 0,00                 |
| 153.829   | Hormel Foods Corp                      | JPMorgan Chase Bank         | 764                            | 0,00                 |
| 2.218.560 | Hosiden Corp                           | Nomura                      | 78                             | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,45 % (31. Dezember 2023: 6,57 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung                 | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|---------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (1.750)     | Howmet Aerospace Inc                  | Goldman Sachs International | 4.986                          | 0,00                 |
| 194.018     | HP Inc                                | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 69.091      | HP Inc                                | Morgan Stanley              | 6.116                          | 0,00                 |
| 1.000.000   | HSBC Holdings PLC                     | Société Générale            | 5.369                          | 0,00                 |
| (60.210)    | HubSpot Inc                           | Goldman Sachs International | 45.548                         | 0,01                 |
| 62.655      | Humana Inc                            | Morgan Stanley              | 8.575                          | 0,00                 |
| (40)        | Huntington Bancshares Inc             | Goldman Sachs International | 9                              | 0,00                 |
| (10)        | Huntington Ingalls Industries Inc     | Goldman Sachs International | 25                             | 0,00                 |
| (1.500)     | Hyatt Hotels Corp Class A             | Goldman Sachs International | 4.066                          | 0,00                 |
| 372.250     | Hydro One Ltd                         | JPMorgan Chase Bank         | 1.593                          | 0,00                 |
| 1.299.185   | Hydro One Ltd                         | Goldman Sachs International | 9.780                          | 0,00                 |
| (4.500)     | IAC Inc                               | Goldman Sachs International | 417                            | 0,00                 |
| (242)       | Icahn Enterprises LP                  | Goldman Sachs International | 298                            | 0,00                 |
| 1.870       | IDEXX Laboratories Inc                | Goldman Sachs International | 220                            | 0,00                 |
| 929.279     | Imperial Oil Ltd                      | Goldman Sachs International | 54.168                         | 0,01                 |
| 583.610     | Imperial Oil Ltd                      | JPMorgan Chase Bank         | 38.549                         | 0,01                 |
| (29.072)    | Incyte Corp                           | Morgan Stanley              | 4.622                          | 0,00                 |
| (3.510)     | Incyte Corp                           | Goldman Sachs International | 1.895                          | 0,00                 |
| 35.000      | Indivior Plc                          | Goldman Sachs International | 12.250                         | 0,00                 |
| 38.979.000  | INFRONEER Holdings Inc                | Nomura                      | 1.063                          | 0,00                 |
| (113.222)   | ING Groep NV                          | Goldman Sachs International | 1.275                          | 0,00                 |
| (60)        | Ingersoll Rand Inc                    | Goldman Sachs International | 106                            | 0,00                 |
| (57.176)    | Ingredion Inc                         | Morgan Stanley              | 8.646                          | 0,00                 |
| (70.885)    | Ingredion Inc                         | Goldman Sachs International | 26.210                         | 0,01                 |
| (18.485)    | Ingredion Inc                         | JPMorgan Chase Bank         | 7.325                          | 0,00                 |
| (3.000)     | Innovative Industrial Properties Inc  | Goldman Sachs International | 12.108                         | 0,00                 |
| 116.828     | InPost SA                             | Goldman Sachs International | 1.806                          | 0,00                 |
| 67.267      | InPost SA                             | JPMorgan Chase Bank         | 1.510                          | 0,00                 |
| (1.501.904) | Insulet Corp                          | Nomura                      | 0                              | 0,00                 |
| 4.200       | Integra LifeSciences Holdings Corp    | Goldman Sachs International | 139                            | 0,00                 |
| 61.782      | Intel Corp                            | Morgan Stanley              | 8.613                          | 0,00                 |
| (3.500)     | Intel Corp                            | Goldman Sachs International | 1.371                          | 0,00                 |
| 9.724       | Intellia Therapeutics Inc             | JPMorgan Chase Bank         | 4.788                          | 0,00                 |
| 140.323     | Intellia Therapeutics Inc             | Goldman Sachs International | 71.075                         | 0,01                 |
| (226.519)   | Inter Parfums Inc                     | JPMorgan Chase Bank         | 8.268                          | 0,00                 |
| (116.123)   | Inter Parfums Inc                     | Goldman Sachs International | 1.336                          | 0,00                 |
| 35.624      | Interactive Brokers Group Inc Class A | Morgan Stanley              | 1.895                          | 0,00                 |
| (20)        | Intercontinental Exchange Inc         | Goldman Sachs International | 40                             | 0,00                 |
| 62.761      | Intercontinental Exchange Inc         | Morgan Stanley              | 3.261                          | 0,00                 |
| (1.300)     | InterDigital Inc                      | Goldman Sachs International | 629                            | 0,00                 |
| (13.300)    | Interface Inc                         | Goldman Sachs International | 14.258                         | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,45 % (31. Dezember 2023: 6,57 %) (Fortsetzung)

| Anteile    | Wertpapierbezeichnung                        | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|------------|--|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (221.327)  | International Consolidated Airlines Group SA | JPMorgan Chase Bank         | 35.173                         | 0,01                 |
| (122.360)  | International Consolidated Airlines Group SA | Goldman Sachs International | 16.276                         | 0,00                 |
| (1.960)    | International Flavors & Fragrances Inc       | Goldman Sachs International | 1.050                          | 0,00                 |
| (287.961)  | Intesa Sanpaolo                              | Société Générale            | 938                            | 0,00                 |
| (4.118)    | Intra-Cellular Therapies Inc                 | Goldman Sachs International | 421                            | 0,00                 |
| (100)      | Intuit Inc                                   | Goldman Sachs International | 1.595                          | 0,00                 |
| (110)      | Intuitive Surgical Inc                       | Goldman Sachs International | 839                            | 0,00                 |
| 22.987     | Intuitive Surgical Inc                       | Morgan Stanley              | 585                            | 0,00                 |
| (7.100)    | Invitation Homes Inc                         | Goldman Sachs International | 7.828                          | 0,00                 |
| 40.668     | Ionis Pharmaceuticals Inc                    | Morgan Stanley              | 6.641                          | 0,00                 |
| 1.303      | lovance Biotherapeutics Inc                  | Goldman Sachs International | 324                            | 0,00                 |
| 11.612     | Ipsen  | Goldman Sachs International | 210                            | 0,00                 |
| (10)       | IQVIA Holdings Inc                           | Goldman Sachs International | 30                             | 0,00                 |
| (64.020)   | Iridium Communications Inc                   | Morgan Stanley              | 2.920                          | 0,00                 |
| 81.232     | Iron Mountain Inc                            | Morgan Stanley              | 6.481                          | 0,00                 |
| 75.365     | Iron Mountain Inc                            | Goldman Sachs International | 3.738                          | 0,00                 |
| 1.202.242  | Itau Unibanco Holding SA                     | Morgan Stanley              | 26.650                         | 0,01                 |
| 18.785     | Jack Henry & Associates Inc                  | JPMorgan Chase Bank         | 135                            | 0,00                 |
| 35.069     | Jack Henry & Associates Inc                  | Morgan Stanley              | 209                            | 0,00                 |
| 114.459    | Jack Henry & Associates Inc                  | Goldman Sachs International | 2.210                          | 0,00                 |
| (881)      | Jackson Financial Inc Class A                | Goldman Sachs International | 4.731                          | 0,00                 |
| 66.353.942 | JAFCO Group Co Ltd                           | Nomura                      | 2.923                          | 0,00                 |
| (5.000)    | Janus Henderson Group Plc                    | Goldman Sachs International | 5.108                          | 0,00                 |
| 12.188     | Jaws Mustang                                 | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (65.037)   | Jazz Pharmaceuticals Plc                     | Morgan Stanley              | 6.788                          | 0,00                 |
| 1.307.226  | JB Hunt Transport Services Inc               | Goldman Sachs International | 102.810                        | 0,01                 |
| (172.284)  | Jeronimo Martins SGPS SA                     | Goldman Sachs International | 4.210                          | 0,00                 |
| 63.741.440 | JFE Holdings Inc                             | Goldman Sachs International | 1.774                          | 0,00                 |
| 700        | John B Sanfilippo & Son Inc                  | Goldman Sachs International | 1.383                          | 0,00                 |
| 138.571    | Johnson & Johnson                            | Goldman Sachs International | 3.882                          | 0,00                 |
| 66.548     | Johnson & Johnson                            | Morgan Stanley              | 7.664                          | 0,00                 |
| (52.326)   | Jones Lang LaSalle Inc                       | Morgan Stanley              | 12.978                         | 0,00                 |
| 1.300      | Jones Lang LaSalle Inc                       | Goldman Sachs International | 895                            | 0,00                 |
| 15.000     | JOYY Inc                                     | Goldman Sachs International | 30.070                         | 0,01                 |
| (134.305)  | Julius Baer Group Ltd                        | JPMorgan Chase Bank         | 6.983                          | 0,00                 |
| (104.942)  | Juniper Networks Inc                         | Morgan Stanley              | 5.903                          | 0,00                 |
| 34.588.242 | Kansai Paint Co Ltd                          | Nomura                      | 1.355                          | 0,00                 |
| (43.460)   | KBC Group NV                                 | JPMorgan Chase Bank         | 611                            | 0,00                 |
| 400        | Kelly Services Inc Class A                   | Goldman Sachs International | 108                            | 0,00                 |
| 59.459     | Kenvue Inc                                   | Morgan Stanley              | 5.328                          | 0,00                 |
| 125.907    | Kenvue Inc                                   | Goldman Sachs International | 7.979                          | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,45 % (31. Dezember 2023: 6,57 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung                    | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|--|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (419.670)   | Keurig Dr Pepper Inc                     | Goldman Sachs International | 450                            | 0,00                 |
| 61.817      | Keurig Dr Pepper Inc                     | Morgan Stanley              | 1.351                          | 0,00                 |
| 55.598      | KeyCorp                                  | Morgan Stanley              | 1.093                          | 0,00                 |
| (2.400)     | Kilroy Realty Corp                       | Goldman Sachs International | 3.681                          | 0,00                 |
| 127.157     | Kimberly-Clark Corp                      | JPMorgan Chase Bank         | 10.121                         | 0,00                 |
| 564.943     | Kimberly-Clark Corp                      | Goldman Sachs International | 38.281                         | 0,01                 |
| (8.300)     | Kimco Realty Corp                        | Goldman Sachs International | 7.759                          | 0,00                 |
| (1.600)     | Kirby Corp                               | Goldman Sachs International | 4.511                          | 0,00                 |
| (6.300)     | Kite Realty Group Trust                  | Goldman Sachs International | 233                            | 0,00                 |
| (820)       | KKR & Co Inc                             | Goldman Sachs International | 3.542                          | 0,00                 |
| (5.900)     | KKR Real Estate Finance Trust Inc        | Goldman Sachs International | 1.972                          | 0,00                 |
| 61.231      | KLA Corp                                 | Morgan Stanley              | 3.981                          | 0,00                 |
| 58.547      | Knight-Swift Transportation Holdings Inc | Morgan Stanley              | 835                            | 0,00                 |
| (265.198)   | Knight-Swift Transportation Holdings Inc | Goldman Sachs International | 1.559                          | 0,00                 |
| (1.054.805) | Kodiak Gas Services Inc                  | Goldman Sachs International | 10.130                         | 0,00                 |
| 249.701     | Kohls Corp                               | JPMorgan Chase Bank         | 25.846                         | 0,01                 |
| 560.427     | Kohls Corp                               | Goldman Sachs International | 104.457                        | 0,02                 |
| 515.254     | Koninklijke Ahold Delhaize NV            | Goldman Sachs International | 16.895                         | 0,00                 |
| 164.108     | Koninklijke Ahold Delhaize NV            | JPMorgan Chase Bank         | 3.453                          | 0,00                 |
| (3.700)     | Korn Ferry                               | Goldman Sachs International | 2.824                          | 0,00                 |
| (52.385)    | Kraft Heinz Co                           | Goldman Sachs International | 10.006                         | 0,00                 |
| 68.204      | Kraft Heinz Co                           | Morgan Stanley              | 8.962                          | 0,00                 |
| 246.099     | Kraft Heinz Co                           | JPMorgan Chase Bank         | 5.448                          | 0,00                 |
| 5.327       | Krystal Biotech Inc                      | JPMorgan Chase Bank         | 657                            | 0,00                 |
| 146.196     | Krystal Biotech Inc                      | Goldman Sachs International | 16.221                         | 0,00                 |
| (146.831)   | Kymera Therapeutics Inc                  | Goldman Sachs International | 6.009                          | 0,00                 |
| (7.200)     | Kyndryl Holdings Inc                     | Goldman Sachs International | 5.567                          | 0,00                 |
| 254.118     | Labcorp Holdings Inc                     | Goldman Sachs International | 5.477                          | 0,00                 |
| 54.164      | Lam Research Corp                        | Morgan Stanley              | 3.022                          | 0,00                 |
| (1.723.219) | Lamb Weston Holdings Inc                 | Goldman Sachs International | 24.567                         | 0,01                 |
| 589.696     | Lancaster Colony Corp                    | Goldman Sachs International | 47.283                         | 0,01                 |
| (3.700)     | Las Vegas Sands Corp                     | Goldman Sachs International | 2.539                          | 0,00                 |
| 35.418      | Lattice Semiconductor Corp               | Morgan Stanley              | 971                            | 0,00                 |
| 178.978     | Lear Corp                                | Goldman Sachs International | 5.914                          | 0,00                 |
| 843         | Legend Biotech Corp                      | JPMorgan Chase Bank         | 212                            | 0,00                 |
| 34.628      | Leggett & Platt Inc                      | Morgan Stanley              | 9.430                          | 0,00                 |
| (220)       | Leidos Holdings Inc                      | Goldman Sachs International | 375                            | 0,00                 |
| (600)       | LeMaitre Vascular Inc                    | Goldman Sachs International | 558                            | 0,00                 |
| (300)       | Lennar Corp Class A                      | Goldman Sachs International | 1.037                          | 0,00                 |
| 29.369      | Lennar Corp Class B                      | Morgan Stanley              | 647                            | 0,00                 |
| (100)       | Lennox International Inc                 | Goldman Sachs International | 2.299                          | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,45 % (31. Dezember 2023: 6,57 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung                     | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|---|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 24.761      | Liberty Global Ltd Class A                | Morgan Stanley              | 2.335                          | 0,00                 |
| (119.222)   | Liberty Media Corp Class C                | Morgan Stanley              | 29.358                         | 0,01                 |
| 35.633      | Lightspeed Commerce Inc                   | Goldman Sachs International | 2.434                          | 0,00                 |
| 35.849      | Lincoln Electric Holdings Inc             | Morgan Stanley              | 4.522                          | 0,00                 |
| (100)       | Linde Plc                                 | Goldman Sachs International | 527                            | 0,00                 |
| 22.485      | Lions Gate Entertainment Corp Class A     | Goldman Sachs International | 14.937                         | 0,00                 |
| 27.804      | Lions Gate Entertainment Corp Class B     | Goldman Sachs International | 15.238                         | 0,00                 |
| 8.679       | Lionsgate Studios Corp                    | Goldman Sachs International | 5.258                          | 0,00                 |
| (1.000)     | Liquidity Services Inc                    | Goldman Sachs International | 119                            | 0,00                 |
| 35.750      | Littelfuse Inc                            | Morgan Stanley              | 1.491                          | 0,00                 |
| 18.925      | Live Nation Entertainment Inc             | Morgan Stanley              | 5.305                          | 0,00                 |
| 6.550.000   | Live Nation Entertainment Inc             | Nomura                      | 728.236                        | 0,09                 |
| 10.099.530  | Live Nation Entertainment Inc             | Société Générale            | 9.324                          | 0,00                 |
| 34.780      | Loar Holdings Inc                         | Morgan Stanley              | 5.835                          | 0,00                 |
| (30)        | Lockheed Martin Corp                      | Goldman Sachs International | 43                             | 0,00                 |
| 481.360     | L'Oreal SA                                | Morgan Stanley              | 106.546                        | 0,02                 |
| (61.676)    | Louisiana-Pacific Corp                    | Morgan Stanley              | 3.649                          | 0,00                 |
| 310.937     | Lowe's Cos Inc                            | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 352.822     | LPP Sa                                    | JPMorgan Chase Bank         | 2.654                          | 0,00                 |
| (38.695)    | Lumentum Holdings Inc                     | Morgan Stanley              | 13.646                         | 0,00                 |
| (310.484)   | LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE       | Goldman Sachs International | 5.692                          | 0,00                 |
| (368.463)   | LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE       | JPMorgan Chase Bank         | 13.328                         | 0,00                 |
| (1.087.345) | LyondellBasell Industries NV Class A      | Goldman Sachs International | 26.579                         | 0,01                 |
| 178.097     | M&T Bank Corp                             | Goldman Sachs International | 18.615                         | 0,00                 |
| (3.300)     | Macy's Inc                                | Goldman Sachs International | 3.505                          | 0,00                 |
| 100         | Madison Square Garden Sports Corp Class A | Goldman Sachs International | 409                            | 0,00                 |
| 35.864      | Madison Square Garden Sports Corp Class A | Morgan Stanley              | 813                            | 0,00                 |
| (391.598)   | Madrigal Pharmaceuticals Inc              | Goldman Sachs International | 63.605                         | 0,01                 |
| 21.241      | Magnite Inc                               | JPMorgan Chase Bank         | 1.322                          | 0,00                 |
| 64.656      | Magnite Inc                               | Goldman Sachs International | 5.976                          | 0,00                 |
| (4.600)     | Magnolia Oil & Gas Corp Class A           | Goldman Sachs International | 1.502                          | 0,00                 |
| (82.595)    | Manhattan Associates Inc                  | Morgan Stanley              | 17.024                         | 0,00                 |
| 1.265.236   | Marathon Petroleum Corp                   | Goldman Sachs International | 143.386                        | 0,02                 |
| (1.374)     | Marcus & Millichap Inc                    | Goldman Sachs International | 207                            | 0,00                 |
| (91.987)    | Markel Group Inc                          | Morgan Stanley              | 9.802                          | 0,00                 |
| 348.548     | Marriott International Inc Class A        | Goldman Sachs International | 6.682                          | 0,00                 |
| 62.913      | Marriott International Inc Class A        | Morgan Stanley              | 1.210                          | 0,00                 |
| 55.979      | Martin Marietta Materials Inc             | Morgan Stanley              | 820                            | 0,00                 |
| (87.722)    | Masco Corp                                | Morgan Stanley              | 8.325                          | 0,00                 |
| (141.209)   | Mastercard Inc Class A                    | JPMorgan Chase Bank         | 2.797                          | 0,00                 |
| 141.773     | Mastercard Inc Class A                    | Goldman Sachs International | 10.012                         | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,45 % (31. Dezember 2023: 6,57 %) (Fortsetzung)

| Anteile    | Wertpapierbezeichnung                 | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|------------|---------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (145.030)  | Mastercard Inc Class A                | Morgan Stanley              | 22.102                         | 0,00                 |
| 18.519     | Matador Resources Co                  | Morgan Stanley              | 946                            | 0,00                 |
| 67.778     | Match Group Inc                       | Morgan Stanley              | 7.783                          | 0,00                 |
| (1.400)    | Matthews International Corp Class A   | Goldman Sachs International | 880                            | 0,00                 |
| (4.900)    | MaxLinear Inc                         | Goldman Sachs International | 5.144                          | 0,00                 |
| 108.124    | McCormick & Co Inc                    | Goldman Sachs International | 6.550                          | 0,00                 |
| 116.509    | McKesson Corp                         | Goldman Sachs International | 1.589                          | 0,00                 |
| 34.360     | MDU Resources Group Inc               | Morgan Stanley              | 3.519                          | 0,00                 |
| 9.480      | Merck & Co Inc                        | Goldman Sachs International | 814                            | 0,00                 |
| 654.796    | Merck KGaA                            | Goldman Sachs International | 31.520                         | 0,01                 |
| (600)      | Mesa Laboratories Inc                 | Goldman Sachs International | 1.421                          | 0,00                 |
| (660.360)  | Meta Platforms Inc Class A            | Morgan Stanley              | 62.678                         | 0,01                 |
| 378.169    | Meta Platforms Inc Class A            | Goldman Sachs International | 7.523                          | 0,00                 |
| (18.035)   | Methanex Corp                         | Goldman Sachs International | 1.003                          | 0,00                 |
| (89.826)   | Methanex Corp                         | JPMorgan Chase Bank         | 1.202                          | 0,00                 |
| 4.133      | Mettler-Toledo International Inc      | JPMorgan Chase Bank         | 465                            | 0,00                 |
| (600)      | MGE Energy Inc                        | Goldman Sachs International | 844                            | 0,00                 |
| 69.175     | MGM Resorts International             | Morgan Stanley              | 11.903                         | 0,00                 |
| (1.400)    | MGM Resorts International             | Goldman Sachs International | 424                            | 0,00                 |
| 111.805    | Microchip Technology Inc              | Morgan Stanley              | 28.632                         | 0,00                 |
| 64.826     | Micron Technology Inc                 | Morgan Stanley              | 13.184                         | 0,00                 |
| (500)      | Micron Technology Inc                 | Goldman Sachs International | 2.922                          | 0,00                 |
| (443.451)  | Microsoft Corp                        | Morgan Stanley              | 10.689                         | 0,00                 |
| (554)      | Microsoft Corp                        | Goldman Sachs International | 7.530                          | 0,00                 |
| (900)      | Mid-America Apartment Communities Inc | Goldman Sachs International | 3.098                          | 0,00                 |
| 62.243     | Mid-America Apartment Communities Inc | Morgan Stanley              | 2.351                          | 0,00                 |
| 2.265.079  | Middleby Corp                         | Nomura                      | 0                              | 0,00                 |
| 7.066      | Middleby Corp                         | Morgan Stanley              | 344                            | 0,00                 |
| (200)      | MillerKnoll Inc                       | Goldman Sachs International | 556                            | 0,00                 |
| 47.539     | Moderna Inc                           | Goldman Sachs International | 2.698                          | 0,00                 |
| 34.960     | Moderna Inc                           | Morgan Stanley              | 710                            | 0,00                 |
| 12.796.757 | MOL Hungarian Oil & Gas Plc           | Morgan Stanley              | 2.261                          | 0,00                 |
| 41.160.428 | MOL Hungarian Oil & Gas Plc           | Goldman Sachs International | 4.503                          | 0,00                 |
| 402.635    | Molson Coors Beverage Co Class B      | Goldman Sachs International | 22.475                         | 0,00                 |
| 9.019      | Molson Coors Beverage Co Class B      | Morgan Stanley              | 628                            | 0,00                 |
| 134.909    | Molson Coors Beverage Co Class B      | JPMorgan Chase Bank         | 8.189                          | 0,00                 |
| (44.685)   | Monday.com Ltd                        | JPMorgan Chase Bank         | 1.031                          | 0,00                 |
| 489.262    | Mondelez International Inc Class A    | Goldman Sachs International | 66.406                         | 0,01                 |
| 66.160     | Mondelez International Inc Class A    | Morgan Stanley              | 9.192                          | 0,00                 |
| 213.191    | Mondelez International Inc Class A    | JPMorgan Chase Bank         | 28.192                         | 0,01                 |
| 46.255     | MongoDB Inc                           | Morgan Stanley              | 820                            | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,45 % (31. Dezember 2023: 6,57 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung                                     | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|---|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (84.852)    | Monolithic Power Systems Inc                              | Morgan Stanley              | 1.390                          | 0,00                 |
| (100)       | Monolithic Power Systems Inc                              | Goldman Sachs International | 2.958                          | 0,00                 |
| 217.912     | Monster Beverage Corp                                     | JPMorgan Chase Bank         | 9.094                          | 0,00                 |
| 215.200     | Monster Beverage Corp                                     | Goldman Sachs International | 6.382                          | 0,00                 |
| (97.774)    | Morgan Stanley  | JPMorgan Chase Bank         | 5.120                          | 0,00                 |
| 613.457     | Morgan Stanley  | Goldman Sachs International | 269                            | 0,00                 |
| (68.122)    | Morningstar Inc   | Morgan Stanley              | 709                            | 0,00                 |
| (75.217)    | Motorola Solutions Inc                                    | Morgan Stanley              | 24.870                         | 0,01                 |
| (659.409)   | MPLX LP   | Goldman Sachs International | 78.636                         | 0,01                 |
| (98.072)    | MPLX LP   | JPMorgan Chase Bank         | 7.363                          | 0,00                 |
| 2.400       | Mr Cooper Group Inc                                       | Goldman Sachs International | 780                            | 0,00                 |
| (5.898.929) | Mr Price Group Ltd  | Goldman Sachs International | 149.272                        | 0,02                 |
| (2.100)     | Mueller Industries Inc                                    | Goldman Sachs International | 7.178                          | 0,00                 |
| 45.166      | Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen | JPMorgan Chase Bank         | 1.468                          | 0,00                 |
| (614.130)   | Murphy USA Inc  | Goldman Sachs International | 16.815                         | 0,00                 |
| (10)        | Nasdaq Inc  | Goldman Sachs International | 14                             | 0,00                 |
| 35.552      | Natera Inc  | Morgan Stanley              | 1.890                          | 0,00                 |
| 138.652     | National Bank of Greece SA                                | Morgan Stanley              | 818                            | 0,00                 |
| 314.206     | National Beverage Corp                                    | Goldman Sachs International | 23.166                         | 0,00                 |
| 25.625      | National Beverage Corp                                    | JPMorgan Chase Bank         | 1.915                          | 0,00                 |
| 28.260      | National Storage Affiliates Trust                         | Morgan Stanley              | 983                            | 0,00                 |
| 224.730     | National Storage REIT                                     | Nomura                      | 0                              | 0,00                 |
| 30.488      | nCino Inc   | Morgan Stanley              | 4.033                          | 0,00                 |
| 12.000      | NCR Atleos Corp   | Goldman Sachs International | 5.412                          | 0,00                 |
| 1.125.093   | Nestle SA   | Goldman Sachs International | 123.906                        | 0,01                 |
| 324.742     | Nestle SA   | Morgan Stanley              | 70.537                         | 0,01                 |
| 897.923     | Netflix Inc   | Goldman Sachs International | 2.262                          | 0,00                 |
| (242.840)   | Netflix Inc   | Morgan Stanley              | 60.759                         | 0,02                 |
| (4.200)     | New Jersey Resources Corp                                 | Goldman Sachs International | 158                            | 0,00                 |
| 84.447      | New York Times Co Class A                                 | Goldman Sachs International | 11.471                         | 0,00                 |
| 47.409      | New York Times Co Class A                                 | JPMorgan Chase Bank         | 2.791                          | 0,00                 |
| 34.801      | New York Times Co Class A                                 | Morgan Stanley              | 904                            | 0,00                 |
| (200)       | NewMarket Corp  | Goldman Sachs International | 555                            | 0,00                 |
| (260)       | Newmont Corp  | Goldman Sachs International | 253                            | 0,00                 |
| 8.927       | Newmont Corp  | Morgan Stanley              | 2.081                          | 0,00                 |
| (247.052)   | News Corp Class A   | JPMorgan Chase Bank         | 1.150                          | 0,00                 |
| (42.308)    | News Corp Class A   | Goldman Sachs International | 5.341                          | 0,00                 |
| (93.834)    | News Corp Class A   | Morgan Stanley              | 1.233                          | 0,00                 |
| (7.651)     | News Corp Class B   | Goldman Sachs International | 4.701                          | 0,00                 |
| 37.087      | Nexstar Media Group Inc                                   | Morgan Stanley              | 3.967                          | 0,00                 |
| 34.321.958  | Nikkon Holdings Co Ltd                                    | Nomura                      | 994                            | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,45 % (31. Dezember 2023: 6,57 %) (Fortsetzung)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung               | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|-------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (444.347) | NiSource Inc                        | Goldman Sachs International | 6.229                          | 0,00                 |
| (228.287) | NN Group NV                         | Goldman Sachs International | 915                            | 0,00                 |
| (419.691) | Nordea Bank Abp                     | JPMorgan Chase Bank         | 958                            | 0,00                 |
| 41.026    | Nordson Corp                        | Morgan Stanley              | 4.167                          | 0,00                 |
| 50.336    | Norfolk Southern Corp               | Goldman Sachs International | 1.493                          | 0,00                 |
| 10.126    | Northern Trust Corp                 | Morgan Stanley              | 686                            | 0,00                 |
| (5.710)   | Northwest Bancshares Inc            | Goldman Sachs International | 1.111                          | 0,00                 |
| (40.551)  | Norwegian Cruise Line Holdings Ltd  | Morgan Stanley              | 23.302                         | 0,01                 |
| 125.975   | NOV Inc                             | Goldman Sachs International | 3.575                          | 0,00                 |
| 739.436   | Novartis AG                         | Goldman Sachs International | 58.566                         | 0,01                 |
| 122.238   | Novartis AG                         | JPMorgan Chase Bank         | 5.041                          | 0,00                 |
| 624.272   | NRG Energy Inc                      | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 103.934   | NU Holdings Ltd Class A             | Morgan Stanley              | 15.482                         | 0,00                 |
| 100       | NU Holdings Ltd Class A             | Goldman Sachs International | 5                              | 0,00                 |
| 65.105    | Nu Skin Enterprises Inc Class A     | JPMorgan Chase Bank         | 26.691                         | 0,01                 |
| 249.632   | Nu Skin Enterprises Inc Class A     | Goldman Sachs International | 94.560                         | 0,01                 |
| (383.292) | Nucor Corp                          | Goldman Sachs International | 105                            | 0,00                 |
| 35.866    | nVent Electric Plc                  | Morgan Stanley              | 4.569                          | 0,00                 |
| (3.950)   | NVIDIA Corp                         | Goldman Sachs International | 10.227                         | 0,00                 |
| (493.822) | NVIDIA Corp                         | Morgan Stanley              | 32.407                         | 0,00                 |
| 55.273    | NVR Inc                             | Morgan Stanley              | 6.206                          | 0,00                 |
| 2.186     | Oatly Group AB                      | Goldman Sachs International | 8.171                          | 0,00                 |
| 2.717     | Oatly Group AB                      | JPMorgan Chase Bank         | 18.588                         | 0,00                 |
| (62)      | Occidental Petroleum Corp           | Goldman Sachs International | 707                            | 0,00                 |
| 62.283    | Occidental Petroleum Corp           | Morgan Stanley              | 1.577                          | 0,00                 |
| 177.952   | Oddity Tech Ltd Class A             | Goldman Sachs International | 745                            | 0,00                 |
| (1.300)   | ODP Corp                            | Goldman Sachs International | 1.035                          | 0,00                 |
| (600)     | OGE Energy Corp                     | Goldman Sachs International | 377                            | 0,00                 |
| 71.973    | Olaplex Holdings Inc                | Goldman Sachs International | 26.065                         | 0,01                 |
| 12.685    | Olaplex Holdings Inc                | JPMorgan Chase Bank         | 2.090                          | 0,00                 |
| 54.895    | Old Dominion Freight Line           | Morgan Stanley              | 6.310                          | 0,00                 |
| 624.838   | Old Dominion Freight Line           | Goldman Sachs International | 14.972                         | 0,00                 |
| 290.304   | Old Dominion Freight Line           | JPMorgan Chase Bank         | 18.785                         | 0,00                 |
| (300)     | Old Republic International Corp     | Goldman Sachs International | 241                            | 0,00                 |
| (1.200)   | Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc | Goldman Sachs International | 11.556                         | 0,00                 |
| (2.600)   | Omega Healthcare Investors Inc      | Goldman Sachs International | 1.103                          | 0,00                 |
| (2.200)   | Omnicom Group Inc                   | Goldman Sachs International | 2.985                          | 0,00                 |
| 64.186    | ON Semiconductor Corp               | Morgan Stanley              | 9.520                          | 0,00                 |
| (2.900)   | ONE Gas Inc                         | Goldman Sachs International | 2.410                          | 0,00                 |
| 2.647.251 | ONEOK Inc                           | Goldman Sachs International | 20.308                         | 0,00                 |
| 190.717   | ONEOK Inc                           | JPMorgan Chase Bank         | 167                            | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,45 % (31. Dezember 2023: 6,57 %) (Fortsetzung)

| Anteile       | Wertpapierbezeichnung                | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------|--------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 62.637        | ONEOK Inc                            | Morgan Stanley              | 5.880                          | 0,00                 |
| 85.918        | Oracle Corp                          | Goldman Sachs International | 1.111                          | 0,00                 |
| 63.573        | Orion OYJ                            | JPMorgan Chase Bank         | 3.790                          | 0,00                 |
| 447.475       | Orion OYJ                            | Goldman Sachs International | 30.426                         | 0,01                 |
| (4.000)       | Ormat Technologies Inc               | Goldman Sachs International | 6.363                          | 0,00                 |
| 67.120        | Oscar Health Inc Class A             | Goldman Sachs International | 1.698                          | 0,00                 |
| 17.608.250    | OSG Corp                             | Nomura                      | 397                            | 0,00                 |
| 713.259       | Otis Worldwide Corp                  | Goldman Sachs International | 52.293                         | 0,01                 |
| 59.110        | Otis Worldwide Corp                  | Morgan Stanley              | 1.854                          | 0,00                 |
| (105.849.766) | OTP Bank Nyrt                        | Goldman Sachs International | 43.630                         | 0,01                 |
| (2.100)       | Otter Tail Corp                      | Goldman Sachs International | 3.515                          | 0,00                 |
| (219.070)     | Ovintiv Inc                          | JPMorgan Chase Bank         | 3.118                          | 0,00                 |
| (87.939)      | Owens Corning                        | Morgan Stanley              | 107                            | 0,00                 |
| (2.100)       | Owens Corning                        | Goldman Sachs International | 4.829                          | 0,00                 |
| (580)         | PACCAR Inc                           | Goldman Sachs International | 839                            | 0,00                 |
| (3.000)       | Palantir Technologies Inc Class A    | Goldman Sachs International | 18.538                         | 0,00                 |
| (20.585)      | Park Hotels & Resorts Inc            | Morgan Stanley              | 118                            | 0,00                 |
| (600)         | Patrick Industries Inc               | Goldman Sachs International | 1.107                          | 0,00                 |
| (135.423)     | Paychex Inc                          | JPMorgan Chase Bank         | 1.152                          | 0,00                 |
| 176.638       | Paychex Inc                          | Morgan Stanley              | 3.030                          | 0,00                 |
| (50)          | Paychex Inc                          | Goldman Sachs International | 109                            | 0,00                 |
| (300)         | Paycom Software Inc                  | Goldman Sachs International | 2.681                          | 0,00                 |
| 35.346        | Paylocity Holding Corp               | Morgan Stanley              | 415                            | 0,00                 |
| (1.500)       | Paylocity Holding Corp               | Goldman Sachs International | 2.022                          | 0,00                 |
| (19.700)      | Payoneer Global Inc                  | Goldman Sachs International | 3.315                          | 0,00                 |
| (361.950)     | PayPal Holdings Inc                  | Goldman Sachs International | 9.043                          | 0,00                 |
| (1.400)       | PDF Solutions Inc                    | Goldman Sachs International | 2.313                          | 0,00                 |
| (10.947)      | Pediatrix Medical Group Inc          | Goldman Sachs International | 7.493                          | 0,00                 |
| (44.312)      | Pegasystems Inc                      | Morgan Stanley              | 26.036                         | 0,01                 |
| (1.032.073)   | Pentair Plc                          | Goldman Sachs International | 4.898                          | 0,00                 |
| (394.585)     | Pepkor Holdings Ltd                  | Goldman Sachs International | 2.160                          | 0,00                 |
| 962.326       | PepsiCo Inc                          | Goldman Sachs International | 81.344                         | 0,01                 |
| 203.606       | PepsiCo Inc                          | JPMorgan Chase Bank         | 9.796                          | 0,00                 |
| 169.891       | Pernod Ricard SA                     | JPMorgan Chase Bank         | 454                            | 0,00                 |
| 355.031       | Pernod Ricard SA                     | Goldman Sachs International | 596                            | 0,00                 |
| 92.682        | Perrigo Co Plc                       | Goldman Sachs International | 4.863                          | 0,00                 |
| (177.346)     | Peyto Exploration & Development Corp | JPMorgan Chase Bank         | 2.940                          | 0,00                 |
| (220)         | Pfizer Inc                           | Goldman Sachs International | 35                             | 0,00                 |
| 181.309       | PG&E Corp                            | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 104.180       | Phillips 66                          | Goldman Sachs International | 2.543                          | 0,00                 |
| 62.466        | Phillips 66                          | Morgan Stanley              | 10.066                         | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,45 % (31. Dezember 2023: 6,57 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung                       | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|---|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 102.175     | Phoenix Group Holdings Plc                  | Goldman Sachs International | 876                            | 0,00                 |
| 75.812      | Phoenix Group Holdings Plc                  | JPMorgan Chase Bank         | 2.520                          | 0,00                 |
| 178.327     | Pinnacle Financial Partners Inc             | Goldman Sachs International | 11.757                         | 0,00                 |
| 31.026      | Pinnacle West Capital Corp                  | Morgan Stanley              | 1.120                          | 0,00                 |
| (800)       | Pinnacle West Capital Corp                  | Goldman Sachs International | 472                            | 0,00                 |
| 43.593      | Pinterest Inc Class A                       | Goldman Sachs International | 2.797                          | 0,00                 |
| (18.300)    | Pitney Bowes Inc                            | Goldman Sachs International | 1.197                          | 0,00                 |
| (300)       | PJT Partners Inc Class A                    | Goldman Sachs International | 1.035                          | 0,00                 |
| 26.501      | Playtika Holding Corp                       | Morgan Stanley              | 3.923                          | 0,00                 |
| 59.804      | Pliant Therapeutics Inc                     | Goldman Sachs International | 2.300                          | 0,00                 |
| 142.015     | Polski Koncern Naftowy ORLEN SA             | JPMorgan Chase Bank         | 5.121                          | 0,00                 |
| 124.680     | Polski Koncern Naftowy ORLEN SA             | Goldman Sachs International | 4.032                          | 0,00                 |
| 28.370      | Pool Corp                                   | Morgan Stanley              | 1.175                          | 0,00                 |
| 1.051.537   | Porto Seguro SA                             | Morgan Stanley              | 9.786                          | 0,00                 |
| (476.128)   | Post Holdings Inc                           | Goldman Sachs International | 34.442                         | 0,01                 |
| (600)       | Power Integrations Inc                      | Goldman Sachs International | 1.311                          | 0,00                 |
| (2.068.371) | Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA | Goldman Sachs International | 14.596                         | 0,00                 |
| (164.995)   | Praxis Precision Medicines Inc              | Goldman Sachs International | 9.105                          | 0,00                 |
| (231.823)   | Praxis Precision Medicines Inc              | JPMorgan Chase Bank         | 7.375                          | 0,00                 |
| 62.075      | Principal Financial Group Inc               | Morgan Stanley              | 5.303                          | 0,00                 |
| 54.857      | PROCEPT BioRobotics Corp                    | Goldman Sachs International | 3.806                          | 0,00                 |
| 35.714      | Procure Technologies Inc                    | Morgan Stanley              | 3.259                          | 0,00                 |
| (125.922)   | Procure Technologies Inc                    | Goldman Sachs International | 12.253                         | 0,00                 |
| 59.497      | Procter & Gamble Co                         | Morgan Stanley              | 336                            | 0,00                 |
| 62.828      | Progressive Corp                            | Morgan Stanley              | 5.561                          | 0,00                 |
| (20)        | Progressive Corp                            | Goldman Sachs International | 49                             | 0,00                 |
| (271.173)   | Prosperity Bancshares Inc                   | Goldman Sachs International | 4.030                          | 0,00                 |
| (70.022)    | Prosus NV                                   | Morgan Stanley              | 23.757                         | 0,01                 |
| (8.520)     | Prosus NV                                   | JPMorgan Chase Bank         | 1.310                          | 0,00                 |
| (104.068)   | Prosus NV                                   | Goldman Sachs International | 2.232                          | 0,00                 |
| 219.061     | Protagonist Therapeutics Inc                | Goldman Sachs International | 25.721                         | 0,01                 |
| (1.721)     | Protagonist Therapeutics Inc                | JPMorgan Chase Bank         | 347                            | 0,00                 |
| 335.483     | Prudential Financial Inc                    | Goldman Sachs International | 292                            | 0,00                 |
| (4.793)     | PTC Therapeutics Inc                        | JPMorgan Chase Bank         | 769                            | 0,00                 |
| (894.097)   | PTC Therapeutics Inc                        | Goldman Sachs International | 173.049                        | 0,02                 |
| (1.600)     | Public Storage                              | Goldman Sachs International | 21.694                         | 0,00                 |
| (65.175)    | PVH Corp                                    | Morgan Stanley              | 1.970                          | 0,00                 |
| 353.781     | PVH Corp                                    | JPMorgan Chase Bank         | 6.745                          | 0,00                 |
| 37.948      | QUALCOMM Inc                                | Morgan Stanley              | 3.456                          | 0,00                 |
| (20)        | Quanta Services Inc                         | Goldman Sachs International | 270                            | 0,00                 |
| 30.426      | QuantumScape Corp                           | Morgan Stanley              | 468                            | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,45 % (31. Dezember 2023: 6,57 %) (Fortsetzung)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung               | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|-------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (2.900)   | Radian Group Inc                    | Goldman Sachs International | 3.282                          | 0,00                 |
| (3.100)   | RadNet Inc                          | Goldman Sachs International | 16.568                         | 0,00                 |
| 587.454   | Range Resources Corp                | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 34.998    | Rayonier Inc                        | Morgan Stanley              | 6.309                          | 0,00                 |
| (2.000)   | Rayonier Inc                        | Goldman Sachs International | 839                            | 0,00                 |
| (2.900)   | RB Global Inc                       | Goldman Sachs International | 5.183                          | 0,00                 |
| (10.800)  | Realty Income Corp                  | Goldman Sachs International | 9.747                          | 0,00                 |
| 61.555    | Realty Income Corp                  | Morgan Stanley              | 2.646                          | 0,00                 |
| (72.350)  | Reckitt Benckiser Group Plc         | Goldman Sachs International | 16.085                         | 0,00                 |
| 7.537     | Regeneron Pharmaceuticals Inc       | Goldman Sachs International | 2.558                          | 0,00                 |
| 61.079    | Regions Financial Corp              | Morgan Stanley              | 6.963                          | 0,00                 |
| (30)      | Regions Financial Corp              | Goldman Sachs International | 9                              | 0,00                 |
| 62.825    | Reliance Steel & Aluminum           | Morgan Stanley              | 9.709                          | 0,00                 |
| (73.269)  | Remitly Global Inc                  | Morgan Stanley              | 8.049                          | 0,00                 |
| (102.407) | Remitly Global Inc                  | Goldman Sachs International | 10.922                         | 0,00                 |
| (61.951)  | Remitly Global Inc                  | JPMorgan Chase Bank         | 5.822                          | 0,00                 |
| 33.474    | Repligen Corp                       | Morgan Stanley              | 312                            | 0,00                 |
| 2.162     | Repligen Corp                       | Goldman Sachs International | 161                            | 0,00                 |
| (381.141) | Replimune Group Inc                 | Goldman Sachs International | 5.443                          | 0,00                 |
| (600)     | Resideo Technologies Inc            | Goldman Sachs International | 1.309                          | 0,00                 |
| 164.133   | ResMed Inc                          | Goldman Sachs International | 3.962                          | 0,00                 |
| 216.338   | Restaurant Brands International Inc | Goldman Sachs International | 14.171                         | 0,00                 |
| 31.364    | Restaurant Brands International Inc | JPMorgan Chase Bank         | 2.483                          | 0,00                 |
| 1.600     | REX American Resources Corp         | Goldman Sachs International | 510                            | 0,00                 |
| 38.281    | Rexford Industrial Realty Inc       | Morgan Stanley              | 6.007                          | 0,00                 |
| (1.500)   | Rexford Industrial Realty Inc       | Goldman Sachs International | 591                            | 0,00                 |
| 151.469   | Reynolds Consumer Products Inc      | Goldman Sachs International | 8.836                          | 0,00                 |
| 300.575   | Reynolds Consumer Products Inc      | JPMorgan Chase Bank         | 10.475                         | 0,00                 |
| (168.283) | RH                                  | JPMorgan Chase Bank         | 25.264                         | 0,01                 |
| (333.559) | RH                                  | Goldman Sachs International | 18.202                         | 0,00                 |
| 35.682    | RLI Corp                            | Morgan Stanley              | 1.770                          | 0,00                 |
| 599.730   | Roche Holding AG                    | Goldman Sachs International | 31.168                         | 0,01                 |
| 6.760     | Rocket Cos Inc Class A              | Morgan Stanley              | 1.497                          | 0,00                 |
| (20)      | Rockwell Automation Inc             | Goldman Sachs International | 156                            | 0,00                 |
| 62.954    | Rockwell Automation Inc             | Morgan Stanley              | 1.440                          | 0,00                 |
| (400)     | Rogers Corp                         | Goldman Sachs International | 898                            | 0,00                 |
| 32.740    | Roivant Sciences Ltd                | Morgan Stanley              | 1.030                          | 0,00                 |
| 77.082    | Roku Inc                            | Goldman Sachs International | 3.742                          | 0,00                 |
| (80.230)  | Roku Inc                            | Morgan Stanley              | 24.939                         | 0,01                 |
| 59.685    | Roper Technologies Inc              | Morgan Stanley              | 1.574                          | 0,00                 |
| 773.891   | Ross Stores Inc                     | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,45 % (31. Dezember 2023: 6,57 %) (Fortsetzung)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                   | Gegenpartei                   | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|---|-------------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 68.891    | Ross Stores Inc                         | JPMorgan Chase Bank           | 1.269                          | 0,00                 |
| (1.000)   | Royal Caribbean Cruises Ltd             | Goldman Sachs International   | 7.557                          | 0,00                 |
| 8.631     | Royalty Pharma Plc Class A              | Goldman Sachs International   | 617                            | 0,00                 |
| (200)     | RTX Corp                                | Goldman Sachs International   | 159                            | 0,00                 |
| (21.256)  | Rubrik Inc Class A                      | Morgan Stanley                | 10.667                         | 0,00                 |
| (7.600)   | RXO Inc                                 | Goldman Sachs International   | 1.420                          | 0,00                 |
| 35.889    | Ryder System Inc                        | Morgan Stanley                | 2.067                          | 0,00                 |
| 62.584    | S&P Global Inc                          | Morgan Stanley                | 2.443                          | 0,00                 |
| (310)     | S&P Global Inc                          | Goldman Sachs International   | 1.154                          | 0,00                 |
| (500)     | Saia Inc                                | Goldman Sachs International   | 10.725                         | 0,00                 |
| (283.328) | Salesforce Inc                          | Morgan Stanley                | 5.336                          | 0,00                 |
| 201.420   | Sally Beauty Holdings Inc               | Goldman Sachs International   | 27.067                         | 0,01                 |
| 21.854    | Sally Beauty Holdings Inc               | JPMorgan Chase Bank           | 4.844                          | 0,00                 |
| (126.205) | Sampo OYJ                               | JPMorgan Chase Bank           | 1.834                          | 0,00                 |
| 27.512    | Samsara Inc Class A                     | JPMorgan Chase Bank           | 3.051                          | 0,00                 |
| 75.277    | Samsara Inc Class A                     | Goldman Sachs International   | 11.242                         | 0,00                 |
| (2.000)   | Sarepta Therapeutics Inc                | Goldman Sachs International   | 3.282                          | 0,00                 |
| (700)     | SBA Communications Corp                 | Goldman Sachs International   | 4.159                          | 0,00                 |
| 57.293    | Schlumberger NV                         | Morgan Stanley                | 3.262                          | 0,00                 |
| 345.248   | Schlumberger NV                         | Goldman Sachs International   | 7.321                          | 0,00                 |
| 35.190    | Schneider National Inc Class B          | Morgan Stanley                | 3.375                          | 0,00                 |
| (3.900)   | Scholastic Corp                         | Goldman Sachs International   | 8.916                          | 0,00                 |
| 1.500     | Science Applications International Corp | Goldman Sachs International   | 152                            | 0,00                 |
| (47.472)  | SCOR SE                                 | JPMorgan Chase Bank           | 778                            | 0,00                 |
| 40.477    | Scotts Miracle-Gro Co                   | Morgan Stanley                | 9.571                          | 0,00                 |
| (300)     | Scotts Miracle-Gro Co                   | Goldman Sachs International   | 2.058                          | 0,00                 |
| 13.000    | Seadrill Ltd                            | Goldman Sachs International   | 17.030                         | 0,00                 |
| 79.303    | Seagate Technology Holdings Plc         | Morgan Stanley                | 10.031                         | 0,00                 |
| 2.478.597 | Seagate Technology Holdings Plc         | Nomura                        | 0                              | 0,00                 |
| 20.080    | SEI Investments Co                      | Bank of America Merrill Lynch | 116.202                        | 0,02                 |
| (99.570)  | SEI Investments Co                      | Morgan Stanley                | 8.309                          | 0,00                 |
| 1.415.389 | SEI Investments Co                      | Goldman Sachs International   | 0                              | 0,00                 |
| (400)     | Selective Insurance Group Inc           | Goldman Sachs International   | 1.596                          | 0,00                 |
| 17.873    | Sempra                                  | Morgan Stanley                | 962                            | 0,00                 |
| 1.773.169 | Semtech Corp                            | Nomura                        | 0                              | 0,00                 |
| (1.200)   | Sensata Technologies Holding Plc        | Goldman Sachs International   | 555                            | 0,00                 |
| (97.969)  | ServiceNow Inc                          | Morgan Stanley                | 11.120                         | 0,00                 |
| 102.445   | ServiceNow Inc                          | Goldman Sachs International   | 770                            | 0,00                 |
| (28.634)  | ServiceTitan Inc Class A                | JPMorgan Chase Bank           | 297                            | 0,00                 |
| (1.700)   | ServisFirst Bancshares Inc              | Goldman Sachs International   | 8.275                          | 0,00                 |
| (1.200)   | Shake Shack Inc Class A                 | Goldman Sachs International   | 3.046                          | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,45 % (31. Dezember 2023: 6,57 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung            | Gegenpartei                   | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|----------------------------------|-------------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (1.259.992) | Sharkninja Inc                   | Goldman Sachs International   | 46.457                         | 0,01                 |
| (172.857)   | Sharkninja Inc                   | JPMorgan Chase Bank           | 591                            | 0,00                 |
| (4.400)     | Shenandoah Telecommunications Co | Goldman Sachs International   | 1.425                          | 0,00                 |
| 51.117      | Shift4 Payments Inc Class A      | JPMorgan Chase Bank           | 35                             | 0,00                 |
| 4.715.494   | Shoprite Holdings Ltd            | Goldman Sachs International   | 4.486                          | 0,00                 |
| (3.200)     | Simon Property Group Inc         | Goldman Sachs International   | 28.518                         | 0,01                 |
| 36.045      | Simpson Manufacturing Co Inc     | Morgan Stanley                | 3.903                          | 0,00                 |
| 17.552      | Sirius XM Holdings Inc           | Morgan Stanley                | 2.946                          | 0,00                 |
| 30.000      | Sirius XM Holdings Inc           | Goldman Sachs International   | 4.799                          | 0,00                 |
| (1.100)     | SJW Group                        | Goldman Sachs International   | 4.324                          | 0,00                 |
| 2.679.153   | SK Hynix Inc                     | Bank of America Merrill Lynch | 80.888                         | 0,01                 |
| 4.816.769   | Skandinaviska Enskilda Banken AB | Goldman Sachs International   | 6.538                          | 0,00                 |
| (100)       | SkyWest Inc                      | Goldman Sachs International   | 529                            | 0,00                 |
| (227.004)   | Skyworks Solutions Inc           | Goldman Sachs International   | 0                              | 0,00                 |
| 24.683      | Skyworks Solutions Inc           | Morgan Stanley                | 922                            | 0,00                 |
| (11.834)    | SLM Corp                         | Morgan Stanley                | 3.821                          | 0,00                 |
| (1.300)     | SLM Corp                         | Goldman Sachs International   | 168                            | 0,00                 |
| (90)        | Smurfit WestRock PLC             | Goldman Sachs International   | 39                             | 0,00                 |
| (10)        | Snap-on Inc                      | Goldman Sachs International   | 60                             | 0,00                 |
| (79.077)    | Snap-on Inc                      | Morgan Stanley                | 21.113                         | 0,00                 |
| (236.440)   | Societe Generale SA              | Goldman Sachs International   | 16.030                         | 0,00                 |
| (81.463)    | SoFi Technologies Inc            | JPMorgan Chase Bank           | 617                            | 0,00                 |
| (10.307)    | SolarWinds Corp                  | Goldman Sachs International   | 1.711                          | 0,00                 |
| (10)        | Solventum Corp                   | Goldman Sachs International   | 4                              | 0,00                 |
| (1.400)     | Sonic Automotive Inc Class A     | Goldman Sachs International   | 966                            | 0,00                 |
| (4.500)     | Sonoco Products Co               | Goldman Sachs International   | 5.804                          | 0,00                 |
| (473.889)   | South Bow Corp                   | JPMorgan Chase Bank           | 1.140                          | 0,00                 |
| 40.734      | Southern Copper Corp             | Morgan Stanley                | 8.828                          | 0,00                 |
| (821.961)   | Spectrum Brands Holdings Inc     | Goldman Sachs International   | 4.590                          | 0,00                 |
| (37.909)    | Sphere Entertainment Co          | Goldman Sachs International   | 9.204                          | 0,00                 |
| (6.059)     | Sphere Entertainment Co          | Morgan Stanley                | 428                            | 0,00                 |
| (127.650)   | Spotify Technology SA            | Goldman Sachs International   | 1.800                          | 0,00                 |
| 24.983      | SpringBig Holdings Inc           | Goldman Sachs International   | 0                              | 0,00                 |
| (18.065)    | SpringWorks Therapeutics Inc     | Goldman Sachs International   | 870                            | 0,00                 |
| (13.400)    | Sprinklr Inc Class A             | Goldman Sachs International   | 5.042                          | 0,00                 |
| 264.648     | Sprouts Farmers Market Inc       | Goldman Sachs International   | 44.662                         | 0,01                 |
| 111.259     | Spyre Therapeutics Inc           | Goldman Sachs International   | 28.222                         | 0,01                 |
| 42.772      | Spyre Therapeutics Inc           | JPMorgan Chase Bank           | 15.590                         | 0,00                 |
| 62.225      | SS&C Technologies Holdings Inc   | Morgan Stanley                | 906                            | 0,00                 |
| (6.000)     | STAAR Surgical Co                | Goldman Sachs International   | 1.399                          | 0,00                 |
| 3.209.885   | Standard Bank Group Ltd          | Goldman Sachs International   | 5.629                          | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,45 % (31. Dezember 2023: 6,57 %) (Fortsetzung)

| Anteile      | Wertpapierbezeichnung                     | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------|---|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (400)        | Standex International Corp                | Goldman Sachs International | 4.494                          | 0,00                 |
| 224.740      | Stanley Black & Decker Inc                | Goldman Sachs International | 13.670                         | 0,00                 |
| 58.469       | Starbucks Corp                            | Morgan Stanley              | 2.514                          | 0,00                 |
| 34.272       | Starwood Property Trust Inc               | Morgan Stanley              | 2.106                          | 0,00                 |
| 501.053      | State Street Corp                         | Goldman Sachs International | 1.661                          | 0,00                 |
| (36.896)     | State Street Corp                         | Morgan Stanley              | 3.810                          | 0,00                 |
| (30)         | Steel Dynamics Inc                        | Goldman Sachs International | 91                             | 0,00                 |
| (2.900)      | Stellar Bancorp Inc                       | Goldman Sachs International | 1.303                          | 0,00                 |
| (1.200)      | Stifel Financial Corp                     | Goldman Sachs International | 1.668                          | 0,00                 |
| 49.261       | STMicroelectronics NV                     | Morgan Stanley              | 6.115                          | 0,00                 |
| 372.587      | Stryker Corp                              | Goldman Sachs International | 2.048                          | 0,00                 |
| 62.719       | Stryker Corp                              | Morgan Stanley              | 4.553                          | 0,00                 |
| (1.500)      | Summit Hotel Properties Inc               | Goldman Sachs International | 126                            | 0,00                 |
| 98.491       | Summit Therapeutics Inc                   | Goldman Sachs International | 20.179                         | 0,00                 |
| (107.502)    | SunOpta Inc                               | Goldman Sachs International | 19.128                         | 0,00                 |
| (16.901)     | SunOpta Inc                               | JPMorgan Chase Bank         | 1.189                          | 0,00                 |
| (15.000)     | Sunrise Communications AG Class A         | Goldman Sachs International | 25.500                         | 0,01                 |
| (25.480)     | Sunstone Hotel Investors Inc              | Goldman Sachs International | 7.495                          | 0,00                 |
| (4.913)      | Supernus Pharmaceuticals Inc              | Goldman Sachs International | 57                             | 0,00                 |
| 81.054       | Surgery Partners Inc                      | Goldman Sachs International | 7.555                          | 0,00                 |
| 1.897.889    | Swedbank AB Class A                       | Goldman Sachs International | 3.489                          | 0,00                 |
| (10.602.947) | Swedish Orphan Biovitrum AB               | Goldman Sachs International | 58.775                         | 0,01                 |
| (113.712)    | Swiss Life Holding AG                     | JPMorgan Chase Bank         | 372                            | 0,00                 |
| (104.750)    | Swiss Re AG                               | Goldman Sachs International | 12.617                         | 0,00                 |
| (48.710)     | Swiss Re AG                               | JPMorgan Chase Bank         | 4.690                          | 0,00                 |
| (10)         | Synchrony Financial                       | Goldman Sachs International | 14                             | 0,00                 |
| (200)        | Synopsys Inc                              | Goldman Sachs International | 2.621                          | 0,00                 |
| 61.456       | Synopsys Inc                              | Morgan Stanley              | 7.692                          | 0,00                 |
| 614.482      | Sysco Corp                                | Goldman Sachs International | 3.256                          | 0,00                 |
| (97.740)     | T Rowe Price Group Inc                    | Morgan Stanley              | 1.012                          | 0,00                 |
| 75.997       | T Rowe Price Group Inc                    | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (191.054)    | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd | Morgan Stanley              | 21.549                         | 0,00                 |
| (28.447)     | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd | Goldman Sachs International | 3.343                          | 0,00                 |
| 168.383      | Take-Two Interactive Software Inc         | Goldman Sachs International | 1.693                          | 0,00                 |
| (156.184)    | Take-Two Interactive Software Inc         | Morgan Stanley              | 25.065                         | 0,01                 |
| (211.909)    | Talen Energy Corp                         | JPMorgan Chase Bank         | 9.881                          | 0,00                 |
| (64.092)     | Tandem Diabetes Care Inc                  | Goldman Sachs International | 1.115                          | 0,00                 |
| 406.903      | Tanger Factory Outlet Centers Inc         | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (9.487)      | Tapestry Inc                              | Morgan Stanley              | 3.057                          | 0,00                 |
| (862.454)    | Tapestry Inc                              | Goldman Sachs International | 235.981                        | 0,03                 |
| 2.526.890    | Targa Resources Corp                      | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,45 % (31. Dezember 2023: 6,57 %) (Fortsetzung)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung          | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|--------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 181.021   | Target Corp                    | Goldman Sachs International | 26.822                         | 0,00                 |
| (436.552) | Target Corp                    | JPMorgan Chase Bank         | 46.496                         | 0,01                 |
| 8.000     | TC Energy Corp                 | Goldman Sachs International | 3.920                          | 0,00                 |
| (205.706) | TD SYNnex Corp                 | Morgan Stanley              | 3.714                          | 0,00                 |
| 27.725    | Teledyne Technologies Inc      | Morgan Stanley              | 864                            | 0,00                 |
| 2.019     | Teleflex Inc                   | Goldman Sachs International | 249                            | 0,00                 |
| 1.400     | Tempur Sealy International Inc | Goldman Sachs International | 523                            | 0,00                 |
| (71.218)  | Tempur Sealy International Inc | Morgan Stanley              | 789                            | 0,00                 |
| 192.596   | Tencent Holdings Ltd           | Morgan Stanley              | 6.261                          | 0,00                 |
| 1.600     | Tennant Co                     | Goldman Sachs International | 349                            | 0,00                 |
| (68.481)  | Teradata Corp                  | Morgan Stanley              | 231                            | 0,00                 |
| (106.829) | Teradyne Inc                   | Morgan Stanley              | 10.596                         | 0,00                 |
| (400)     | Terreno Realty Corp            | Goldman Sachs International | 202                            | 0,00                 |
| (45.306)  | Tesla Inc                      | Morgan Stanley              | 8.675                          | 0,00                 |
| 35.810    | Tetra Tech Inc                 | Morgan Stanley              | 2.990                          | 0,00                 |
| (1.000)   | Texas Capital Bancshares Inc   | Goldman Sachs International | 286                            | 0,00                 |
| 174.874   | Texas Instruments Inc          | Morgan Stanley              | 14.661                         | 0,00                 |
| (61.586)  | Texas Roadhouse Inc            | Morgan Stanley              | 4.085                          | 0,00                 |
| 28.731    | TFS Financial Corp             | Morgan Stanley              | 397                            | 0,00                 |
| (800)     | The Campbell's Co              | Goldman Sachs International | 131                            | 0,00                 |
| (20)      | Thermo Fisher Scientific Inc   | Goldman Sachs International | 124                            | 0,00                 |
| (187.242) | Thor Industries Inc            | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (40.562)  | TKO Group Holdings Inc         | JPMorgan Chase Bank         | 4.029                          | 0,00                 |
| (101.362) | TKO Group Holdings Inc         | Goldman Sachs International | 14.066                         | 0,00                 |
| (133.504) | TKO Group Holdings Inc         | Morgan Stanley              | 15.085                         | 0,00                 |
| (600)     | T-Mobile US Inc                | Goldman Sachs International | 1.434                          | 0,00                 |
| (142.189) | T-Mobile US Inc                | Morgan Stanley              | 16.456                         | 0,00                 |
| 70.181    | Toast Inc Class A              | Goldman Sachs International | 699                            | 0,00                 |
| 9.432.017 | Tokyu Corp                     | Société Générale            | 399                            | 0,00                 |
| 658.220   | Toll Brothers Inc              | Goldman Sachs International | 22.724                         | 0,01                 |
| 35.890    | Toll Brothers Inc              | Morgan Stanley              | 8.276                          | 0,00                 |
| (1.100)   | Tompkins Financial Corp        | Goldman Sachs International | 3.598                          | 0,00                 |
| (100)     | Toro Co                        | Goldman Sachs International | 133                            | 0,00                 |
| (423.889) | TotalEnergies SE               | Goldman Sachs International | 319                            | 0,00                 |
| (224.469) | Tourmaline Oil Corp            | JPMorgan Chase Bank         | 7.929                          | 0,00                 |
| (198.765) | Tourmaline Oil Corp            | Goldman Sachs International | 5.301                          | 0,00                 |
| 26.850    | Trade Desk Inc Class A         | Morgan Stanley              | 980                            | 0,00                 |
| 114.574   | Trade Desk Inc Class A         | Goldman Sachs International | 8.765                          | 0,00                 |
| (354.173) | TransAlta Corp                 | JPMorgan Chase Bank         | 116.630                        | 0,02                 |
| (537.379) | TransAlta Corp                 | Goldman Sachs International | 170.690                        | 0,02                 |
| (2.100)   | TransMedics Group Inc          | Goldman Sachs International | 1.224                          | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,45 % (31. Dezember 2023: 6,57 %) (Fortsetzung)

| Anteile      | Wertpapierbezeichnung         | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------|-------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (10)         | Travelers Cos Inc             | Goldman Sachs International | 13                             | 0,00                 |
| (102.799)    | TreeHouse Foods Inc           | JPMorgan Chase Bank         | 4.711                          | 0,00                 |
| (236.814)    | TreeHouse Foods Inc           | Goldman Sachs International | 8.922                          | 0,00                 |
| 35.639       | Trex Co Inc                   | Morgan Stanley              | 3.733                          | 0,00                 |
| (14.163)     | Trinet Group Inc              | JPMorgan Chase Bank         | 110                            | 0,00                 |
| (65.166)     | Trinet Group Inc              | Morgan Stanley              | 2.162                          | 0,00                 |
| (64.244)     | Trip.com Group Ltd            | Goldman Sachs International | 4.837                          | 0,00                 |
| (66.456)     | TripAdvisor Inc               | Goldman Sachs International | 2.711                          | 0,00                 |
| (3.416)      | TripAdvisor Inc               | JPMorgan Chase Bank         | 40                             | 0,00                 |
| 332          | Tritium DCFC Ltd              | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (1.800)      | Truist Financial Corp         | Goldman Sachs International | 1.057                          | 0,00                 |
| (3.000)      | Trupanion Inc                 | Goldman Sachs International | 7.912                          | 0,00                 |
| (3.100)      | Trustmark Corp                | Goldman Sachs International | 2.665                          | 0,00                 |
| (4.411.105)  | Truworths International Ltd   | Goldman Sachs International | 32.153                         | 0,01                 |
| (3.049.584)  | Truworths International Ltd   | JPMorgan Chase Bank         | 54.491                         | 0,01                 |
| 62.730       | Tyler Technologies Inc        | Morgan Stanley              | 4.590                          | 0,00                 |
| (1.200)      | Tyson Foods Inc Class A       | Goldman Sachs International | 736                            | 0,00                 |
| (360)        | Uber Technologies Inc         | Goldman Sachs International | 455                            | 0,00                 |
| 17.500.000   | Uber Technologies Inc         | Goldman Sachs International | 1.956.433                      | 0,24                 |
| (17.500.000) | Uber Technologies Inc1        | Goldman Sachs International | 799.250                        | 0,10                 |
| (93.117)     | UBS Group AG                  | JPMorgan Chase Bank         | 3.656                          | 0,00                 |
| (775.097)    | UCB SA                        | Goldman Sachs International | 659.724                        | 0,08                 |
| (773.712)    | UCB SA                        | JPMorgan Chase Bank         | 152.924                        | 0,02                 |
| (2.200)      | UDR Inc                       | Goldman Sachs International | 2.612                          | 0,00                 |
| (300)        | UFP Technologies Inc          | Goldman Sachs International | 2.710                          | 0,00                 |
| (56.599)     | UGI Corp                      | Morgan Stanley              | 11.721                         | 0,00                 |
| 38.315       | U-Haul Holding Co             | Morgan Stanley              | 4.066                          | 0,00                 |
| 63.233       | UiPath Inc Class A            | Goldman Sachs International | 5.842                          | 0,00                 |
| (583.503)    | Ulta Beauty Inc               | JPMorgan Chase Bank         | 2.303                          | 0,00                 |
| (190.504)    | Ulta Beauty Inc               | Goldman Sachs International | 5.678                          | 0,00                 |
| 40.198       | UltraGenyx Pharmaceutical Inc | Morgan Stanley              | 8.862                          | 0,00                 |
| (33.500)     | Under Armour Inc Class A      | Goldman Sachs International | 5.991                          | 0,00                 |
| (36.200)     | Under Armour Inc Class C      | Goldman Sachs International | 6.120                          | 0,00                 |
| (419.705)    | Unilever Plc                  | JPMorgan Chase Bank         | 9.742                          | 0,00                 |
| (1.131.786)  | Unilever Plc                  | Goldman Sachs International | 17.862                         | 0,00                 |
| 594.877      | Union Pacific Corp            | Goldman Sachs International | 18.612                         | 0,00                 |
| (140.478)    | Uniqure NV                    | Goldman Sachs International | 162.334                        | 0,02                 |
| (71.301)     | United Airlines Holdings Inc  | Morgan Stanley              | 678                            | 0,00                 |
| (490.415)    | United Airlines Holdings Inc  | Goldman Sachs International | 15.161                         | 0,00                 |
| (145.733)    | United Airlines Holdings Inc  | JPMorgan Chase Bank         | 2.453                          | 0,00                 |
| (2.500)      | United Bankshares Inc         | Goldman Sachs International | 6.112                          | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,45 % (31. Dezember 2023: 6,57 %) (Fortsetzung)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                 | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|---------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (1.000)   | United Fire Group Inc                 | Goldman Sachs International | 480                            | 0,00                 |
| 191.738   | United Natural Foods Inc              | Goldman Sachs International | 2.306                          | 0,00                 |
| 116.683   | United Parcel Service Inc Class B     | Goldman Sachs International | 8.472                          | 0,00                 |
| (200)     | United Rentals Inc                    | Goldman Sachs International | 4.789                          | 0,00                 |
| (24.718)  | United Therapeutics Corp              | Morgan Stanley              | 6.244                          | 0,00                 |
| 511.684   | United Therapeutics Corp              | Goldman Sachs International | 14.360                         | 0,00                 |
| (359.323) | UnitedHealth Group Inc                | Goldman Sachs International | 137                            | 0,00                 |
| 57.999    | UnitedHealth Group Inc                | Morgan Stanley              | 5.998                          | 0,00                 |
| 367.994   | Universal Health Services Inc Class B | Goldman Sachs International | 29.175                         | 0,01                 |
| (47.388)  | Unum Group                            | Morgan Stanley              | 20.969                         | 0,00                 |
| 1.094.568 | Unum Group                            | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| (2.900)   | Upbound Group Inc                     | Goldman Sachs International | 2.267                          | 0,00                 |
| 55.687    | Upstart Holdings Inc                  | Goldman Sachs International | 4.929                          | 0,00                 |
| (156.241) | Urban Outfitters Inc                  | JPMorgan Chase Bank         | 12.404                         | 0,00                 |
| (174.036) | Urban Outfitters Inc                  | Goldman Sachs International | 14.597                         | 0,00                 |
| (60.021)  | US Foods Holding Corp                 | Morgan Stanley              | 5.641                          | 0,00                 |
| 22.861    | USANA Health Sciences Inc             | JPMorgan Chase Bank         | 5.242                          | 0,00                 |
| 148.538   | USANA Health Sciences Inc             | Goldman Sachs International | 24.803                         | 0,01                 |
| 10.000    | Valaris Ltd                           | Goldman Sachs International | 32.963                         | 0,01                 |
| (273.566) | Valero Energy Corp                    | Goldman Sachs International | 12                             | 0,00                 |
| (51.669)  | Valmont Industries Inc                | Morgan Stanley              | 11.605                         | 0,00                 |
| (1.800)   | Valvoline Inc                         | Goldman Sachs International | 1.180                          | 0,00                 |
| 87.817    | Varonis Systems Inc                   | Goldman Sachs International | 8.818                          | 0,00                 |
| 897.584   | Ventas Inc                            | Nomura                      | 0                              | 0,00                 |
| (1.100)   | Vericel Corp                          | Goldman Sachs International | 2.686                          | 0,00                 |
| 200       | VeriSign Inc                          | Goldman Sachs International | 2.138                          | 0,00                 |
| (104.654) | VeriSign Inc                          | Morgan Stanley              | 12.743                         | 0,00                 |
| (92.899)  | Verisk Analytics Inc                  | Morgan Stanley              | 10.012                         | 0,00                 |
| 111.858   | Verizon Communications Inc            | Morgan Stanley              | 6.390                          | 0,00                 |
| 12.500    | Verizon Communications Inc            | Goldman Sachs International | 1.642                          | 0,00                 |
| 50.000    | Vermilion Energy Inc                  | Goldman Sachs International | 20.307                         | 0,00                 |
| 379.932   | Vertex Pharmaceuticals Inc            | Goldman Sachs International | 56.629                         | 0,01                 |
| 22.376    | Vertiv Holdings Co Class A            | Morgan Stanley              | 2.107                          | 0,00                 |
| (5.500)   | Vestis Corp                           | Goldman Sachs International | 2.378                          | 0,00                 |
| 213.331   | Viatis Inc                            | Goldman Sachs International | 2                              | 0,00                 |
| (5.800)   | Viavi Solutions Inc                   | Goldman Sachs International | 1.850                          | 0,00                 |
| (83.152)  | Viking Therapeutics Inc               | JPMorgan Chase Bank         | 272                            | 0,00                 |
| 42.189    | Viking Therapeutics Inc               | Morgan Stanley              | 14.014                         | 0,00                 |
| (222.427) | Viking Therapeutics Inc               | Goldman Sachs International | 1.634                          | 0,00                 |
| (14.184)  | Vir Biotechnology Inc                 | Goldman Sachs International | 645                            | 0,00                 |
| (134.590) | Visa Inc Class A                      | Goldman Sachs International | 3.712                          | 0,00                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 2,45 % (31. Dezember 2023: 6,57 %) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung                    | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|--|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (134.836)   | Visa Inc Class A                         | JPMorgan Chase Bank         | 4.412                          | 0,00                 |
| 2.800       | Visteon Corp                             | Goldman Sachs International | 825                            | 0,00                 |
| (195.421)   | Vistra Corp                              | Goldman Sachs International | 20.287                         | 0,00                 |
| (1.700)     | Vornado Realty Trust                     | Goldman Sachs International | 1.530                          | 0,00                 |
| (700)       | Voya Financial Inc                       | Goldman Sachs International | 105                            | 0,00                 |
| (1.430)     | Vulcan Materials Co                      | Goldman Sachs International | 12.353                         | 0,00                 |
| 68.367      | Walgreens Boots Alliance Inc             | Morgan Stanley              | 9.107                          | 0,00                 |
| 49.962      | Walgreens Boots Alliance Inc             | Goldman Sachs International | 3.815                          | 0,00                 |
| (1.057.407) | Walmart Inc                              | Goldman Sachs International | 78.231                         | 0,01                 |
| (320.186)   | Walmart Inc                              | JPMorgan Chase Bank         | 29.977                         | 0,00                 |
| 106.155     | Walt Disney Co                           | Goldman Sachs International | 3.736                          | 0,00                 |
| (199.715)   | Walt Disney Co                           | Morgan Stanley              | 14.033                         | 0,00                 |
| (19.000)    | Warner Bros Discovery Inc                | Goldman Sachs International | 3.400                          | 0,00                 |
| (3.100)     | Warrior Met Coal Inc                     | Goldman Sachs International | 4.545                          | 0,00                 |
| (60)        | Waste Management Inc                     | Goldman Sachs International | 203                            | 0,00                 |
| 127.073     | WaVe Life Sciences Ltd                   | Goldman Sachs International | 11.679                         | 0,00                 |
| (23.534)    | Wayfair Inc Class A                      | Morgan Stanley              | 2.805                          | 0,00                 |
| (54.261)    | Webtoon Entertainment Inc                | Goldman Sachs International | 4.060                          | 0,00                 |
| (18.098)    | Webtoon Entertainment Inc                | JPMorgan Chase Bank         | 281                            | 0,00                 |
| 59.852      | WEC Energy Group Inc                     | Morgan Stanley              | 865                            | 0,00                 |
| (800)       | WEC Energy Group Inc                     | Goldman Sachs International | 617                            | 0,00                 |
| (900)       | WESCO International Inc                  | Goldman Sachs International | 2.576                          | 0,00                 |
| 54.846      | Western Digital Corp                     | Morgan Stanley              | 2.724                          | 0,00                 |
| 330.080     | Western Digital Corp                     | Goldman Sachs International | 673                            | 0,00                 |
| 145.113     | Western Union Co                         | Goldman Sachs International | 9.350                          | 0,00                 |
| 62.970      | Westinghouse Air Brake Technologies Corp | Morgan Stanley              | 3.376                          | 0,00                 |
| 62.765      | Westlake Corp                            | Morgan Stanley              | 6.508                          | 0,00                 |
| 35.779      | WEX Inc                                  | Morgan Stanley              | 4.925                          | 0,00                 |
| 1.100       | WEX Inc                                  | Goldman Sachs International | 882                            | 0,00                 |
| (200)       | Whirlpool Corp                           | Goldman Sachs International | 1.013                          | 0,00                 |
| (900)       | Williams-Sonoma Inc                      | Goldman Sachs International | 2.285                          | 0,00                 |
| (79.277)    | Williams-Sonoma Inc                      | Morgan Stanley              | 1.394                          | 0,00                 |
| 63.022      | Willis Towers Watson Plc                 | Morgan Stanley              | 2.135                          | 0,00                 |
| 35.201      | WillScot Holdings Corp                   | Morgan Stanley              | 4.568                          | 0,00                 |
| 60.038      | Wingstop Inc                             | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 1.738.064   | Winnebago Industries Inc                 | Goldman Sachs International | 0                              | 0,00                 |
| 35.883      | Wintrust Financial Corp                  | Morgan Stanley              | 3.100                          | 0,00                 |
| (9.300)     | WisdomTree Inc                           | Goldman Sachs International | 2.285                          | 0,00                 |
| (22.272)    | Wix.com Ltd                              | JPMorgan Chase Bank         | 7.839                          | 0,00                 |
| (103.067)   | Wix.com Ltd                              | Goldman Sachs International | 26.984                         | 0,01                 |
| (28.000)    | Wolfspeed Inc                            | Goldman Sachs International | 35.682                         | 0,01                 |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte 2,45 % (31. Dezember 2023: 6,57 %) (Fortsetzung)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                 | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (167.496)   | Wolfspeed Inc                         | Nomura                      | 0                              | 0,00                 |
| 154.938   | Woolworths Holdings Ltd               | JPMorgan Chase Bank         | 278                            | 0,00                 |
| 9.381.580   | Woolworths Holdings Ltd               | Goldman Sachs International | 10.319                         | 0,00                 |
| 27.015  | Workday Inc Class A                   | Morgan Stanley              | 2.083                          | 0,00                 |
| 119.977   | Workday Inc Class A                   | Goldman Sachs International | 8.457                          | 0,00                 |
| (4.800)   | World Kinect Corp                     | Goldman Sachs International | 681                            | 0,00                 |
| (4.200)   | Worthington Steel Inc                 | Goldman Sachs International | 1.702                          | 0,00                 |
| (2.200)   | WSFS Financial Corp                   | Goldman Sachs International | 2.234                          | 0,00                 |
| 213.054   | WW Grainger Inc                       | Goldman Sachs International | 21.398                         | 0,00                 |
| (98.264)  | Wynn Resorts Ltd                      | Goldman Sachs International | 1.718                          | 0,00                 |
| (800)   | Xcel Energy Inc                       | Goldman Sachs International | 469                            | 0,00                 |
| 62.314  | Xcel Energy Inc                       | Morgan Stanley              | 3.644                          | 0,00                 |
| (7.407)   | Xencor Inc                            | Goldman Sachs International | 13.420                         | 0,00                 |
| (17.624)  | Xenon Pharmaceuticals Inc             | JPMorgan Chase Bank         | 826                            | 0,00                 |
| (12.100)  | Xerox Holdings Corp                   | Goldman Sachs International | 9.858                          | 0,00                 |
| 43.214  | XP Inc Class A                        | Morgan Stanley              | 14.201                         | 0,00                 |
| (2.100)   | XPEL Inc                              | Goldman Sachs International | 1.519                          | 0,00                 |
| (1.074.165)   | XPO Inc                               | Goldman Sachs International | 41.671                         | 0,01                 |
| 66.839  | Xylem Inc                             | Morgan Stanley              | 9.904                          | 0,00                 |
| 62.721  | Yum! Brands Inc                       | Morgan Stanley              | 1.867                          | 0,00                 |
| 360.907   | Yum! Brands Inc                       | Goldman Sachs International | 1.375                          | 0,00                 |
| 341.407   | Zabka Group SA                        | JPMorgan Chase Bank         | 4.278                          | 0,00                 |
| (9.027)   | Zai Lab Ltd                           | JPMorgan Chase Bank         | 142                            | 0,00                 |
| (10)  | Zimmer Biomet Holdings Inc            | Goldman Sachs International | 15                             | 0,00                 |
| (34.208)  | Zions Bancorp NA                      | Morgan Stanley              | 5.676                          | 0,00                 |
| 1.938   | Zoetis Inc                            | Goldman Sachs International | 315                            | 0,00                 |
| 62.687  | Zoetis Inc                            | Morgan Stanley              | 6.335                          | 0,00                 |
| (24.225)  | Zoom Video Communications Inc Class A | Morgan Stanley              | 11.163                         | 0,00                 |
| 65.476  | Zscaler Inc                           | Goldman Sachs International | 6.271                          | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Differenzkontrakten <sup>∞</sup></b> |                                       |                             | <b>19.759.075</b>              | <b>2,45</b>          |

### Gekaufte Swaptions 0,00 % (31. Dezember 2023: 0,00 %)

| Nominalwert  | Fälligkeit | Beschreibung   | Gegenpartei                 | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|------------|--|-----------------------------|---------------|----------------------|
| <b>Payer-Swaptions</b>   |            |  |                             |               |                      |
| EUR<br>60.000.000  | 15.01.2025 | EUR Swaption, bei potenzieller Ausübung der Option geht das Portfolio ein Swapgeschäft mit einem Nominalwert von 60.000.000 EUR ein, in dessen Rahmen er einen Satz von 1,00 % zahlt und iTraxx EUR S42 erhält, Ausübungssatz 7,00 % | Merrill Lynch International | 9.599         | 0,00                 |
| <b>Beizulegender Zeitwert aus gekauften Swaptions insgesamt <sup>∞</sup> (Prämie: 51.133 US\$)</b> |            |  |                             | <b>9.599</b>  | <b>0,00</b>          |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

**Total Return Swap-Kontrakte 0,33 % (31. Dezember 2023: 0,21 %)**

| Nominalwert  | Datum der Schließung | Variabler Zinssatz  | Referenzunternehmen                          | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|----------------------|---------------------|--|--------------------------------|----------------------|
| 16.442.593 USD   | 18.03.2025           | 4,77 <sup>1</sup>   | Société Générale Basket SGBVRRU <sup>2</sup> | 879.514                        | 0,11                 |
| 194.487 USD  | 13.03.2025           | 4,81 <sup>3</sup>   | Goldman Sachs Basket GSUCPSS <sup>4</sup>    | 492.884                        | 0,06                 |
| (3.232.010) USD  | 06.11.2026           | 3,88 <sup>3</sup>   | Morgan Stanley Basket MSABSMBP <sup>2</sup>  | 332.475                        | 0,04                 |
| (2.421.744) USD  | 06.11.2026           | 3,66 <sup>3</sup>   | Morgan Stanley Basket MSXXBIOH <sup>5</sup>  | 242.893                        | 0,03                 |
| (2.526.293) USD  | 06.11.2026           | 4,07 <sup>3</sup>   | Morgan Stanley Basket MSABBIO1 <sup>5</sup>  | 175.818                        | 0,02                 |
| 44.013.339 USD   | 24.04.2025           | 0,00 <sup>6</sup>   | Goldman Sachs GSVIDI1B Index <sup>4</sup>    | 166.612                        | 0,02                 |
| (846.365) USD  | 06.11.2026           | 4,03 <sup>3</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUXLE <sup>5</sup>  | 78.085                         | 0,01                 |
| (642.724) USD  | 21.12.2049           | 3,58 <sup>3</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUTAN <sup>5</sup>  | 55.924                         | 0,01                 |
| (1.472.474) USD  | 21.12.2049           | (0,90) <sup>6</sup> | Morgan Stanley Basket MSZZMOMO <sup>5</sup>  | 41.408                         | 0,01                 |
| (634.068) USD  | 06.11.2026           | 4,08 <sup>3</sup>   | Morgan Stanley Basket MSXXSTAP <sup>5</sup>  | 27.864                         | 0,01                 |
| (1.272.341) USD  | 06.11.2026           | 4,03 <sup>3</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUXLU <sup>5</sup>  | 22.763                         | 0,01                 |
| (1.592.191) USD  | 06.11.2026           | 4,11 <sup>3</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUXLP <sup>5</sup>  | 19.822                         | 0,00                 |
| (614.141) USD  | 06.11.2026           | 4,08 <sup>3</sup>   | Morgan Stanley Basket MSABCSTP <sup>5</sup>  | 15.972                         | 0,00                 |
| 640.936 USD  | 18.12.2049           | 4,08 <sup>3</sup>   | Morgan Stanley Basket MSXXRTL <sup>5</sup>   | 15.914                         | 0,00                 |
| (739.001) USD  | 10.03.2026           | 3,59 <sup>3</sup>   | Morgan Stanley Basket MSXXCOTF <sup>5</sup>  | 15.524                         | 0,00                 |
| (422.641) USD  | 28.02.2025           | (0,80) <sup>6</sup> | Morgan Stanley Basket MSCBSMMU <sup>5</sup>  | 11.160                         | 0,00                 |
| (1.484.902) USD  | 06.11.2026           | 3,03 <sup>3</sup>   | Morgan Stanley Basket MSACHDGE <sup>5</sup>  | 10.074                         | 0,00                 |
| (1.175.271) USD  | 11.02.2025           | (0,80) <sup>6</sup> | Morgan Stanley Basket MSCBSMMU <sup>5</sup>  | 7.722                          | 0,00                 |
| (269.555) USD  | 06.11.2026           | 4,11 <sup>3</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUSPY <sup>5</sup>  | 7.291                          | 0,00                 |
| (608.620) EUR  | 14.12.2049           | 2,02 <sup>7</sup>   | Morgan Stanley Basket MSABMCPH <sup>5</sup>  | 7.264                          | 0,00                 |
| (478.900) USD  | 14.01.2025           | 3,53 <sup>3</sup>   | Morgan Stanley Basket MSCBSMMU <sup>5</sup>  | 6.428                          | 0,00                 |
| (1.065.908) USD  | 06.12.2049           | 4,03 <sup>3</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUXLY <sup>5</sup>  | 6.411                          | 0,00                 |
| (649.376) USD  | 06.11.2026           | 4,08 <sup>3</sup>   | Morgan Stanley Basket MSABUDEF <sup>5</sup>  | 6.301                          | 0,00                 |
| (303.669) USD  | 25.02.2026           | (0,90) <sup>1</sup> | Morgan Stanley Basket MSZZMOMO <sup>5</sup>  | 3.059                          | 0,00                 |
| (537.529) USD  | 03.02.2026           | 4,11 <sup>3</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUSPY <sup>5</sup>  | 2.986                          | 0,00                 |
| (243.186) USD  | 06.11.2026           | 4,11 <sup>3</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUXQQ <sup>5</sup>  | 2.240                          | 0,00                 |
| (91.270) USD   | 06.11.2026           | 3,59 <sup>3</sup>   | Morgan Stanley Basket MSXXCOTF <sup>5</sup>  | 1.752                          | 0,00                 |
| (258.148) USD  | 06.11.2026           | 4,05 <sup>3</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUIWM <sup>5</sup>  | 1.678                          | 0,00                 |
| (15.403) USD   | 04.06.2025           | 3,66 <sup>3</sup>   | Morgan Stanley Basket MSXXBIOH <sup>5</sup>  | 1.545                          | 0,00                 |
| (64.490) USD   | 06.11.2026           | 4,11 <sup>3</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUSPY <sup>5</sup>  | 1.513                          | 0,00                 |
| (341.746) USD  | 28.12.2026           | 4,03 <sup>3</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUKRE <sup>5</sup>  | 1.510                          | 0,00                 |
| (13.526) USD   | 04.06.2025           | 4,06 <sup>3</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUXBI <sup>5</sup>  | 1.302                          | 0,00                 |
| (208.647) USD  | 06.11.2026           | 4,03 <sup>3</sup>   | Morgan Stanley Basket MSXXAIPW <sup>5</sup>  | 1.260                          | 0,00                 |
| (83.100) USD   | 05.12.2049           | (0,80) <sup>6</sup> | Morgan Stanley Basket MSCBSRVU <sup>5</sup>  | 516                            | 0,00                 |
| 92.153 USD   | 02.06.2025           | 0,80 <sup>6</sup>   | Morgan Stanley Basket MSCBSSHU <sup>5</sup>  | 227                            | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Total Return Swap-Kontrakten <sup>∞</sup></b> |                      |                     |  | <b>2.665.711</b>               | <b>0,33</b>          |

<sup>1</sup> Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist der 1-Tag-SOFR.

<sup>2</sup> Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist Société Générale.

<sup>3</sup> Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist der 1-Tag-FEDEF.

<sup>4</sup> Die Gegenpartei für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist Goldman Sachs International.

<sup>5</sup> Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist Morgan Stanley.

<sup>6</sup> Feste Finanzierungskosten.

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Inflation-Swap-Kontrakte 0,25 % (31. Dezember 2023: 0,24 %)

| Vega Nominalwert   | Datum der Schließung | Gegenpartei                 | Referenz-obligation                      | Variance-Ausübungssatz | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|----------------------|-----------------------------|--|------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 325.000 USD  | 19.12.2025           | Citibank NA                 | Russell 2000 Index vs S&P 500 Index      | 25,00 % / 22,10 %      | 916.417                        | 0,11                 |
| 250.000 EUR  | 21.03.2025           | BNP Paribas                 | EURO STOXX 50 Index vs FTSE 100 Index    | 16,00 % / 15,05 %      | 715.693                        | 0,09                 |
| 62.700 EUR   | 19.12.2025           | Goldman Sachs International | EURO STOXX Banks Index Up-Variance       | 18,65 %                | 123.660                        | 0,02                 |
| 110.000 EUR  | 18.12.2026           | BNP Paribas                 | EURO STOXX 50 Index Nikkei 225 Index     | 16,40 % / 20,20 %      | 115.170                        | 0,02                 |
| 100.000 GBP  | 19.12.2025           | BNP Paribas                 | DAX Index vs FTSE 100 Index              | 16,60 % / 14,40 %      | 60.689                         | 0,01                 |
| 30.000 USD   | 19.12.2025           | BNP Paribas                 | FTSE 100 Index vs STOXX Europe 600 Index | 17,20 % / 19,75 %      | 31.285                         | 0,00                 |
| 100.000 EUR  | 19.12.2025           | BNP Paribas                 | EURO STOXX Banks Index Up-Variance       | 19,80 %                | 8.372                          | 0,00                 |
| 50.000 EUR   | 21.03.2025           | BofA Securities             | EURO STOXX Banks Index vs S&P 500 Index  | 23,20 % / 17,25 %      | 6.227                          | 0,00                 |
| 40.000 EUR   | 19.12.2025           | JPMorgan Chase Bank         | EURO STOXX Banks Index Up-Variance       | 21,45 %                | 3.491                          | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Variance-Swap-Kontrakten <sup>∞</sup></b> |                      |                             |  |                        | <b>1.981.004</b>               | <b>0,25</b>          |

### Volatility-Swap-Kontrakte 0,91 % (31. Dezember 2023: 1,13 %)

| Nominalwert  | Datum der Schließung | Gegenpartei         | Referenzobligation <sup>1</sup>        | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |             |
|--|----------------------|---------------------|--|--------------------------------|----------------------|-------------|
| 50.010.000 USD   | 20.06.2025           | Nomura              | Nomura 31 Names Global Basket          | 1.525.516                      | 0,19                 |             |
| 30.000.000 USD   | 20.06.2025           | Nomura              | Nomura 20 Names Global Basket          | 1.166.864                      | 0,14                 |             |
| 20.000.000 USD   | 17.01.2025           | Société Générale    | SG 13 Names US Basket                  | 634.000                        | 0,08                 |             |
| 12.500.000 USD   | 20.06.2025           | BofA Securities     | BAML 19 Names US Basket                | 522.330                        | 0,07                 |             |
| 35.000.000 EUR   | 18.12.2026           | BNP                 | BNP 25 Names EU Basket                 | 400.472                        | 0,05                 |             |
| 15.000.000 USD   | 20.06.2025           | UBS                 | UBS 40 Names US Basket                 | 391.564                        | 0,05                 |             |
| 13.500.000 EUR   | 17.01.2025           | BNP                 | BNP 19 Names Global Basket             | 349.213                        | 0,04                 |             |
| 15.000.000 USD   | 16.01.2026           | Morgan Stanley      | MS 17 Names US Basket                  | 345.150                        | 0,04                 |             |
| 20.000.000 USD   | 17.01.2025           | BNP                 | BNP 13 Names US Basket                 | 345.090                        | 0,04                 |             |
| 30.000.000 USD   | 20.06.2025           | Morgan Stanley      | MS 21 Names US Basket                  | 322.133                        | 0,04                 |             |
| 20.000.000 USD   | 17.01.2025           | JPMorgan Chase Bank | JPMorgan Chase Bank 16 Names US Basket | 276.668                        | 0,03                 |             |
| 14.830.000 USD   | 20.06.2025           | Morgan Stanley      | MS 31 Names Global Basket              | 270.236                        | 0,03                 |             |
| 30.000.000 USD   | 20.06.2025           | UBS                 | UBS 20 Names US Basket                 | 245.979                        | 0,03                 |             |
| 22.500.000 USD   | 20.06.2025           | UBS                 | UBS 16 Names US Basket                 | 208.999                        | 0,03                 |             |
| 10.006.200 USD   | 16.01.2026           | UBS                 | UBS 34 Names US Basket                 | 157.562                        | 0,02                 |             |
| 12.500.000 USD   | 17.01.2025           | BNP                 | BNP 5 Names Down Geo Basket            | 91.344                         | 0,01                 |             |
| 22.500.000 EUR   | 17.01.2025           | BNP                 | BNP 38 Names Global Basket             | 56.515                         | 0,01                 |             |
| 21.363.700 USD   | 17.01.2025           | Citibank NA         | CITI 25 Names US Basket                | 45.634                         | 0,01                 |             |
| 24.260.500 USD   | 20.06.2025           | BNP Paribas         | BNP 28 Names Global Basket             | 18.942                         | 0,00                 |             |
| 240.000 USD  | 17.01.2025           | BofA Securities     | BAML 27 Names US Basket                | 0                              | 0,00                 |             |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Volatility-Swap-Kontrakten <sup>∞</sup></b> |                      |                     |  |                                | <b>7.374.211</b>     | <b>0,91</b> |

<sup>1</sup> Die Volatilitäten lauten auf verschiedene Fremdwährungen, je nach den Landeswährungen der Positionen in den Swaps.

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

|  | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|--------------------|------------------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> | <b>572.847.491</b> | <b>71,00</b>                 |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (5,69 %) (31. Dezember 2023: (3,25 %))

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettövermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 490.000 AUD        | 47.617.362 ¥        | 19.03.2025       | Barclays Bank Plc              | 1         | (2.233)                         | (0,00)               |
| 1.240.000 AUD      | 120.393.562 ¥       | 19.03.2025       | Citibank NA                    | 6         | (4.959)                         | (0,00)               |
| 620.000 AUD        | 387.739 US\$        | 19.03.2025       | Citibank NA                    | 11        | (3.827)                         | (0,00)               |
| 100.000 AUD        | 63.401 US\$         | 19.03.2025       | Deutsche Bank AG               | 2         | (1.479)                         | (0,00)               |
| 200.000 AUD        | 19.334.238 ¥        | 19.03.2025       | Deutsche Bank AG               | 2         | (260)                           | (0,00)               |
| 440.000 AUD        | 42.826.551 ¥        | 19.03.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | (2.442)                         | (0,00)               |
| 6.185.167 AUD      | 4.154.731 US\$      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 6         | (325.112)                       | (0,04)               |
| 15.800.000 AUD     | 14.174.476 CAD      | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 4         | (80.743)                        | (0,01)               |
| 417.519 AUD        | 250.000 €           | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (583)                           | (0,00)               |
| 1.500.000 AUD      | 938.168 US\$        | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 3         | (9.414)                         | (0,00)               |
| 1.009.686 AUD      | 500.000 £           | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (919)                           | (0,00)               |
| 200.000 AUD        | 221.102 NZD         | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (54)                            | (0,00)               |
| 2.000.000 AUD      | 195.378.228 ¥       | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 3         | (8.032)                         | (0,00)               |
| 140.000 AUD        | 86.935 US\$         | 19.03.2025       | Royal Bank of Canada           | 2         | (244)                           | (0,00)               |
| 1.140.000 AUD      | 110.969.543 ¥       | 19.03.2025       | Royal Bank of Scotland         | 6         | (6.390)                         | (0,00)               |
| 680.000 AUD        | 429.034 US\$        | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 7         | (7.966)                         | (0,00)               |
| 820.000 AUD        | 79.524.791 ¥        | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 5         | (2.699)                         | (0,00)               |
| 9.919.620 AUD      | 6.590.681 US\$      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 9         | (448.834)                       | (0,07)               |
| 35.447.715 AUD     | 23.328.540 US\$     | 16.01.2025       | UBS AG                         | 5         | (1.380.674)                     | (0,18)               |
| 50.000 AUD         | 31.974 US\$         | 19.03.2025       | UBS AG                         | 2         | (1.013)                         | (0,00)               |
| 13.889.156 AUD     | 9.145.960 US\$      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 4         | (546.326)                       | (0,07)               |
| 410.000 BRL        | 66.560 US\$         | 19.03.2025       | Citibank NA                    | 2         | (1.060)                         | (0,00)               |
| 8.841.303 BRL      | 1.501.415 US\$      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 2         | (73.914)                        | (0,01)               |
| 2.220.000 BRL      | 369.192 US\$        | 19.03.2025       | HSBC Bank Plc                  | 2         | (14.529)                        | (0,00)               |
| 42.189.848 BRL     | 6.971.357 US\$      | 03.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 49        | (142.143)                       | (0,02)               |
| 3.620.000 BRL      | 582.196 US\$        | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 3         | (3.871)                         | (0,00)               |
| 9.042.025 BRL      | 1.587.256 US\$      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 3         | (127.348)                       | (0,02)               |
| 5.468.832 BRL      | 978.088 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                         | 1         | (95.101)                        | (0,01)               |
| 530.000 CAD        | 372.036 US\$        | 19.03.2025       | Citibank NA                    | 7         | (2.495)                         | (0,00)               |
| 8.025.899 CAD      | 5.779.342 US\$      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 6         | (196.093)                       | (0,03)               |
| 100.000 CAD        | 69.624 US\$         | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (37)                            | (0,00)               |
| 520.000 CAD        | 365.099 US\$        | 19.03.2025       | Royal Bank of Canada           | 7         | (2.528)                         | (0,00)               |
| 6.790.805 CAD      | 4.900.245 US\$      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 6         | (176.194)                       | (0,02)               |
| 1.710.000 CAD      | 1.197.829 US\$      | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 19        | (5.530)                         | (0,00)               |
| 1.230.000 CAD      | 859.477 US\$        | 19.03.2025       | UBS AG                         | 8         | (1.859)                         | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Devisenterminkontrakte (5,69 %) (31. Dezember 2023: (3,25 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 1.393.092 CAD      | 1.010.558 US\$      | 16.01.2025       | UBS AG                         | 1         | (41.448)                        | (0,01)               |
| 2.282.297 CAD      | 1.641.333 US\$      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 2         | (53.644)                        | (0,01)               |
| 3.708.136 CHF      | 4.282.842 US\$      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 6         | (184.981)                       | (0,03)               |
| 3.000.000 CHF      | 3.359.133 US\$      | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (40.706)                        | (0,01)               |
| 140.365 CHF        | 125.000 £           | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (1.258)                         | (0,00)               |
| 4.750.000 CHF      | 831.235.148 ¥       | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | (48.497)                        | (0,01)               |
| 14.315.846 CHF     | 15.375.000 €        | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 3         | (99.132)                        | (0,01)               |
| 310.000 CHF        | 348.150 US\$        | 19.03.2025       | Royal Bank of Scotland         | 4         | (3.220)                         | (0,00)               |
| 260.000 CHF        | 292.983 US\$        | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 11        | (3.689)                         | (0,00)               |
| 4.491.109 CHF      | 5.144.954 US\$      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 11        | (181.827)                       | (0,02)               |
| 260.000 CHF        | 292.826 US\$        | 19.03.2025       | UBS AG                         | 8         | (3.532)                         | (0,00)               |
| 1.087.744 CHF      | 1.264.543 US\$      | 16.01.2025       | UBS AG                         | 2         | (62.477)                        | (0,01)               |
| 218.561 CHF        | 247.829 US\$        | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 1         | (6.298)                         | (0,00)               |
| 63.550.000 CLP     | 64.127 US\$         | 19.03.2025       | Barclays Bank Plc              | 3         | (285)                           | (0,00)               |
| 194.154.292 CLP    | 200.000 US\$        | 09.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 3         | (4.783)                         | (0,00)               |
| 194.172.806 CLP    | 200.000 US\$        | 10.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (4.766)                         | (0,00)               |
| 98.305.400 CLP     | 100.000 US\$        | 17.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (1.165)                         | (0,00)               |
| 197.794.808 CLP    | 200.000 US\$        | 21.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (1.150)                         | (0,00)               |
| 99.134.398 CLP     | 100.000 US\$        | 23.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (339)                           | (0,00)               |
| 97.327.402 CLP     | 100.000 US\$        | 06.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (2.138)                         | (0,00)               |
| 98.024.150 CLP     | 100.376 US\$        | 02.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | (1.813)                         | (0,00)               |
| 137.480.000 CLP    | 138.444 US\$        | 19.03.2025       | UBS AG                         | 2         | (332)                           | (0,00)               |
| 300.000 CNY        | 41.295 US\$         | 19.03.2025       | Barclays Bank Plc              | 1         | (361)                           | (0,00)               |
| 1.270.000 CNY      | 174.369 US\$        | 19.03.2025       | BNP Paribas                    | 2         | (1.080)                         | (0,00)               |
| 3.370.000 CNY      | 462.583 US\$        | 19.03.2025       | Citibank NA                    | 3         | (2.753)                         | (0,00)               |
| 17.525.510 CNY     | 2.400.160 US\$      | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | (12.701)                        | (0,00)               |
| 180.853.025 CNY    | 24.797.221 US\$     | 19.03.2025       | Royal Bank of Canada           | 2         | (120.149)                       | (0,02)               |
| 8.842.845 CNY      | 1.236.091 US\$      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 2         | (31.635)                        | (0,01)               |
| 370.000 CNY        | 50.799 US\$         | 19.03.2025       | UBS AG                         | 1         | (313)                           | (0,00)               |
| 107.140.000 COP    | 24.421 US\$         | 19.03.2025       | Barclays Bank Plc              | 1         | (349)                           | (0,00)               |
| 296.350.000 COP    | 67.155 US\$         | 19.03.2025       | BNP Paribas                    | 2         | (573)                           | (0,00)               |
| 290.860.000 COP    | 65.393 US\$         | 19.03.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | (44)                            | (0,00)               |
| 880.249.986 COP    | 200.000 US\$        | 31.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | (995)                           | (0,00)               |
| 1.755.993.146 COP  | 400.000 US\$        | 13.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 3         | (1.979)                         | (0,00)               |
| 436.930.236 COP    | 100.000 US\$        | 03.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (823)                           | (0,00)               |
| 437.881.550 COP    | 100.000 US\$        | 27.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (948)                           | (0,00)               |
| 1.325.296.626 COP  | 300.000 US\$        | 23.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (35)                            | (0,00)               |
| 280.580.000 COP    | 63.675 US\$         | 19.03.2025       | Royal Bank of Canada           | 2         | (636)                           | (0,00)               |
| 250.480.000 COP    | 56.753 US\$         | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 2         | (477)                           | (0,00)               |
| 68.550.000 CZK     | 1.128.184.247 HUF   | 19.03.2025       | BNP Paribas                    | 3         | (5.849)                         | (0,00)               |
| 1.860.000 CZK      | 77.048 US\$         | 19.03.2025       | Citibank NA                    | 2         | (442)                           | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (5,69 %) (31. Dezember 2023: (3,25 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 2.330.000 CZK      | 38.334.446 HUF      | 19.03.2025       | Citibank NA                    | 3         | (170)                           | (0,00)               |
| 3.400.000 CZK      | 56.570.305 HUF      | 19.03.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | (1.829)                         | (0,00)               |
| 4.831.618 CZK      | 200.000 US\$        | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (1.197)                         | (0,00)               |
| 3.490.000 CZK      | 144.486 US\$        | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 2         | (749)                           | (0,00)               |
| 5.842.015 CZK      | 245.847 US\$        | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 2         | (5.500)                         | (0,00)               |
| 9 CZK              | 0 US\$              | 16.01.2025       | UBS AG                         | 1         | (0)                             | (0,00)               |
| 2.380.000 CZK      | 39.233.435 HUF      | 19.03.2025       | UBS AG                         | 2         | (363)                           | (0,00)               |
| 205.588.500 EGP    | 4.055.000 US\$      | 15.01.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | (28.432)                        | (0,01)               |
| 20.000 €           | 20.904 US\$         | 19.03.2025       | Barclays Bank Plc              | 1         | (126)                           | (0,00)               |
| 100.000 €          | 41.741.804 HUF      | 19.03.2025       | Barclays Bank Plc              | 2         | (782)                           | (0,00)               |
| 130.000 €          | 5.167.604 TRY       | 19.03.2025       | Barclays Bank Plc              | 3         | (873)                           | (0,00)               |
| 110.000 €          | 114.888 US\$        | 19.03.2025       | Citibank NA                    | 3         | (605)                           | (0,00)               |
| 110.000 €          | 4.441.542 TRY       | 19.03.2025       | Citibank NA                    | 3         | (2.554)                         | (0,00)               |
| 44.130 €           | 190.000 PLN         | 19.03.2025       | Citibank NA                    | 1         | (20)                            | (0,00)               |
| 120.000 €          | 126.620 US\$        | 19.03.2025       | Deutsche Bank AG               | 1         | (1.948)                         | (0,00)               |
| 60.000 €           | 9.779.119 ¥         | 19.03.2025       | Deutsche Bank AG               | 2         | (435)                           | (0,00)               |
| 60.000 €           | 25.053.476 HUF      | 19.03.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | (490)                           | (0,00)               |
| 300.000 €          | 49.000.299 ¥        | 19.03.2025       | Goldman Sachs International    | 6         | (2.846)                         | (0,00)               |
| 60.000 €           | 62.612 US\$         | 19.03.2025       | Goldman Sachs International    | 2         | (276)                           | (0,00)               |
| 2.400.000 €        | 2.531.722 US\$      | 31.01.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | (43.675)                        | (0,01)               |
| 5.329.664 €        | 5.737.753 US\$      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 8         | (215.952)                       | (0,03)               |
| 10.000 €           | 10.538 US\$         | 19.03.2025       | HSBC Bank Plc                  | 1         | (148)                           | (0,00)               |
| 125.000 €          | 117.370 CHF         | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (280)                           | (0,00)               |
| 8.250.000 €        | 12.363.742 CAD      | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | (53.359)                        | (0,01)               |
| 12.000.000 €       | 137.680.295 SEK     | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (38.120)                        | (0,01)               |
| 3.900.000 €        | 638.729.927 ¥       | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 3         | (32.709)                        | (0,00)               |
| 2.375.000 €        | 2.473.079 US\$      | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 4         | (11.653)                        | (0,00)               |
| 2.300.000 €        | 1.911.442 £         | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | (9.753)                         | (0,00)               |
| 1.500.000 €        | 621.749.880 HUF     | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (8.780)                         | (0,00)               |
| 8.500.000 €        | 100.321.948 NOK     | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | (23.521)                        | (0,00)               |
| 4.000.000 €        | 6.712.573 AUD       | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (10.658)                        | (0,00)               |
| 120.000 €          | 19.483.606 ¥        | 19.03.2025       | Royal Bank of Scotland         | 4         | (390)                           | (0,00)               |
| 810.000 €          | 847.582 US\$        | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 16        | (6.054)                         | (0,00)               |
| 12.657.347 €       | 13.538.119 US\$     | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 22        | (424.471)                       | (0,04)               |
| 30.000 €           | 4.869.997 ¥         | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (92)                            | (0,00)               |
| 127.654 €          | 550.000 PLN         | 19.03.2025       | UBS AG                         | 4         | (155)                           | (0,00)               |
| 32.674.552 €       | 35.719.871 US\$     | 16.01.2025       | UBS AG                         | 3         | (1.867.389)                     | (0,23)               |
| 60.000 €           | 24.917.723 HUF      | 19.03.2025       | UBS AG                         | 3         | (150)                           | (0,00)               |
| 472.031 €          | 506.083 US\$        | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 2         | (17.036)                        | (0,00)               |
| 1.350.000 £        | 1.712.651 US\$      | 19.03.2025       | Citibank NA                    | 7         | (22.871)                        | (0,00)               |
| 30.000 £           | 5.870.984 ¥         | 19.03.2025       | Deutsche Bank AG               | 1         | (134)                           | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Devisenterminkontrakte (5,69 %) (31. Dezember 2023: (3,25 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 40.000 £           | 50.828 US\$         | 19.03.2025       | Deutsche Bank AG               | 1         | (760)                           | (0,00)               |
| 2.556.608 £        | 3.252.024 US\$      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 3         | (50.493)                        | (0,01)               |
| 3.800.000 £        | 4.831.746 US\$      | 31.01.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | (73.794)                        | (0,01)               |
| 170.000 £          | 215.753 US\$        | 19.03.2025       | Goldman Sachs International    | 2         | (2.965)                         | (0,00)               |
| 160.000 £          | 31.393.090 ¥        | 19.03.2025       | Goldman Sachs International    | 2         | (1.237)                         | (0,00)               |
| 10.375.000 £       | 21.027.186 AUD      | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (28.123)                        | (0,01)               |
| 15.739.260 £       | 19.100.000 €        | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (86.824)                        | (0,02)               |
| 5.750.000 £        | 1.136.036.815 ¥     | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (47.110)                        | (0,01)               |
| 5.875.000 £        | 7.434.243 US\$      | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (77.748)                        | (0,01)               |
| 5.302.194 £        | 6.792.110 US\$      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 10        | (152.400)                       | (0,02)               |
| 410.000 £          | 80.336.275 ¥        | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 8         | (2.474)                         | (0,00)               |
| 150.000 £          | 189.776 US\$        | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 3         | (2.022)                         | (0,00)               |
| 1.793.948 £        | 2.282.451 US\$      | 16.01.2025       | UBS AG                         | 2         | (35.967)                        | (0,01)               |
| 1.373.037 £        | 1.719.456 US\$      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 1         | (60)                            | (0,00)               |
| 37.274.553 HUF     | 90.000 €            | 19.03.2025       | Barclays Bank Plc              | 2         | (31)                            | (0,00)               |
| 37.275.207 HUF     | 90.000 €            | 19.03.2025       | BNP Paribas                    | 3         | (29)                            | (0,00)               |
| 41.401.115 HUF     | 100.000 €           | 19.03.2025       | Citibank NA                    | 3         | (72)                            | (0,00)               |
| 193.768.308 HUF    | 11.810.000 CZK      | 19.03.2025       | Citibank NA                    | 8         | (492)                           | (0,00)               |
| 78.586.033 HUF     | 190.000 €           | 19.03.2025       | Goldman Sachs International    | 3         | (328)                           | (0,00)               |
| 49.915.252 HUF     | 127.212 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | (1.646)                         | (0,00)               |
| 373.187.803 HUF    | 995.623 US\$        | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (56.835)                        | (0,01)               |
| 99.166.831 HUF     | 240.000 €           | 19.03.2025       | UBS AG                         | 7         | (665)                           | (0,00)               |
| 654.791.452 HUF    | 1.742.162 US\$      | 16.01.2025       | UBS AG                         | 3         | (94.975)                        | (0,01)               |
| 79.280.000 HUF     | 200.894 US\$        | 19.03.2025       | UBS AG                         | 3         | (2.085)                         | (0,00)               |
| 7.972.113.792 IDR  | 502.643 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 2         | (9.961)                         | (0,00)               |
| 11.395.650.928 IDR | 731.415 US\$        | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (27.155)                        | (0,01)               |
| 8.240.000 ILS      | 2.313.275 US\$      | 19.03.2025       | BNP Paribas                    | 3         | (47.381)                        | (0,00)               |
| 150.000 ILS        | 41.818 US\$         | 19.03.2025       | Deutsche Bank AG               | 1         | (570)                           | (0,00)               |
| 13.001.522 ILS     | 3.600.000 US\$      | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | (29.909)                        | (0,00)               |
| 2.600.000 ILS      | 726.337 US\$        | 19.03.2025       | UBS AG                         | 10        | (11.369)                        | (0,00)               |
| 19.310.000 INR     | 225.944 US\$        | 19.03.2025       | Barclays Bank Plc              | 4         | (1.944)                         | (0,00)               |
| 5.000.000 INR      | 58.569 US\$         | 19.03.2025       | BNP Paribas                    | 2         | (567)                           | (0,00)               |
| 6.040.000 INR      | 70.067 US\$         | 19.03.2025       | Citibank NA                    | 1         | (1)                             | (0,00)               |
| 105.060.077 INR    | 1.245.348 US\$      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | (19.440)                        | (0,00)               |
| 8.514.213 INR      | 100.000 US\$        | 21.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (704)                           | (0,00)               |
| 1.084.921.269 INR  | 12.760.997 US\$     | 03.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (88.719)                        | (0,01)               |
| 8.555.678 INR      | 100.000 US\$        | 30.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (316)                           | (0,00)               |
| 42.404.739 INR     | 500.000 US\$        | 10.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (4.878)                         | (0,00)               |
| 8.487.963 INR      | 100.000 US\$        | 09.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (888)                           | (0,00)               |
| 16.999.799 INR     | 200.000 US\$        | 06.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | (1.467)                         | (0,00)               |
| 79.375.528 INR     | 927.083 US\$        | 13.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | (582)                           | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (5,69 %) (31. Dezember 2023: (3,25 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 19.510.000 INR     | 228.379 US\$        | 19.03.2025       | Royal Bank of Canada           | 3         | (2.057)                         | (0,00)               |
| 80.000 INR         | 936 US\$            | 19.03.2025       | Société Générale               | 2         | (8)                             | (0,00)               |
| 100.000 INR        | 1.171 US\$          | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (11)                            | (0,00)               |
| 42.576.003 INR     | 504.774 US\$        | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 2         | (7.970)                         | (0,00)               |
| 19.240.000 INR     | 224.581 US\$        | 19.03.2025       | UBS AG                         | 5         | (1.391)                         | (0,00)               |
| 60.188.329 ¥       | 380.000 €           | 19.03.2025       | Barclays Bank Plc              | 1         | (8.453)                         | (0,00)               |
| 96.106.902 ¥       | 1.000.000 AUD       | 19.03.2025       | Citibank NA                    | 5         | (2.320)                         | (0,00)               |
| 21.741.290 ¥       | 250.000 NZD         | 19.03.2025       | Citibank NA                    | 4         | (625)                           | (0,00)               |
| 7.770.783 ¥        | 40.000 £            | 19.03.2025       | Citibank NA                    | 1         | (188)                           | (0,00)               |
| 11.570.941 ¥       | 120.000 AUD         | 19.03.2025       | Deutsche Bank AG               | 1         | (34)                            | (0,00)               |
| 3.527.384.635 ¥    | 23.577.143 US\$     | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 9         | (1.097.238)                     | (0,15)               |
| 130.498.320 ¥      | 1.200.000 CAD       | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (2.562)                         | (0,00)               |
| 343.272.881 ¥      | 1.750.000 £         | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | (1.467)                         | (0,00)               |
| 462.500.000 ¥      | 2.953.362 US\$      | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | (2.951)                         | (0,00)               |
| 6.970.568 ¥        | 80.000 NZD          | 19.03.2025       | Royal Bank of Scotland         | 1         | (115)                           | (0,00)               |
| 3.168.846 ¥        | 20.000 €            | 19.03.2025       | Royal Bank of Scotland         | 1         | (438)                           | (0,00)               |
| 46.249.485 ¥       | 530.000 NZD         | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 3         | (312)                           | (0,00)               |
| 15.940.000 ¥       | 103.240 US\$        | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 2         | (923)                           | (0,00)               |
| 67.202.820 ¥       | 700.000 AUD         | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 7         | (2.087)                         | (0,00)               |
| 64.105.816 ¥       | 330.000 £           | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 5         | (1.572)                         | (0,00)               |
| 1.063.081.665 ¥    | 7.038.590 US\$      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 10        | (263.605)                       | (0,03)               |
| 1.840.405.223 ¥    | 12.229.476 US\$     | 16.01.2025       | UBS AG                         | 8         | (500.635)                       | (0,06)               |
| 212.777.702 ¥      | 2.220.000 AUD       | 19.03.2025       | UBS AG                         | 3         | (8.872)                         | (0,01)               |
| 114.956.083 ¥      | 751.324 US\$        | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 2         | (18.712)                        | (0,00)               |
| 1.276.430.000 KRW  | 871.051 US\$        | 19.03.2025       | Citibank NA                    | 6         | (4.968)                         | (0,00)               |
| 15.765.147.374 KRW | 10.900.000 US\$     | 16.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (227.368)                       | (0,03)               |
| 1.145.440.252 KRW  | 800.000 US\$        | 13.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 5         | (24.601)                        | (0,00)               |
| 144.733.149 KRW    | 100.000 US\$        | 23.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (2.008)                         | (0,00)               |
| 17.008.017.612 KRW | 11.900.000 US\$     | 09.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 3         | (381.357)                       | (0,05)               |
| 848.630.272 KRW    | 600.000 US\$        | 03.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (23.544)                        | (0,00)               |
| 1.402.902.478 KRW  | 1.000.000 US\$      | 06.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 6         | (48.464)                        | (0,00)               |
| 142.965.375 KRW    | 100.000 US\$        | 10.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (3.225)                         | (0,00)               |
| 350.610.000 KRW    | 243.791 US\$        | 19.03.2025       | Royal Bank of Canada           | 4         | (5.895)                         | (0,00)               |
| 70.670.000 KRW     | 48.092 US\$         | 19.03.2025       | Royal Bank of Scotland         | 1         | (140)                           | (0,00)               |
| 15.860.000 KRW     | 10.990 US\$         | 19.03.2025       | Société Générale               | 1         | (228)                           | (0,00)               |
| 523.881.474 KRW    | 375.479 US\$        | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 2         | (20.824)                        | (0,00)               |
| 98.200.000 KRW     | 68.000 US\$         | 19.03.2025       | UBS AG                         | 1         | (1.369)                         | (0,00)               |
| 676.757.211 KRW    | 496.789 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                         | 2         | (38.641)                        | (0,00)               |
| 1.733.035 MXN      | 120.000 CAD         | 19.03.2025       | BNP Paribas                    | 2         | (1.379)                         | (0,00)               |
| 581.464 MXN        | 40.000 CAD          | 19.03.2025       | Citibank NA                    | 1         | (280)                           | (0,00)               |
| 15.761.956 MXN     | 763.153 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 2         | (6.885)                         | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Devisenterminkontrakte (5,69 %) (31. Dezember 2023: (3,25 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 1.589.476 MXN      | 110.000 CAD         | 19.03.2025       | Goldman Sachs International    | 2         | (1.223)                         | (0,00)               |
| 18.000.000 MXN     | 883.141 US\$        | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | (20.801)                        | (0,00)               |
| 1.710.229 MXN      | 120.000 CAD         | 19.03.2025       | Royal Bank of Canada           | 2         | (2.462)                         | (0,00)               |
| 6.520.000 MXN      | 318.809 US\$        | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 4         | (9.214)                         | (0,00)               |
| 31.743.650 MXN     | 1.551.931 US\$      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 4         | (28.851)                        | (0,00)               |
| 26.244.040 MXN     | 1.284.709 US\$      | 16.01.2025       | UBS AG                         | 1         | (25.504)                        | (0,00)               |
| 860.000 MXN        | 41.998 US\$         | 19.03.2025       | UBS AG                         | 1         | (1.161)                         | (0,00)               |
| 717.977 MXN        | 50.000 CAD          | 19.03.2025       | UBS AG                         | 1         | (770)                           | (0,00)               |
| 1.090.000 NOK      | 97.243 US\$         | 19.03.2025       | Citibank NA                    | 2         | (1.289)                         | (0,00)               |
| 25.067.570 NOK     | 2.260.771 US\$      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 5         | (53.656)                        | (0,00)               |
| 530.000 NOK        | 46.698 US\$         | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (41)                            | (0,00)               |
| 66.217.531 NOK     | 6.018.872 US\$      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 13        | (188.642)                       | (0,03)               |
| 8.275.587 NOK      | 748.612 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                         | 1         | (19.975)                        | (0,00)               |
| 50.000 NZD         | 4.383.711 ¥         | 19.03.2025       | Barclays Bank Plc              | 1         | (102)                           | (0,00)               |
| 180.000 NZD        | 101.907 US\$        | 19.03.2025       | Citibank NA                    | 4         | (977)                           | (0,00)               |
| 310.000 NZD        | 27.239.792 ¥        | 19.03.2025       | Citibank NA                    | 5         | (1.025)                         | (0,00)               |
| 130.000 NZD        | 11.430.832 ¥        | 19.03.2025       | Deutsche Bank AG               | 1         | (479)                           | (0,00)               |
| 2.122.110 NZD      | 1.270.136 US\$      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | (81.136)                        | (0,01)               |
| 220.000 NZD        | 124.376 US\$        | 19.03.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 4         | (1.019)                         | (0,00)               |
| 600.000 NZD        | 53.191.602 ¥        | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (3.131)                         | (0,00)               |
| 210.000 NZD        | 18.532.103 ¥        | 19.03.2025       | Royal Bank of Scotland         | 3         | (1.204)                         | (0,00)               |
| 550.000 NZD        | 315.446 US\$        | 19.03.2025       | Royal Bank of Scotland         | 6         | (7.052)                         | (0,00)               |
| 6.354.832 NZD      | 3.786.036 US\$      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 7         | (225.479)                       | (0,04)               |
| 260.000 NZD        | 22.946.962 ¥        | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 3         | (1.507)                         | (0,00)               |
| 50.000 NZD         | 28.149 US\$         | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (113)                           | (0,00)               |
| 2.142.562 NZD      | 1.262.261 US\$      | 16.01.2025       | UBS AG                         | 2         | (61.802)                        | (0,01)               |
| 130.000 NZD        | 74.788 US\$         | 19.03.2025       | UBS AG                         | 3         | (1.895)                         | (0,00)               |
| 6.554.735 NZD      | 3.925.620 US\$      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 6         | (253.056)                       | (0,03)               |
| 86.170.000 PHP     | 1.474.810 US\$      | 19.03.2025       | Barclays Bank Plc              | 6         | (837)                           | (0,00)               |
| 31.880.000 PHP     | 545.526 US\$        | 19.03.2025       | BNP Paribas                    | 3         | (205)                           | (0,00)               |
| 6.780.000 PHP      | 116.305 US\$        | 19.03.2025       | UBS AG                         | 1         | (330)                           | (0,00)               |
| 580.000 PLN        | 135.024 €           | 19.03.2025       | Barclays Bank Plc              | 1         | (259)                           | (0,00)               |
| 330.000 PLN        | 80.935 US\$         | 19.03.2025       | Citibank NA                    | 1         | (1.268)                         | (0,00)               |
| 660.000 PLN        | 153.854 €           | 19.03.2025       | Citibank NA                    | 2         | (510)                           | (0,00)               |
| 1.750.000 PLN      | 429.782 US\$        | 19.03.2025       | Goldman Sachs International    | 4         | (7.306)                         | (0,00)               |
| 2.057.896 PLN      | 500.128 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | (2.132)                         | (0,00)               |
| 450.000 PLN        | 104.790 €           | 19.03.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | (234)                           | (0,00)               |
| 7.695.221 PLN      | 1.800.000 €         | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | (3.886)                         | (0,00)               |
| 410.516 PLN        | 100.000 US\$        | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (689)                           | (0,00)               |
| 910.000 PLN        | 221.922 US\$        | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 2         | (2.235)                         | (0,00)               |
| 14.217.140 PLN     | 3.527.998 US\$      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 9         | (87.555)                        | (0,01)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (5,69 %) (31. Dezember 2023: (3,25 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 700.000 PLN        | 163.002 €           | 19.03.2025       | UBS AG                         | 1         | (358)                           | (0,00)               |
| 2.037.040 PLN      | 495.731 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                         | 1         | (2.782)                         | (0,00)               |
| 410.000 RON        | 85.623 US\$         | 19.03.2025       | BNP Paribas                    | 1         | (693)                           | (0,00)               |
| 2.180.000 RON      | 455.305 US\$        | 19.03.2025       | Deutsche Bank AG               | 5         | (3.723)                         | (0,00)               |
| 580.000 RON        | 120.560 US\$        | 19.03.2025       | Goldman Sachs International    | 2         | (415)                           | (0,00)               |
| 5.530.000 SEK      | 508.183 US\$        | 19.03.2025       | Citibank NA                    | 4         | (5.653)                         | (0,00)               |
| 70.663.749 SEK     | 6.512.272 US\$      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 15        | (112.500)                       | (0,00)               |
| 1.101.700 SEK      | 100.000 US\$        | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (178)                           | (0,00)               |
| 482.362 SEK        | 500.000 NOK         | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (317)                           | (0,00)               |
| 43 SEK             | 4 US\$              | 02.01.2025       | Société Générale               | 1         | (0)                             | (0,00)               |
| 76.422.355 SEK     | 7.172.597 US\$      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 13        | (251.289)                       | (0,02)               |
| 240.000 SEK        | 22.038 US\$         | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (228)                           | (0,00)               |
| 5.514.762 SEK      | 505.011 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                         | 1         | (5.558)                         | (0,00)               |
| 2.572.519 SEK      | 250.983 US\$        | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 1         | (17.999)                        | (0,00)               |
| 2.311.242 SGD      | 1.700.000 US\$      | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (4.243)                         | (0,00)               |
| 1.010.000 SGD      | 745.665 US\$        | 19.03.2025       | UBS AG                         | 5         | (3.063)                         | (0,00)               |
| 3.890.000 THB      | 115.574 US\$        | 19.03.2025       | BNP Paribas                    | 1         | (913)                           | (0,00)               |
| 5.860.000 THB      | 173.049 US\$        | 19.03.2025       | Deutsche Bank AG               | 1         | (321)                           | (0,00)               |
| 31.590.000 THB     | 938.160 US\$        | 19.03.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | (7.022)                         | (0,00)               |
| 2.970.000 THB      | 88.195 US\$         | 19.03.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (652)                           | (0,00)               |
| 1.200.000 TRY      | 31.600 US\$         | 19.03.2025       | Citibank NA                    | 1         | (33)                            | (0,00)               |
| 46.867.562 TRY     | 1.300.000 US\$      | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | (2.753)                         | (0,00)               |
| 6.502.034 TWD      | 200.000 US\$        | 02.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (1.674)                         | (0,00)               |
| 7.094.974 TWD      | 219.153 US\$        | 13.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | (3.355)                         | (0,00)               |
| 6.513.083 TWD      | 200.000 US\$        | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (1.900)                         | (0,00)               |
| 9.721.373 TWD      | 300.000 US\$        | 16.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 3         | (4.319)                         | (0,00)               |
| 1.507.064 US\$     | 89.450.000 PHP      | 19.03.2025       | Barclays Bank Plc              | 9         | (23.014)                        | (0,00)               |
| 185.208 US\$       | 7.120.000 TRY       | 19.03.2025       | Barclays Bank Plc              | 1         | (2.085)                         | (0,00)               |
| 819.369 US\$       | 28.210.000 THB      | 19.03.2025       | BNP Paribas                    | 4         | (12.140)                        | (0,00)               |
| 59.815 US\$        | 680.000 NOK         | 19.03.2025       | BNP Paribas                    | 1         | (47)                            | (0,00)               |
| 98.812 US\$        | 3.800.000 TRY       | 19.03.2025       | BNP Paribas                    | 2         | (1.148)                         | (0,00)               |
| 47.923 US\$        | 300.000 BRL         | 19.03.2025       | Citibank NA                    | 1         | (5)                             | (0,00)               |
| 32.898 US\$        | 1.270.000 TRY       | 19.03.2025       | Citibank NA                    | 1         | (509)                           | (0,00)               |
| 705.116 US\$       | 41.770.000 PHP      | 19.03.2025       | Deutsche Bank AG               | 5         | (9.377)                         | (0,00)               |
| 506.710 US\$       | 18.505.055 TRY      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | (9.912)                         | (0,00)               |
| 1.120.165 US\$     | 4.100.000 ILS       | 19.03.2025       | Goldman Sachs International    | 8         | (7.285)                         | (0,00)               |
| 87.546 US\$        | 70.000 £            | 19.03.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | (72)                            | (0,00)               |
| 920.159 US\$       | 53.810.000 PHP      | 19.03.2025       | HSBC Bank Plc                  | 1         | (283)                           | (0,00)               |
| 100.000 US\$       | 99.560.593 CLP      | 03.02.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (77)                            | (0,00)               |
| 400.000 US\$       | 399.054.480 CLP     | 23.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (1.175)                         | (0,00)               |
| 200.000 US\$       | 1.236.966 BRL       | 03.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | (226)                           | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

## Devisenterminkontrakte (5,69 %) (31. Dezember 2023: (3,25 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag              | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| 800.000 US\$                    | 4.997.492 BRL       | 04.02.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | (3.975)                         | (0,00)               |
| 5.078.304 US\$                  | 4.062.500 £         | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | (8.634)                         | (0,00)               |
| 9.200.000 US\$                  | 3.668.642.160 HUF   | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 3         | (24.653)                        | (0,00)               |
| 100.000 US\$                    | 444.140.463 COP     | 03.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (814)                           | (0,00)               |
| 100.000 US\$                    | 1.136.509 NOK       | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (64)                            | (0,00)               |
| 300.000 US\$                    | 1.329.706.604 COP   | 03.02.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 3         | (493)                           | (0,00)               |
| 139.052 US\$                    | 200.000 CAD         | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (122)                           | (0,00)               |
| 7.500.000 US\$                  | 272.823.643 TRY     | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | (51.482)                        | (0,01)               |
| 187.610 US\$                    | 150.000 £           | 19.03.2025       | Royal Bank of Canada           | 3         | (144)                           | (0,00)               |
| 10.009.543 US\$                 | 77.718.755 HKD      | 19.03.2025       | Royal Bank of Canada           | 1         | (5.118)                         | (0,00)               |
| 487.219 US\$                    | 10.217.817 MXN      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (3.038)                         | (0,00)               |
| 1.543.629 US\$                  | 5.711.641 ILS       | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 2         | (24.375)                        | (0,00)               |
| 187.490 US\$                    | 150.000 £           | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 3         | (263)                           | (0,00)               |
| 71.518 US\$                     | 71.220.000 CLP      | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (29)                            | (0,00)               |
| 232.735 US\$                    | 2.650.000 NOK       | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 4         | (550)                           | (0,00)               |
| 44.492 US\$                     | 40.000 CHF          | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (15)                            | (0,00)               |
| 145.615 US\$                    | 648.840.000 COP     | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (163)                           | (0,00)               |
| 353.825 US\$                    | 55.350.000 ¥        | 19.03.2025       | State Street Bank and Trust Co | 5         | (1.458)                         | (0,00)               |
| 54.072 US\$                     | 8.450.000 ¥         | 19.03.2025       | UBS AG                         | 1         | (167)                           | (0,00)               |
| 187.330 US\$                    | 1.180.000 BRL       | 19.03.2025       | UBS AG                         | 2         | (1.184)                         | (0,00)               |
| 62.752 US\$                     | 90.000 CAD          | 19.03.2025       | UBS AG                         | 1         | (1)                             | (0,00)               |
| 112.540 US\$                    | 90.000 £            | 19.03.2025       | UBS AG                         | 1         | (112)                           | (0,00)               |
| 377.410 US\$                    | 22.230.000 PHP      | 19.03.2025       | UBS AG                         | 2         | (2.843)                         | (0,00)               |
| 1.529.015 US\$                  | 55.691.789 TRY      | 16.01.2025       | UBS AG                         | 2         | (25.783)                        | (0,00)               |
| 690.969 US\$                    | 2.530.000 ILS       | 19.03.2025       | UBS AG                         | 4         | (4.750)                         | (0,00)               |
| 86.189 US\$                     | 980.000 NOK         | 19.03.2025       | UBS AG                         | 1         | (82)                            | (0,00)               |
| 1.001.375 US\$                  | 3.764.170 ILS       | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 1         | (31.993)                        | (0,01)               |
| 9.570.000 ZAR                   | 531.734 US\$        | 19.03.2025       | Citibank NA                    | 3         | (28.040)                        | (0,00)               |
| 935.907 ZAR                     | 2.000.000 TRY       | 19.03.2025       | Citibank NA                    | 1         | (3.352)                         | (0,00)               |
| 535.228 ZAR                     | 1.130.000 TRY       | 19.03.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | (1.555)                         | (0,00)               |
| 10.030.000 ZAR                  | 558.025 US\$        | 19.03.2025       | Goldman Sachs International    | 9         | (30.119)                        | (0,00)               |
| 390.000 ZAR                     | 21.623 US\$         | 19.03.2025       | HSBC Bank Plc                  | 1         | (1.096)                         | (0,00)               |
| 3.330.663 ZAR                   | 6.710.000 TRY       | 19.03.2025       | HSBC Bank Plc                  | 2         | (1.207)                         | (0,00)               |
| 3.270.000 ZAR                   | 181.664 US\$        | 19.03.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 2         | (9.557)                         | (0,00)               |
| 100.655.027 ZAR                 | 5.500.000 US\$      | 24.01.2025       | JPMorgan Chase Bank            | 1         | (176.685)                       | (0,02)               |
| 57.847.015 ZAR                  | 3.267.186 US\$      | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 4         | (205.417)                       | (0,04)               |
| 3.890.000 ZAR                   | 215.853 US\$        | 19.03.2025       | UBS AG                         | 3         | (11.112)                        | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i> |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 3.420 CHF                       | 3.805 US\$          | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (25)                            | (0,00)               |
| 23.344 CHF                      | 26.626 US\$         | 16.01.2025       | UBS AG                         | 3         | (829)                           | (0,00)               |
| 5.646.478 CHF                   | 6.662.507 US\$      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 6         | (422.581)                       | (0,05)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (5,69 %) (31. Dezember 2023: (3,25 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                    | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>   |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 403.553 €   | 443.676 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 2         | (25.575)                        | (0,00)               |
| 514.070 €   | 547.006 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                         | 5         | (14.404)                        | (0,00)               |
| 41.923.400 €  | 46.205.290 US\$     | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 14        | (2.770.534)                     | (0,34)               |
| 5.322 US\$  | 5.137 €             | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 1         | (0)                             | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>   |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 14.051.680 £  | 18.000.577 US\$     | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 2         | (404.259)                       | (0,05)               |
| 457.946.070 £   | 599.752.538 US\$    | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 5         | (26.286.279)                    | (3,26)               |
| 3.757.024 £   | 4.774.730 US\$      | 16.01.2025       | UBS AG                         | 1         | (69.970)                        | (0,01)               |
| 11.838.648 £  | 15.598.085 US\$     | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 28        | (773.055)                       | (0,10)               |
| 1.146.885 US\$  | 916.372 £           | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 2         | (649)                           | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen JPY</i>   |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 31.076.666 ¥  | 201.738 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 1         | (3.688)                         | (0,00)               |
| 3.856.946.608 ¥   | 26.298.880 US\$     | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 8         | (1.718.688)                     | (0,21)               |
| 22.654.125 ¥  | 160.504 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                         | 1         | (16.130)                        | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>   |                     |                  |                                |           |                                 |                      |
| 11.481 SGD  | 8.721 US\$          | 16.01.2025       | Goldman Sachs International    | 2         | (300)                           | (0,00)               |
| 121.446 SGD   | 90.867 US\$         | 16.01.2025       | State Street Bank and Trust Co | 1         | (1.793)                         | (0,00)               |
| 1.191.538 SGD   | 907.287 US\$        | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp           | 23        | (33.361)                        | (0,01)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>oo</sup></b> |                     |                  |                                |           | <b>(45.926.653)</b>             | <b>(5,69)</b>        |

### Futures-Kontrakte (1,42 %) (31. Dezember 2023: (1,51 %))

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung  | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|------------------|---|---------------------------------|----------------------|
| (2)              | 1 Month SOFR Future May 2025                            | (167)                           | (0,00)               |
| (3)              | 10-Year Mini Japanese Government Bond Future March 2025 | (76)                            | (0,00)               |
| (407)            | 3 Month CORRA Future September 2025                     | (190.273)                       | (0,02)               |
| (26)             | 3 Month SOFR Future June 2025                           | (3.113)                         | (0,00)               |
| (23)             | 3 Month SOFR Future March 2025                          | (2.866)                         | (0,00)               |
| 187              | 3 Month SOFR Future March 2028                          | (311.875)                       | (0,04)               |
| 333              | 3 Month SONIA Future December 2025                      | (253.653)                       | (0,03)               |
| (25)             | 3 Month SONIA Future December 2026                      | (5.401)                         | (0,00)               |
| (28)             | 3 Month SONIA Future June 2026                          | (5.683)                         | (0,00)               |
| (29)             | 3 Month SONIA Future June 2027                          | (4.931)                         | (0,00)               |
| (29)             | 3 Month SONIA Future March 2027                         | (5.323)                         | (0,00)               |
| (29)             | 3 Month SONIA Future September 2026                     | (6.090)                         | (0,00)               |
| (30)             | 3 Month SONIA Future September 2027                     | (4.947)                         | (0,00)               |
| 942              | 3-Month Euro EURIBOR Future December 2025               | (492)                           | (0,00)               |
| 6                | 3-Month Euro EURIBOR Future December 2026               | (3.547)                         | (0,00)               |
| 1.356            | 3-Month Euro EURIBOR Future June 2025                   | (751)                           | (0,00)               |
| 14               | 3-Month Euro EURIBOR Future June 2026                   | (6.537)                         | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Futures-Kontrakte (1,42 %) (31. Dezember 2023: (1,51 %)) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung  | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|------------------|---|---------------------------------|----------------------|
| (3)              | 3-Month Euro EURIBOR Future June 2027                                 | (855)                           | (0,00)               |
| 40               | 3-Month Euro EURIBOR Future March 2025                                | (6.381)                         | (0,00)               |
| 22               | 3-Month Euro EURIBOR Future March 2026                                | (7.300)                         | (0,00)               |
| 2                | 3-Month Euro EURIBOR Future March 2027                                | (5.501)                         | (0,00)               |
| 2                | 3-Month Euro EURIBOR Future March 2028                                | (841)                           | (0,00)               |
| 634              | 3-Month Euro EURIBOR Future September 2025                            | (116.361)                       | (0,01)               |
| 7                | 3-Month Euro EURIBOR Future September 2026                            | (3.909)                         | (0,00)               |
| (2)              | 90-Day Bank Bill Future December 2025                                 | (30)                            | (0,00)               |
| (1)              | 90-Day Bank Bill Future June 2025                                     | (150)                           | (0,00)               |
| (3)              | 90-Day Bank Bill Future March 2025                                    | (927)                           | (0,00)               |
| (649)            | Australian Government Bond 3-Year Future March 2025                   | (23.612)                        | (0,00)               |
| 822              | British Pound Currency Future March 2025                              | (860.260)                       | (0,11)               |
| (304)            | CAC40 Index Future January 2025                                       | (122.982)                       | (0,02)               |
| (38)             | Canadian 10-Year Bond Future March 2025                               | (58.657)                        | (0,01)               |
| (1.289)          | Canadian Dollar Currency Future March 2025                            | (69.395)                        | (0,01)               |
| 8                | CBOE VIX Index Future April 2025                                      | (300)                           | (0,00)               |
| 45               | CBOE VIX Index Future February 2025                                   | (3.004)                         | (0,00)               |
| 380              | CBOE VIX Index Future January 2025                                    | (499.408)                       | (0,06)               |
| 7                | CBOE VIX Index Future May 2025  | (343)                           | (0,00)               |
| 30               | DAX Index Future March 2025   | (210.232)                       | (0,03)               |
| 4                | DJIA Micro E-mini Future March 2025                                   | (1.881)                         | (0,00)               |
| 123              | DJIA Mini E-CBOT Future March 2025                                    | (292.681)                       | (0,04)               |
| 2                | E-mini Consumer Discretionary Future March 2025                       | (26.180)                        | (0,00)               |
| 8                | E-mini Industrial Future March 2025                                   | (19.383)                        | (0,00)               |
| 26               | E-mini Russell 2000 Index Future March 2025                           | (162.257)                       | (0,02)               |
| 1                | E-mini Technology Future March 2025                                   | (7.930)                         | (0,00)               |
| 11               | E-mini Utilities Future March 2025                                    | (15.830)                        | (0,00)               |
| 918              | Euro FX Currency Future March 2025                                    | (867.536)                       | (0,11)               |
| 124              | EURO STOXX 50 Future March 2025                                       | (48.347)                        | (0,01)               |
| 11               | EURO STOXX 50 Index Dividend Future December 2025                     | (124)                           | (0,00)               |
| 1.463            | Euro-BOBL Future March 2025   | (1.978.188)                     | (0,25)               |
| 175              | Euro-BTP Future March 2025  | (495.155)                       | (0,06)               |
| 300              | Euro-Bund Call Option on Future January 2025, Strike Price EUR 136.00 | (98.486)                        | (0,01)               |
| 143              | Euro-Bund Future March 2025   | (114.154)                       | (0,01)               |
| (82)             | Euro-Bund Put Option on Future February 2025, Strike Price EUR 133.50 | (34.628)                        | (0,00)               |
| 21               | Euro-Buxl 30-Year Bond Future March 2025                              | (92.719)                        | (0,01)               |
| 1.634            | Euro-Schatz Future March 2025   | (514.612)                       | (0,06)               |
| 70               | FSC Nifty 50 Index Future January 2025                                | (17.428)                        | (0,00)               |
| (655)            | FTSE 100 Index Future March 2025                                      | (323.978)                       | (0,04)               |
| 204              | FTSE China A50 Index Future January 2025                              | (18.170)                        | (0,00)               |
| 56               | FTSE/JSE Top 40 Index Future March 2025                               | (69.991)                        | (0,01)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Futures-Kontrakte (1,42 %) (31. Dezember 2023: (1,51 %)) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte | Beschreibung  | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|------------------|---|---------------------------------|----------------------|
| (27)             | Hang Seng China Enterprises Index Call Option on Future January 2025, Strike Price HKD 7,200.00 | (5.268)                         | (0,01)               |
| 54               | Hang Seng China Enterprises Index Call Option on Future January 2025, Strike Price HKD 7,300.00 | (4.343)                         | (0,01)               |
| (27)             | Hang Seng China Enterprises Index Call Option on Future January 2025, Strike Price HKD 7,500.00 | (565)                           | (0,00)               |
| 570              | Hang Seng China Enterprises Index Future January 2025   | (74.852)                        | (0,01)               |
| 320              | Hang Seng China Enterprises Index Put Option on Future January 2025, Strike Price HKD 6,900.00  | (22.164)                        | (0,01)               |
| (27)             | Hang Seng China Enterprises Index Put Option on Future January 2025, Strike Price HKD 7,300.00  | (1.231)                         | (0,00)               |
| 70               | Hang Seng Index Future January 2025   | (11.882)                        | (0,00)               |
| 36               | Hang Seng Index Put Option on Future January 2025, Strike Price HKD 19,000.00                   | (12.347)                        | (0,00)               |
| 19               | Hang Seng Index Put Option on Future January 2025, Strike Price HKD 19,100.00                   | (3.710)                         | (0,00)               |
| 90               | Hang Seng Index Put Option on Future January 2025, Strike Price HKD 19,200.00                   | (27.408)                        | (0,00)               |
| 19               | Hang Seng Index Put Option on Future January 2025, Strike Price HKD 19,300.00                   | (2.488)                         | (0,00)               |
| 9                | Hang Seng Index Call Option on Future January 2025, Strike Price HKD 20,000.00                  | (4.537)                         | (0,01)               |
| 9                | Hang Seng Index Call Option on Future January 2025, Strike Price HKD 20,200.00                  | (88)                            | (0,00)               |
| (9)              | Hang Seng Index Put Option on Future January 2025, Strike Price HKD 20,200.00                   | (928)                           | (0,00)               |
| (55)             | Hang Seng Index Call Option on Future January 2025, Strike Price HKD 21,200.00                  | (679)                           | (0,01)               |
| 2                | Hang Seng TECH Index Future January 2025  | (920)                           | (0,00)               |
| 5                | Japanese Yen Currency Future March 2025   | (767)                           | (0,00)               |
| 226              | Mexican Peso Currency Future March 2025   | (173.263)                       | (0,02)               |
| 8                | Mini-DAX Future March 2025  | (7.665)                         | (0,00)               |
| 33               | Mini-Hang Seng China Enterprises Index Future January 2025                                      | (753)                           | (0,00)               |
| 22               | Mini-Hang Seng Index Future January 2025  | (929)                           | (0,00)               |
| 40               | MSCI Emerging Markets Index Future March 2025   | (32.870)                        | (0,01)               |
| 122              | MSCI Singapore Index Future January 2025  | (1.850)                         | (0,00)               |
| 3                | Nasdaq 100 Micro E-mini Future March 2025   | (3.781)                         | (0,00)               |
| 37               | Nasdaq 100 E-mini Future March 2025   | (309.953)                       | (0,04)               |
| 12               | Nikkei 225 (CME) Future March 2025  | (12.725)                        | (0,00)               |
| 15               | Nikkei 225 (OSE) Future March 2025  | (6.045)                         | (0,00)               |
| 16               | Nikkei 225 (SGX) Future March 2025  | (26.390)                        | (0,00)               |
| 4                | NYSE FANG+ Index Future March 2025  | (11.948)                        | (0,00)               |
| 3                | S&P 500 Consumer Staples Index March 2025   | (10.160)                        | (0,00)               |
| 718              | S&P 500 E-mini Future March 2025  | (1.105.858)                     | (0,14)               |
| 3                | S&P 500 Micro E-mini Future March 2025  | (593)                           | (0,00)               |
| 17               | S&P Mid-Cap 400 E-mini Future March 2025  | (145.040)                       | (0,02)               |
| (1)              | S&P Real Estate Sector E-mini Future March 2025   | (38)                            | (0,00)               |
| 153              | S&P/TSX 60 Index Future March 2025  | (184.020)                       | (0,02)               |
| 25               | SGX FTSE Taiwan Future January 2025   | (12.691)                        | (0,00)               |
| 718              | Short-Term Euro-BTP Future March 2025   | (331.691)                       | (0,04)               |
| 17               | South African Rand Currency (CME) Future March 2025   | (21.933)                        | (0,00)               |
| 175              | STOXX Europe 600 Index Future March 2025  | (33.688)                        | (0,00)               |
| 3                | STOXX Europe 600 Insurance Future March 2025  | (419)                           | (0,00)               |
| (247)            | Turkish Lira Currency Future January 2025   | (506)                           | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Futures-Kontrakte (1,42 %) (31. Dezember 2023: (1,51 %)) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte   | Beschreibung                                     | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|--|---------------------------------|----------------------|
| 2  | US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2025 | (4.813)                         | (0,00)               |
| 19   | US Treasury 2-Year Note (CBT) Future March 2025  | (10.241)                        | (0,00)               |
| 672  | US Treasury 5-Year Note (CBT) Future March 2025  | (843.364)                       | (0,10)               |
| 17   | Yen Denominated Nikkei Future March 2025         | (18.837)                        | (0,00)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten *</b> |  | <b>(11.482.072)</b>             | <b>(1,42)</b>        |

### Verkaufte Optionskontrakte (8,90 %) (31. Dezember 2023: (23,28 %))

| Anzahl Kontrakte/<br>Nominalwert | Fälligkeit | Art   | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|----------------------------------|------------|---|---------------|----------------------|
| <b>Kaufoptionen</b>              |            |   |               |                      |
| (125.000)                        | 15.08.2025 | Akamai Technologies Inc, Strike Price \$95.00 <sup>∞</sup>                                    | (1.515.106)   | (0,19)               |
| (117.000)                        | 20.11.2026 | Confluent Inc, Strike Price \$100.06 <sup>∞</sup>   | (74.502)      | (0,01)               |
| (117.000)                        | 18.12.2026 | Confluent Inc, Strike Price \$100.06 <sup>∞</sup>   | (81.716)      | (0,01)               |
| (116.000)                        | 15.01.2027 | Confluent Inc, Strike Price \$100.06 <sup>∞</sup>   | (121.750)     | (0,02)               |
| (210.000)                        | 15.01.2027 | Conmed Corp, Strike Price \$139.47 <sup>∞</sup>   | (779.335)     | (0,09)               |
| (1.395.000)                      | 21.03.2025 | Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR15.50 <sup>∞</sup>                                       | (19.521.886)  | (2,42)               |
| (137)                            | 17.01.2025 | EURO STOXX 50 Index, Strike Price EUR4,850.00 <sup>±</sup>                                    | (98.879)      | (0,01)               |
| (303)                            | 17.01.2025 | EURO STOXX 50 Index, Strike Price EUR4,875.00 <sup>±</sup>                                    | (173.821)     | (0,02)               |
| (632)                            | 17.01.2025 | EURO STOXX 50 Index, Strike Price EUR5,000.00 <sup>±</sup>                                    | (79.841)      | (0,01)               |
| (50.000)                         | 17.07.2026 | Insulet Corp, Strike Price \$225.00 <sup>∞</sup>  | (3.742.632)   | (0,46)               |
| (135)                            | 17.01.2025 | Intel Corp, Strike Price \$27.50 <sup>±</sup>   | (337)         | (0,00)               |
| (35)                             | 09.01.2025 | KOSPI 200 Index, Strike Price KRW325.00 <sup>±</sup>  | (8.678)       | (0,00)               |
| (10)                             | 09.01.2025 | KOSPI 200 Index, Strike Price KRW330.00 <sup>±</sup>  | (1.019)       | (0,00)               |
| (13)                             | 09.01.2025 | KOSPI 200 Index, Strike Price KRW340.00 <sup>±</sup>  | (243)         | (0,00)               |
| (80.000)                         | 15.12.2028 | Live Nation Entertainment Inc, Strike Price \$108.00 <sup>∞</sup>                             | (4.366.112)   | (0,54)               |
| (112.500)                        | 18.07.2025 | Middleby Corp, Strike Price \$130.00 <sup>∞</sup>   | (1.976.682)   | (0,25)               |
| (18)                             | 10.01.2025 | Nikkei 225 Index, Strike Price JPY39,250.00 <sup>±</sup>                                      | (101.362)     | (0,01)               |
| (316)                            | 31.01.2025 | S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$6,000.00 <sup>±</sup>                                   | (944.050)     | (0,12)               |
| (181)                            | 31.01.2025 | S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$6,100.00 <sup>±</sup>                                   | (210.413)     | (0,03)               |
| (6)                              | 17.01.2025 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,750.00 <sup>±</sup>   | (687.480)     | (0,09)               |
| (10)                             | 17.01.2025 | S&P 500 Index, Strike Price \$4,900.00 <sup>±</sup>   | (996.500)     | (0,12)               |
| (20)                             | 17.01.2025 | S&P 500 Index, Strike Price \$6,100.00 <sup>±</sup>   | (9.800)       | (0,00)               |
| (400.000)                        | 21.01.2028 | Semtech Corp, Strike Price \$37.00 <sup>∞</sup>   | (15.243.518)  | (1,89)               |
| (81)                             | 15.01.2025 | Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD23,000.00 <sup>±</sup>                           | (39.778)      | (0,01)               |
| (18)                             | 15.01.2025 | Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD23,200.00 <sup>±</sup>                           | (6.094)       | (0,00)               |
| (56.770.000) USD                 | 15.01.2025 | United States Dollar/Chinese Yuan Renminbi Currency Option, Strike Price CNY7.30 <sup>∞</sup> | (452.230)     | (0,06)               |
| (57.000.000) USD                 | 05.03.2026 | United States Dollar/Japanese Yen Currency Option, Strike Price JPY137.00 <sup>∞</sup>        | (5.607.774)   | (0,70)               |
| (27.975.000) USD                 | 05.03.2026 | United States Dollar/Japanese Yen Currency Option, Strike Price JPY141.50 <sup>∞</sup>        | (2.149.123)   | (0,27)               |
| (10)                             | 22.01.2025 | VIX Index, Strike Price \$17.00 <sup>±</sup>  | (1.675)       | (0,00)               |
| (550)                            | 22.01.2025 | VIX Index, Strike Price \$19.00 <sup>±</sup>  | (64.900)      | (0,01)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Verkaufte Optionskontrakte (8,90 %) (31. Dezember 2023: (23,28 %)) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/<br>Nominalwert   | Fälligkeit | Art  | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|------------------------------------|------------|--|------------------|------------------------------|
| <b>Kaufsoptionen (Fortsetzung)</b> |            |  |                  |                              |
| (120.000)                          | 19.10.2029 | Wolfspeed Inc, Strike Price \$ 120.00 <sup>∞</sup>                 | (365.818)        | (0,05)                       |
| <b>Verkaufsoptionen</b>            |            |  |                  |                              |
| (53.892)                           | 15.08.2025 | Akamai Technologies Inc, Strike Price \$ 104.07 <sup>∞</sup>       | (683.978)        | (0,08)                       |
| (11.700)                           | 20.11.2026 | Confluent Inc, Strike Price \$ 76.14 <sup>∞</sup>                  | (511.346)        | (0,06)                       |
| (11.700)                           | 18.12.2026 | Confluent Inc, Strike Price \$ 76.28 <sup>∞</sup>                  | (511.403)        | (0,06)                       |
| (11.600)                           | 15.01.2027 | Confluent Inc, Strike Price \$ 76.41 <sup>∞</sup>                  | (510.110)        | (0,06)                       |
| (70.547)                           | 15.01.2027 | Conmed Corp, Strike Price \$ 110.88 <sup>∞</sup>                   | (2.882.187)      | (0,36)                       |
| (1.448.995)                        | 21.03.2025 | Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR10.99 <sup>∞</sup>            | (512)            | (0,00)                       |
| (1.448.995)                        | 21.03.2025 | Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR11.83 <sup>∞</sup>            | (727)            | (0,00)                       |
| (412)                              | 17.01.2025 | EURO STOXX 50 Index, Strike Price EUR4,850.00 <sup>±</sup>         | (221.846)        | (0,03)                       |
| (461)                              | 17.01.2025 | EURO STOXX 50 Index, Strike Price EUR5,000.00 <sup>±</sup>         | (689.316)        | (0,08)                       |
| (10.659)                           | 17.07.2026 | Insulet Corp, Strike Price \$ 321.48 <sup>∞</sup>                  | (746.133)        | (0,09)                       |
| (10)                               | 09.01.2025 | KOSPI 200 Index, Strike Price KRW315.00 <sup>±</sup>               | (4.772)          | (0,00)                       |
| (82)                               | 09.01.2025 | KOSPI 200 Index, Strike Price KRW317.50 <sup>±</sup>               | (52.637)         | (0,01)                       |
| (75)                               | 09.01.2025 | KOSPI 200 Index, Strike Price KRW320.00 <sup>±</sup>               | (63.682)         | (0,01)                       |
| (98)                               | 09.01.2025 | KOSPI 200 Index, Strike Price KRW322.50 <sup>±</sup>               | (107.676)        | (0,01)                       |
| (10)                               | 09.01.2025 | KOSPI 200 Index, Strike Price KRW325.00 <sup>±</sup>               | (13.976)         | (0,00)                       |
| (12.952)                           | 15.12.2028 | Live Nation Entertainment Inc, Strike Price \$ 101.56 <sup>∞</sup> | (147.911)        | (0,02)                       |
| (45.713)                           | 18.07.2025 | Middleby Corp, Strike Price \$ 150.83 <sup>∞</sup>                 | (871.542)        | (0,11)                       |
| (19)                               | 17.01.2025 | S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$ 5,250.00 <sup>±</sup>       | (2.470)          | (0,00)                       |
| (40)                               | 28.02.2025 | S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$ 5,300.00 <sup>±</sup>       | (43.500)         | (0,01)                       |
| (54)                               | 17.01.2025 | S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$ 5,325.00 <sup>±</sup>       | (8.100)          | (0,00)                       |
| (30)                               | 21.02.2025 | S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$ 5,325.00 <sup>±</sup>       | (28.125)         | (0,00)                       |
| (19)                               | 21.03.2025 | S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$ 5,325.00 <sup>±</sup>       | (33.725)         | (0,00)                       |
| (29)                               | 17.01.2025 | S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$ 5,350.00 <sup>±</sup>       | (4.568)          | (0,00)                       |
| (19)                               | 21.02.2025 | S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$ 5,350.00 <sup>±</sup>       | (19.000)         | (0,00)                       |
| (260)                              | 21.03.2025 | S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$ 5,600.00 <sup>±</sup>       | (861.250)        | (0,11)                       |
| (1)                                | 17.01.2025 | S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$ 5,800.00 <sup>±</sup>       | (1.462)          | (0,00)                       |
| (1)                                | 21.02.2025 | S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$ 6,000.00 <sup>±</sup>       | (7.437)          | (0,00)                       |
| (81)                               | 17.01.2025 | S&P 500 E-mini Future, Strike Price \$ 6,125.00 <sup>±</sup>       | (792.788)        | (0,09)                       |
| (23)                               | 17.01.2025 | S&P 500 Index, Strike Price \$ 2,700.00 <sup>±</sup>               | (460)            | (0,00)                       |
| (15)                               | 17.01.2025 | S&P 500 Index, Strike Price \$ 3,425.00 <sup>±</sup>               | (412)            | (0,00)                       |
| (60)                               | 17.01.2025 | S&P 500 Index, Strike Price \$ 3,550.00 <sup>±</sup>               | (2.100)          | (0,00)                       |
| (10)                               | 17.01.2025 | S&P 500 Index, Strike Price \$ 4,150.00 <sup>±</sup>               | (850)            | (0,00)                       |
| (40)                               | 17.01.2025 | S&P 500 Index, Strike Price \$ 4,300.00 <sup>±</sup>               | (4.000)          | (0,00)                       |
| (11)                               | 17.01.2025 | S&P 500 Index, Strike Price \$ 4,750.00 <sup>±</sup>               | (1.622)          | (0,00)                       |
| (7)                                | 17.01.2025 | S&P 500 Index, Strike Price \$ 4,900.00 <sup>±</sup>               | (1.207)          | (0,00)                       |
| (12)                               | 17.01.2025 | S&P 500 Index, Strike Price \$ 5,225.00 <sup>±</sup>               | (3.120)          | (0,00)                       |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Verkaufte Optionskontrakte (8,90 %) (31. Dezember 2023: (23,28 %)) (Fortsetzung)

| Anzahl Kontrakte/<br>Nominalwert   | Fälligkeit | Art  | Zeitwert<br>US\$    | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|--|------------|--|---------------------|------------------------------|
| <b>Verkaufsoptionen (Fortsetzung)</b>  |            |  |                     |                              |
| (20)   | 17.01.2025 | S&P 500 Index, Strike Price \$5,375.00 ±                 | (7.100)             | (0,00)                       |
| (24)   | 17.01.2025 | S&P 500 Index, Strike Price \$5,575.00 ±                 | (19.560)            | (0,00)                       |
| (11)   | 17.01.2025 | S&P 500 Index, Strike Price \$5,700.00 ±                 | (19.690)            | (0,00)                       |
| (7)  | 02.01.2025 | S&P 500 Index, Strike Price \$5,750.00 ±                 | (210)               | (0,00)                       |
| (18)   | 17.01.2025 | S&P 500 Index, Strike Price \$5,900.00 ±                 | (124.740)           | (0,02)                       |
| (58.277)   | 21.01.2028 | Semtech Corp, Strike Price \$41.74 ∞                     | (534.373)           | (0,07)                       |
| (36)   | 15.01.2025 | Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD22,700.00 ± | (9.224)             | (0,00)                       |
| (9)  | 15.01.2025 | Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD22,800.00 ± | (2.731)             | (0,00)                       |
| (18)   | 15.01.2025 | Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD23,000.00 ± | (7.632)             | (0,00)                       |
| (21.739)   | 19.10.2029 | Wolfspeed Inc, Strike Price \$107.31 ∞                   | (1.838.279)         | (0,23)                       |
| <b>Beizulegender Zeitwert aus verkauften Optionskontrakten insgesamt (Prämie: 72.457.307 US\$)</b> |            |  | <b>(71.822.543)</b> | <b>(8,90)</b>                |

Die Gegenparteien von OTC-Optionskontrakten sind Goldman Sachs International, JPMorgan Chase Bank und Royal Bank of Canada.

### Differenzkontrakte (1,66 %) (31. Dezember 2023: (1,26 %))

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung      | Gegenpartei                 | Nicht<br>realisierter<br>Verlust US\$ | % des<br>Nettöver-<br>mögens |
|-----------|----------------------------|-----------------------------|---------------------------------------|------------------------------|
| 120       | 3M Co                      | Goldman Sachs International | (55)                                  | (0,00)                       |
| (89.761)  | 89bio Inc                  | JPMorgan Chase Bank         | (10.076)                              | (0,00)                       |
| (597.526) | 89bio Inc                  | Goldman Sachs International | (77.078)                              | (0,01)                       |
| 22.483    | AAON Inc                   | Morgan Stanley              | (7.621)                               | (0,00)                       |
| 2.000     | AAR Corp                   | Goldman Sachs International | (1.650)                               | (0,00)                       |
| (327.076) | Abbott Laboratories        | Goldman Sachs International | (1.508)                               | (0,00)                       |
| 684.006   | AbbVie Inc                 | Goldman Sachs International | (3.535)                               | (0,00)                       |
| 5.000     | ABM Industries Inc         | Goldman Sachs International | (2.057)                               | (0,00)                       |
| 297.768   | ABN AMRO Bank NV           | Goldman Sachs International | (2.336)                               | (0,00)                       |
| 128.102   | Acadia Healthcare Co Inc   | Goldman Sachs International | (5.086)                               | (0,00)                       |
| 148.322   | ACADIA Pharmaceuticals Inc | Goldman Sachs International | (18.290)                              | (0,00)                       |
| (87.895)  | Accenture Plc Class A      | JPMorgan Chase Bank         | (3.004)                               | (0,00)                       |
| (35.108)  | Accenture Plc Class A      | Goldman Sachs International | (730)                                 | (0,00)                       |
| (80.227)  | Accenture Plc Class A      | Morgan Stanley              | (5.859)                               | (0,00)                       |
| 50.974    | Addus HomeCare Corp        | Goldman Sachs International | (9.957)                               | (0,00)                       |
| 145.883   | Admiral Group Plc          | Goldman Sachs International | (3.683)                               | (0,00)                       |
| (148.939) | Adobe Inc                  | Morgan Stanley              | (21.603)                              | (0,00)                       |
| 200       | Adobe Inc                  | Goldman Sachs International | (1.226)                               | (0,00)                       |
| 35.123    | Advance Auto Parts Inc     | Morgan Stanley              | (4.362)                               | (0,00)                       |
| (97.081)  | Advanced Micro Devices Inc | Morgan Stanley              | (16.103)                              | (0,00)                       |
| (81.476)  | Aegon Ltd                  | Goldman Sachs International | (6.940)                               | (0,00)                       |
| (140.340) | AES Corp                   | Morgan Stanley              | (43.564)                              | (0,01)                       |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,66 %) (31. Dezember 2023: (1,26 %)) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung          | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|--------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 1.300       | Affiliated Managers Group Inc  | Goldman Sachs International | (5.809)                         | (0,00)               |
| (21.337)    | Affirm Holdings Inc            | Morgan Stanley              | (12.112)                        | (0,00)               |
| (38.734)    | Affirm Holdings Inc            | JPMorgan Chase Bank         | (1.896)                         | (0,00)               |
| (63.808)    | Affirm Holdings Inc            | Goldman Sachs International | (4.268)                         | (0,00)               |
| (420)       | Aflac Inc                      | Goldman Sachs International | (196)                           | (0,00)               |
| 59.175      | Aflac Inc                      | Morgan Stanley              | (855)                           | (0,00)               |
| (602)       | agilon health Inc              | Goldman Sachs International | (51)                            | (0,00)               |
| 29.867      | Agree Realty Corp              | Morgan Stanley              | (3.608)                         | (0,00)               |
| 48.433      | Air Products & Chemicals Inc   | Morgan Stanley              | (6.485)                         | (0,00)               |
| (147.354)   | Air Products & Chemicals Inc   | Goldman Sachs International | (16.997)                        | (0,00)               |
| 62.880      | Airbnb Inc Class A             | JPMorgan Chase Bank         | (9.237)                         | (0,00)               |
| 22.998      | Airbnb Inc Class A             | Morgan Stanley              | (737)                           | (0,00)               |
| 4.000.000   | Alibaba Group Holding Ltd      | Nomura                      | (233.016)                       | (0,03)               |
| (34.762)    | Align Technology Inc           | Goldman Sachs International | (2.598)                         | (0,00)               |
| 35.381      | Alimentation Couche-Tard Inc   | JPMorgan Chase Bank         | (30)                            | (0,00)               |
| 6.512       | Alkermes Plc                   | Goldman Sachs International | (1.261)                         | (0,00)               |
| (107.614)   | Allegion Plc                   | Morgan Stanley              | (7.890)                         | (0,00)               |
| 600         | Allegion Plc                   | Goldman Sachs International | (1.377)                         | (0,00)               |
| (1.700)     | ALLETE Inc                     | Goldman Sachs International | (503)                           | (0,00)               |
| 55.740      | Alliant Energy Corp            | Morgan Stanley              | (3.097)                         | (0,00)               |
| (272.083)   | Allianz SE                     | Goldman Sachs International | (6.605)                         | (0,00)               |
| (107.397)   | Allstate Corp                  | Morgan Stanley              | (5.748)                         | (0,00)               |
| (105.769)   | Ally Financial Inc             | Morgan Stanley              | (8.651)                         | (0,00)               |
| 43.118      | Alpha Services & Holdings SA   | Morgan Stanley              | (5.544)                         | (0,00)               |
| (7.247)     | Alphabet Inc Class A           | Goldman Sachs International | (91)                            | (0,00)               |
| (116.376)   | Alphabet Inc Class A           | JPMorgan Chase Bank         | (195)                           | (0,00)               |
| 100         | Amazon.com Inc                 | Goldman Sachs International | (842)                           | (0,00)               |
| (178.164)   | Amazon.com Inc                 | JPMorgan Chase Bank         | (1.486)                         | (0,00)               |
| 14.481      | Amer Sports Inc                | Morgan Stanley              | (23.506)                        | (0,01)               |
| 59.050      | Ameren Corp                    | Morgan Stanley              | (797)                           | (0,00)               |
| 400         | American Electric Power Co Inc | Goldman Sachs International | (105)                           | (0,00)               |
| 46.344      | American Express Co            | Morgan Stanley              | (12.518)                        | (0,00)               |
| 136.494     | American Express Co            | Goldman Sachs International | (12.300)                        | (0,00)               |
| 300         | American Financial Group Inc   | Goldman Sachs International | (378)                           | (0,00)               |
| (214.439)   | AmerisourceBergen Corp         | Goldman Sachs International | (9.995)                         | (0,00)               |
| (107.701)   | AMETEK Inc                     | Morgan Stanley              | (7.853)                         | (0,00)               |
| (41.328)    | Amgen Inc                      | Morgan Stanley              | (8.094)                         | (0,00)               |
| 580         | Amgen Inc                      | Goldman Sachs International | (1.734)                         | (0,00)               |
| 21.993      | Amphenol Corp Class A          | Morgan Stanley              | (2.717)                         | (0,00)               |
| 210.000.000 | ANA Holdings Inc               | Nomura                      | (199.811)                       | (0,03)               |
| (195.104)   | Analog Devices Inc             | Morgan Stanley              | (4.578)                         | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,66 %) (31. Dezember 2023: (1,26 %)) (Fortsetzung)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung         | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|-------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| (41.950)  | ANSYS Inc                     | Morgan Stanley              | (1.254)                         | (0,00)               |
| (3.600)   | Antero Midstream Corp         | Goldman Sachs International | (496)                           | (0,00)               |
| 28.740    | Antero Resources Corp         | Morgan Stanley              | (9.805)                         | (0,00)               |
| 1.780     | AO Smith Corp                 | Goldman Sachs International | (1.159)                         | (0,00)               |
| (78.007)  | AO Smith Corp                 | Morgan Stanley              | (6.092)                         | (0,00)               |
| 55.783    | Aon Plc Class A               | Morgan Stanley              | (2.597)                         | (0,00)               |
| (3.300)   | APA Corp                      | Goldman Sachs International | (3.997)                         | (0,00)               |
| 38.408    | Apollo Global Management Inc  | Morgan Stanley              | (11.990)                        | (0,00)               |
| 4.800     | Apple Hospitality REIT Inc    | Goldman Sachs International | (2.695)                         | (0,00)               |
| 238.008   | Apple Inc                     | Morgan Stanley              | (22.636)                        | (0,01)               |
| 117.600   | Applied Digital Corp          | Goldman Sachs International | (217.845)                       | (0,03)               |
| (226.920) | Applied Materials Inc         | Morgan Stanley              | (36.519)                        | (0,01)               |
| (21.445)  | AppLovin Corp Class A         | JPMorgan Chase Bank         | (461)                           | (0,00)               |
| (136.292) | AppLovin Corp Class A         | Goldman Sachs International | (1.995)                         | (0,00)               |
| 1.200     | Aramark                       | Goldman Sachs International | (324)                           | (0,00)               |
| 321.146   | Archrock Inc                  | Goldman Sachs International | (12.119)                        | (0,00)               |
| (9.762)   | Arcus Biosciences Inc         | Goldman Sachs International | (1.609)                         | (0,00)               |
| (89.106)  | Argenx SE                     | JPMorgan Chase Bank         | (1.304)                         | (0,00)               |
| 100       | ARM Holdings PLC              | Goldman Sachs International | (1.122)                         | (0,00)               |
| 51.331    | Arthur J Gallagher & Co       | Morgan Stanley              | (6.371)                         | (0,00)               |
| 300       | Arthur J Gallagher & Co       | Goldman Sachs International | (1.237)                         | (0,00)               |
| 2.200     | Artivion Inc                  | Goldman Sachs International | (1.191)                         | (0,00)               |
| 24.252    | Ascendis Pharma A/S           | JPMorgan Chase Bank         | (1.579)                         | (0,00)               |
| 148.865   | Ascendis Pharma A/S           | Goldman Sachs International | (6.665)                         | (0,00)               |
| (101.311) | ASML Holding NV               | Morgan Stanley              | (2.344)                         | (0,00)               |
| 28.275    | Aspen Technology Inc          | Morgan Stanley              | (1.809)                         | (0,00)               |
| 113.101   | ASR Nederland NV              | JPMorgan Chase Bank         | (2.657)                         | (0,00)               |
| 170.144   | ASR Nederland NV              | Goldman Sachs International | (2.200)                         | (0,00)               |
| 55.739    | Assicurazioni Generali        | JPMorgan Chase Bank         | (1.136)                         | (0,00)               |
| 318.547   | Assicurazioni Generali        | Goldman Sachs International | (13.455)                        | (0,00)               |
| (450.024) | Associated Banc-Corp          | Goldman Sachs International | (50.972)                        | (0,01)               |
| 1.000     | Assurant Inc                  | Goldman Sachs International | (2.390)                         | (0,00)               |
| 653       | Astec Industries Inc          | Goldman Sachs International | (1.897)                         | (0,00)               |
| 13.710    | Astera Labs Inc               | Morgan Stanley              | (28.091)                        | (0,01)               |
| (12.027)  | AstraZeneca Plc               | Goldman Sachs International | (2.156)                         | (0,00)               |
| 2.100     | ATI Inc                       | Goldman Sachs International | (1.788)                         | (0,00)               |
| 50.398    | Atlassian Corp Class A        | Morgan Stanley              | (4.380)                         | (0,00)               |
| 48.837    | Atmos Energy Corp             | Morgan Stanley              | (10.342)                        | (0,00)               |
| 801       | Aurinia Pharmaceuticals Inc   | JPMorgan Chase Bank         | (667)                           | (0,00)               |
| 24.886    | Automatic Data Processing Inc | Goldman Sachs International | (6.037)                         | (0,00)               |
| (120.704) | Automatic Data Processing Inc | Morgan Stanley              | (4.012)                         | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,66 %) (31. Dezember 2023: (1,26 %)) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung              | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|------------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 1.000       | AutoNation Inc                     | Goldman Sachs International | (3.593)                         | (0,00)               |
| 55.210      | AutoZone Inc                       | Morgan Stanley              | (5.609)                         | (0,00)               |
| (108.378)   | Avery Dennison Corp                | Morgan Stanley              | (10.101)                        | (0,00)               |
| (8.929)     | Avnet Inc                          | Morgan Stanley              | (308)                           | (0,00)               |
| (66.670)    | Axalta Coating Systems Ltd         | Morgan Stanley              | (10.595)                        | (0,00)               |
| 800         | Axcelis Technologies Inc           | Goldman Sachs International | (1.993)                         | (0,00)               |
| 32.071      | AZEK Co Inc                        | Morgan Stanley              | (365)                           | (0,00)               |
| 108.148     | B&G Foods Inc                      | Goldman Sachs International | (5.254)                         | (0,00)               |
| 72.113      | B&G Foods Inc                      | JPMorgan Chase Bank         | (2.101)                         | (0,00)               |
| (493.622)   | B3 SA - Brasil Bolsa Balca         | Morgan Stanley              | (1.762)                         | (0,00)               |
| (306.558)   | Baker Hughes Co                    | Goldman Sachs International | (9.410)                         | (0,00)               |
| 600         | Ball Corp                          | Goldman Sachs International | (492)                           | (0,00)               |
| 4.000.000   | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA | Société Générale            | (122.326)                       | (0,02)               |
| (823.975)   | Banco Do Brasil SA                 | Morgan Stanley              | (9.639)                         | (0,00)               |
| 210.344     | Banco Santander SA                 | JPMorgan Chase Bank         | (8.201)                         | (0,00)               |
| 400         | Bank of America Corp               | Goldman Sachs International | (197)                           | (0,00)               |
| (49.854)    | Bank Of Ireland Group Plc          | JPMorgan Chase Bank         | (700)                           | (0,00)               |
| 243.519     | BankUnited Inc                     | Goldman Sachs International | (8.605)                         | (0,00)               |
| (4.254)     | Baxter International Inc           | JPMorgan Chase Bank         | (959)                           | (0,00)               |
| 77.536      | Baxter International Inc           | Goldman Sachs International | (242)                           | (0,00)               |
| (108.951)   | Beam Therapeutics Inc              | JPMorgan Chase Bank         | (8.134)                         | (0,00)               |
| (187.223)   | Beam Therapeutics Inc              | Goldman Sachs International | (14.435)                        | (0,00)               |
| (10.433)    | Becton Dickinson & Co              | Goldman Sachs International | (767)                           | (0,00)               |
| (351.142)   | BellRing Brands Inc                | JPMorgan Chase Bank         | (3.231)                         | (0,00)               |
| 200         | Berry Global Group Inc             | Goldman Sachs International | (84)                            | (0,00)               |
| (2.871)     | Bicara Therapeutics Inc            | Goldman Sachs International | (999)                           | (0,00)               |
| 5.286.393   | Bid Corp Ltd                       | Goldman Sachs International | (8.190)                         | (0,00)               |
| (1.370.125) | Bidvest Group Ltd                  | JPMorgan Chase Bank         | (6.628)                         | (0,00)               |
| (43.420)    | Biogen Inc                         | Morgan Stanley              | (9.846)                         | (0,00)               |
| 300         | BioMarin Pharmaceutical Inc        | Goldman Sachs International | (351)                           | (0,00)               |
| 166.245     | BioNTech SE                        | Goldman Sachs International | (2.615)                         | (0,00)               |
| 60.887      | Bio-Rad Laboratories Inc Class A   | Morgan Stanley              | (684)                           | (0,00)               |
| 33.629      | Birkenstock Holding Plc            | Morgan Stanley              | (2.050)                         | (0,00)               |
| 1.600       | BJ's Restaurants Inc               | Goldman Sachs International | (601)                           | (0,00)               |
| 1.200       | BJ's Wholesale Club Holdings Inc   | Goldman Sachs International | (6.015)                         | (0,00)               |
| (18.347)    | Block Inc                          | JPMorgan Chase Bank         | (266)                           | (0,00)               |
| 25.208      | Blue Owl Capital Inc               | Morgan Stanley              | (9.584)                         | (0,00)               |
| (16.707)    | Blueprint Medicines Corp           | Goldman Sachs International | (325)                           | (0,00)               |
| 67.845      | Boeing Co                          | Morgan Stanley              | (3.083)                         | (0,00)               |
| 48.629      | Booking Holdings Inc               | Morgan Stanley              | (6.013)                         | (0,00)               |
| (107.137)   | Booz Allen Hamilton Holding Corp   | Morgan Stanley              | (13.278)                        | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte (1,66 %) (31. Dezember 2023: (1,26 %)) (Fortsetzung)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                   | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|---|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| (69.936)  | BorgWarner Inc                          | Morgan Stanley              | (4.877)                         | (0,00)               |
| 300       | Boston Beer Co Inc Class A              | Goldman Sachs International | (1.550)                         | (0,00)               |
| 53.346    | Boston Scientific Corp                  | Morgan Stanley              | (8.390)                         | (0,00)               |
| (375.737) | Boston Scientific Corp                  | Goldman Sachs International | (2.451)                         | (0,00)               |
| 25.380    | BPER Banca                              | JPMorgan Chase Bank         | (1.872)                         | (0,00)               |
| 140.299   | BPER Banca                              | Goldman Sachs International | (4.678)                         | (0,00)               |
| 1.100     | Brady Corp Class A                      | Goldman Sachs International | (1.893)                         | (0,00)               |
| 166.960   | Bridgebio Pharma Inc                    | Goldman Sachs International | (8.919)                         | (0,00)               |
| (71.339)  | Brighthouse Financial Inc               | Morgan Stanley              | (4.589)                         | (0,00)               |
| 500       | Brightsphere Investment Group Inc       | Goldman Sachs International | (1.371)                         | (0,00)               |
| 11.000    | Brookfield Asset Management Ltd Class A | Goldman Sachs International | (50.050)                        | (0,01)               |
| 51.341    | Brown & Brown Inc                       | Morgan Stanley              | (5.837)                         | (0,00)               |
| 990       | Brown & Brown Inc                       | Goldman Sachs International | (1.667)                         | (0,00)               |
| (175.438) | Brown-Forman Corp Class B               | Goldman Sachs International | (25.669)                        | (0,01)               |
| (126.603) | Brown-Forman Corp Class B               | JPMorgan Chase Bank         | (10.116)                        | (0,00)               |
| (120.237) | Bunge Global SA                         | Morgan Stanley              | (26.129)                        | (0,01)               |
| 400       | Burlington Stores Inc                   | Goldman Sachs International | (2.966)                         | (0,00)               |
| (178.179) | BWX Technologies Inc                    | JPMorgan Chase Bank         | (14.250)                        | (0,00)               |
| (85.386)  | CACI International Inc Class A          | Morgan Stanley              | (20.896)                        | (0,01)               |
| (5.400)   | Cactus Inc Class A                      | Goldman Sachs International | (1.618)                         | (0,00)               |
| (3.000)   | California Resources Corp               | Goldman Sachs International | (790)                           | (0,00)               |
| (574.463) | Campbell Soup Co                        | Goldman Sachs International | (77.771)                        | (0,01)               |
| (361.644) | Campbell Soup Co                        | JPMorgan Chase Bank         | (30.516)                        | (0,01)               |
| (44.147)  | Canadian Natural Resources Ltd          | Morgan Stanley              | (3.549)                         | (0,00)               |
| (312.120) | Canadian Natural Resources Ltd          | Goldman Sachs International | (13.423)                        | (0,00)               |
| (300.536) | Canadian Natural Resources Ltd          | JPMorgan Chase Bank         | (18.942)                        | (0,00)               |
| 255.456   | Canadian Pacific Kansas City Ltd        | JPMorgan Chase Bank         | (127)                           | (0,00)               |
| 45.170    | Capital One Financial Corp              | Morgan Stanley              | (14.410)                        | (0,00)               |
| 123.851   | Cardinal Health Inc                     | Goldman Sachs International | (573)                           | (0,00)               |
| 49.336    | Carrier Global Corp                     | Morgan Stanley              | (6.692)                         | (0,00)               |
| 2.800     | Carter's Inc                            | Goldman Sachs International | (4.576)                         | (0,00)               |
| (70.757)  | Carter's Inc                            | Morgan Stanley              | (2.673)                         | (0,00)               |
| 30        | Caterpillar Inc                         | Goldman Sachs International | (115)                           | (0,00)               |
| (174.942) | Cava Group Inc                          | Goldman Sachs International | (24.012)                        | (0,01)               |
| 21.985    | Cava Group Inc                          | Morgan Stanley              | (6.189)                         | (0,00)               |
| 1.400     | CBRE Group Inc Class A                  | Goldman Sachs International | (156)                           | (0,00)               |
| 5.774     | Celsius Holdings Inc                    | JPMorgan Chase Bank         | (155)                           | (0,00)               |
| 900       | Cencora Inc                             | Goldman Sachs International | (3.035)                         | (0,00)               |
| 184.734   | Centene Corp                            | Goldman Sachs International | (739)                           | (0,00)               |
| 1.100     | Century Communities Inc                 | Goldman Sachs International | (1.731)                         | (0,00)               |
| (51.256)  | Ceribell Inc                            | Goldman Sachs International | (3.263)                         | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,66 %) (31. Dezember 2023: (1,26 %)) (Fortsetzung)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                        | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|--|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 38.801    | Ceridian HCM Holding Inc                     | Morgan Stanley              | (17.150)                        | (0,00)               |
| (11.971)  | CG oncology Inc                              | Goldman Sachs International | (2.034)                         | (0,00)               |
| (87.797)  | CG oncology Inc                              | JPMorgan Chase Bank         | (15.414)                        | (0,00)               |
| 1.500     | CH Robinson Worldwide Inc                    | Goldman Sachs International | (1.515)                         | (0,00)               |
| 200       | Charles River Laboratories International Inc | Goldman Sachs International | (358)                           | (0,00)               |
| (800)     | Chefs' Warehouse Inc                         | Goldman Sachs International | (491)                           | (0,00)               |
| 187.305   | Cheniere Energy Inc                          | Goldman Sachs International | (5.178)                         | (0,00)               |
| 53.428    | Chesapeake Energy Corp                       | Morgan Stanley              | (8.954)                         | (0,00)               |
| 700       | Chesapeake Utilities Corp                    | Goldman Sachs International | (375)                           | (0,00)               |
| (459.886) | Chevron Corp                                 | Goldman Sachs International | (40.143)                        | (0,01)               |
| (65.454)  | Chewy Inc Class A                            | JPMorgan Chase Bank         | (19)                            | (0,00)               |
| (106.491) | Chipotle Mexican Grill Inc                   | Morgan Stanley              | (522)                           | (0,00)               |
| 57.890    | Chubb Ltd                                    | Morgan Stanley              | (2.401)                         | (0,00)               |
| 290       | Chubb Ltd                                    | Goldman Sachs International | (576)                           | (0,00)               |
| 52.615    | Church & Dwight Co Inc                       | Morgan Stanley              | (3.388)                         | (0,00)               |
| 35.339    | Ciena Corp                                   | Morgan Stanley              | (7.153)                         | (0,00)               |
| 12.800    | CinCor Pharma Inc                            | Goldman Sachs International | (19.968)                        | (0,00)               |
| 105.600   | Cipher Mining Inc                            | Goldman Sachs International | (258.271)                       | (0,03)               |
| 800       | Cirrus Logic Inc                             | Goldman Sachs International | (3.291)                         | (0,00)               |
| (71.568)  | Cirrus Logic Inc                             | Morgan Stanley              | (4.731)                         | (0,00)               |
| 850       | Citigroup Inc                                | Goldman Sachs International | (699)                           | (0,00)               |
| (8.593)   | Civitas Resources Inc                        | Morgan Stanley              | (875)                           | (0,00)               |
| 30.775    | Clean Harbors Inc                            | Morgan Stanley              | (1.763)                         | (0,00)               |
| 4.697.409 | Clicks Group Ltd                             | Goldman Sachs International | (5.698)                         | (0,00)               |
| (875.176) | Clorox Co                                    | Goldman Sachs International | (3.562)                         | (0,00)               |
| (294.874) | Clorox Co                                    | JPMorgan Chase Bank         | (4.336)                         | (0,00)               |
| (104.467) | Clorox Co                                    | Morgan Stanley              | (519)                           | (0,00)               |
| 47.223    | Cloudflare Inc Class A                       | Morgan Stanley              | (18.278)                        | (0,00)               |
| 46.325    | CNH Industrial NV                            | Morgan Stanley              | (6.068)                         | (0,00)               |
| (106.542) | Coca-Cola Co                                 | Morgan Stanley              | (2.522)                         | (0,00)               |
| (302.730) | Coca-Cola Co                                 | JPMorgan Chase Bank         | (27.060)                        | (0,01)               |
| (302.282) | Coca-Cola Co                                 | Goldman Sachs International | (26.612)                        | (0,01)               |
| (287.755) | Cogent Biosciences Inc                       | Goldman Sachs International | (91.887)                        | (0,01)               |
| (45.662)  | Cogent Biosciences Inc                       | JPMorgan Chase Bank         | (11.335)                        | (0,00)               |
| 52.538    | Cognizant Technology Solutions Corp Class A  | Morgan Stanley              | (2.110)                         | (0,00)               |
| 12.645    | Cognizant Technology Solutions Corp Class A  | JPMorgan Chase Bank         | (1.397)                         | (0,00)               |
| 48.701    | Coherent Corp                                | Morgan Stanley              | (9.880)                         | (0,00)               |
| 700       | Columbia Sportswear Co                       | Goldman Sachs International | (3.480)                         | (0,00)               |
| (403.608) | Comcast Corp Class A                         | Morgan Stanley              | (35.823)                        | (0,01)               |
| 30.521    | Commerce Bancshares Inc                      | Morgan Stanley              | (1.688)                         | (0,00)               |
| 314.518   | Commerce Bancshares Inc                      | Goldman Sachs International | (18.954)                        | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,66 %) (31. Dezember 2023: (1,26 %)) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung            | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|----------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 1.900       | Commercial Metals Co             | Goldman Sachs International | (2.501)                         | (0,00)               |
| 400.000     | Commerzbank AG                   | Société Générale            | (10.940)                        | (0,00)               |
| 500         | Community Financial System Inc   | Goldman Sachs International | (772)                           | (0,00)               |
| (983.354)   | Conagra Brands Inc               | Goldman Sachs International | (43.466)                        | (0,01)               |
| (48.201)    | Concentrix Corp                  | Morgan Stanley              | (2.464)                         | (0,00)               |
| 11.326      | Confluent Inc Class A            | Morgan Stanley              | (4.338)                         | (0,00)               |
| (1.576.618) | ConocoPhillips                   | Goldman Sachs International | (30.440)                        | (0,01)               |
| (108.902)   | Consolidated Edison Inc          | Morgan Stanley              | (12.114)                        | (0,00)               |
| (4.300)     | Contra Abiomed Inc               | Goldman Sachs International | (3.139)                         | (0,00)               |
| (7.507)     | Contra Inhibrx Inc               | Morgan Stanley              | (5.630)                         | (0,00)               |
| (8.889)     | Cooper Cos Inc                   | JPMorgan Chase Bank         | (1.250)                         | (0,00)               |
| 54.369      | Copart Inc                       | Morgan Stanley              | (4.503)                         | (0,00)               |
| 28.417      | Core & Main Inc Class A          | Morgan Stanley              | (1.379)                         | (0,00)               |
| (7.144)     | Core Laboratories Inc            | Goldman Sachs International | (1.516)                         | (0,00)               |
| 53.300      | Core Scientific Inc              | Goldman Sachs International | (133.783)                       | (0,02)               |
| (105.119)   | Corebridge Financial Inc         | Morgan Stanley              | (7.798)                         | (0,00)               |
| 43.398      | Corning Inc                      | Morgan Stanley              | (16.334)                        | (0,00)               |
| (105.790)   | CoStar Group Inc                 | Morgan Stanley              | (9.999)                         | (0,00)               |
| 474.546     | Coterra Energy Inc               | Goldman Sachs International | (22.431)                        | (0,00)               |
| 40.155      | Coty Inc Class A                 | Goldman Sachs International | (75)                            | (0,00)               |
| (217.045)   | Coupang Inc                      | Goldman Sachs International | (21.617)                        | (0,01)               |
| (26.475)    | Coupang Inc                      | Morgan Stanley              | (1.488)                         | (0,00)               |
| (36.512)    | Coupang Inc                      | JPMorgan Chase Bank         | (594)                           | (0,00)               |
| 30.482      | Crane NXT Co                     | Morgan Stanley              | (1.447)                         | (0,00)               |
| 73.448      | Credit Agricole SA               | JPMorgan Chase Bank         | (4.120)                         | (0,00)               |
| 5.200.000   | Credit Agricole SA               | Société Générale            | (91.689)                        | (0,01)               |
| 15.000      | CRH Plc                          | Goldman Sachs International | (66.233)                        | (0,01)               |
| (16.276)    | Criteo SA                        | Morgan Stanley              | (428)                           | (0,00)               |
| (83.732)    | Crocs Inc                        | Morgan Stanley              | (13.513)                        | (0,00)               |
| 33.952      | Cross Country Healthcare Inc     | Goldman Sachs International | (8.879)                         | (0,00)               |
| 6.849       | CrowdStrike Holdings Inc Class A | Morgan Stanley              | (2.021)                         | (0,00)               |
| 1.100       | Crown Holdings Inc               | Goldman Sachs International | (1.239)                         | (0,00)               |
| 3.043       | CSG Systems International Inc    | Goldman Sachs International | (2.975)                         | (0,00)               |
| 3.000       | CTS Corp                         | Goldman Sachs International | (3.734)                         | (0,00)               |
| 1.700       | CubeSmart                        | Goldman Sachs International | (713)                           | (0,00)               |
| 700         | Cullen/Frost Bankers Inc         | Goldman Sachs International | (1.348)                         | (0,00)               |
| 30.787      | Cullen/Frost Bankers Inc         | Morgan Stanley              | (793)                           | (0,00)               |
| (240.857)   | Cullinan Therapeutics Inc        | Goldman Sachs International | (55.112)                        | (0,01)               |
| 20.000      | Curblin Properties Corp          | Goldman Sachs International | (9.200)                         | (0,00)               |
| 204.554     | CVS Health Corp                  | Goldman Sachs International | (2.871)                         | (0,00)               |
| (8.838)     | Cytek Biosciences Inc            | Goldman Sachs International | (83)                            | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,66 %) (31. Dezember 2023: (1,26 %)) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung             | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|-----------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 1.500       | Dana Inc                          | Goldman Sachs International | (412)                           | (0,00)               |
| 70          | Danaher Corp                      | Goldman Sachs International | (102)                           | (0,00)               |
| (343.564)   | Danone SA                         | Goldman Sachs International | (3.063)                         | (0,00)               |
| (1.118.856) | Danske Bank A/S                   | JPMorgan Chase Bank         | (3.059)                         | (0,00)               |
| 408.941     | Darden Restaurants Inc            | JPMorgan Chase Bank         | (8.861)                         | (0,00)               |
| 22.999      | Datadog Inc Class A               | Morgan Stanley              | (2.541)                         | (0,00)               |
| 35.867      | Datadog Inc Class A               | Goldman Sachs International | (5.140)                         | (0,00)               |
| (500)       | Dave & Buster's Entertainment Inc | Goldman Sachs International | (315)                           | (0,00)               |
| 2.500.000   | Davide Campari-Milano NV          | Société Générale            | (183.094)                       | (0,03)               |
| 54.912      | DaVita Inc                        | Morgan Stanley              | (1.983)                         | (0,00)               |
| 49.870      | Deere & Co                        | Morgan Stanley              | (6.350)                         | (0,00)               |
| 55.397      | Dell Technologies Inc Class C     | Morgan Stanley              | (2.409)                         | (0,00)               |
| 1.000.000   | Deutsche Bank AG                  | Société Générale            | (39.244)                        | (0,01)               |
| (54.815)    | Diageo Plc                        | Goldman Sachs International | (1.704)                         | (0,00)               |
| 238.944     | Diamondback Energy Inc            | JPMorgan Chase Bank         | (6.441)                         | (0,00)               |
| (102.982)   | Dianthus Therapeutics Inc         | JPMorgan Chase Bank         | (23.610)                        | (0,01)               |
| (242.314)   | Dianthus Therapeutics Inc         | Goldman Sachs International | (47.377)                        | (0,01)               |
| 45.477      | Digital Realty Trust Inc          | Morgan Stanley              | (12.535)                        | (0,00)               |
| 3.800       | Digital Realty Trust Inc          | Goldman Sachs International | (11.812)                        | (0,00)               |
| 30.000      | DigitalBridge Group Inc           | Goldman Sachs International | (23.100)                        | (0,01)               |
| (558.711)   | Dino Polska SA                    | Goldman Sachs International | (3.942)                         | (0,00)               |
| (1.286.745) | Dino Polska SA                    | JPMorgan Chase Bank         | (8.027)                         | (0,00)               |
| (1.853.493) | DNB Bank ASA                      | JPMorgan Chase Bank         | (1.748)                         | (0,00)               |
| (1.553.747) | DNB Bank ASA                      | Goldman Sachs International | (2.331)                         | (0,00)               |
| (69.890)    | Dolby Laboratories Inc Class A    | Morgan Stanley              | (269)                           | (0,00)               |
| 1.600       | Dollar Tree Inc                   | Goldman Sachs International | (1.371)                         | (0,00)               |
| 58.676      | Dollar Tree Inc                   | Morgan Stanley              | (2.103)                         | (0,00)               |
| (3.200)     | Dominion Energy Inc               | Goldman Sachs International | (470)                           | (0,00)               |
| 2.200       | Donaldson Co Inc                  | Goldman Sachs International | (2.599)                         | (0,00)               |
| (71.314)    | Donaldson Co Inc                  | Morgan Stanley              | (5.959)                         | (0,00)               |
| 63.935      | DoorDash Inc Class A              | Morgan Stanley              | (3.766)                         | (0,00)               |
| (64.837)    | DoubleVerify Holdings Inc         | Morgan Stanley              | (957)                           | (0,00)               |
| 42.425      | DoubleVerify Holdings Inc         | JPMorgan Chase Bank         | (532)                           | (0,00)               |
| (170)       | Dow Inc                           | Goldman Sachs International | (26)                            | (0,00)               |
| (70.912)    | Doximity Inc Class A              | Morgan Stanley              | (919)                           | (0,00)               |
| 50.340      | DraftKings Inc Class A            | Morgan Stanley              | (3.634)                         | (0,00)               |
| (316.810)   | DT Midstream Inc                  | JPMorgan Chase Bank         | (6.755)                         | (0,00)               |
| 23.442      | DT Midstream Inc                  | Morgan Stanley              | (9.630)                         | (0,00)               |
| (107.107)   | DTE Energy Co                     | Morgan Stanley              | (3.164)                         | (0,00)               |
| 26.220      | Dun & Bradstreet Holdings Inc     | Morgan Stanley              | (6.602)                         | (0,00)               |
| (103.500)   | DuPont de Nemours Inc             | Morgan Stanley              | (5.751)                         | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,66 %) (31. Dezember 2023: (1,26 %)) (Fortsetzung)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                 | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|---------------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 23.098    | Dutch Bros Inc Class A                | Morgan Stanley              | (11.378)                        | (0,00)               |
| (45.081)  | DXC Technology Co                     | Morgan Stanley              | (3.913)                         | (0,00)               |
| (160.685) | Dyne Therapeutics Inc                 | Morgan Stanley              | (50.479)                        | (0,01)               |
| 1.000     | East West Bancorp Inc                 | Goldman Sachs International | (3.735)                         | (0,00)               |
| (760.829) | Eaton Corp Plc                        | Goldman Sachs International | (49.790)                        | (0,01)               |
| 52.825    | eBay Inc                              | Goldman Sachs International | (3.959)                         | (0,00)               |
| 100       | Edison International                  | Goldman Sachs International | (133)                           | (0,00)               |
| 124.875   | eFFECTOR Therapeutics                 | Goldman Sachs International | (125)                           | (0,00)               |
| 90        | Elevance Health Inc                   | Goldman Sachs International | (396)                           | (0,00)               |
| (112.150) | Eli Lilly & Co                        | Morgan Stanley              | (10.378)                        | (0,00)               |
| (138.515) | Eli Lilly & Co                        | Goldman Sachs International | (3.590)                         | (0,00)               |
| (108.315) | EMCOR Group Inc                       | Morgan Stanley              | (10.941)                        | (0,00)               |
| (152.917) | Encompass Health Corp                 | Goldman Sachs International | (13.152)                        | (0,00)               |
| 360.248   | Energizer Holdings Inc                | Goldman Sachs International | (36.265)                        | (0,01)               |
| 300       | EnerSys                               | Goldman Sachs International | (105)                           | (0,00)               |
| 108.693   | Eni SpA                               | Goldman Sachs International | (1.192)                         | (0,00)               |
| 2.700     | Enovis Corp                           | Goldman Sachs International | (3.107)                         | (0,00)               |
| (423.351) | Entain Plc                            | Goldman Sachs International | (54.991)                        | (0,01)               |
| (101.277) | Entain Plc                            | JPMorgan Chase Bank         | (16.116)                        | (0,00)               |
| 50.401    | Entergy Corp                          | Morgan Stanley              | (7.958)                         | (0,00)               |
| (800)     | Entergy Corp                          | Goldman Sachs International | (40)                            | (0,00)               |
| (11.500)  | Enviri Corp                           | Goldman Sachs International | (640)                           | (0,00)               |
| (282.484) | EOG Resources Inc                     | JPMorgan Chase Bank         | (8.929)                         | (0,00)               |
| (177.419) | EOG Resources Inc                     | Goldman Sachs International | (13.286)                        | (0,00)               |
| 600       | ePlus Inc                             | Goldman Sachs International | (531)                           | (0,00)               |
| (2.800)   | EQT Corp                              | Goldman Sachs International | (5.407)                         | (0,00)               |
| 47.053    | EQT Corp                              | Morgan Stanley              | (18.221)                        | (0,00)               |
| 59.708    | Equifax Inc                           | Morgan Stanley              | (1.978)                         | (0,00)               |
| (256.261) | Equifax Inc                           | Goldman Sachs International | (17.896)                        | (0,00)               |
| (45.152)  | Equifax Inc                           | JPMorgan Chase Bank         | (475)                           | (0,00)               |
| 600       | Equinix Inc                           | Goldman Sachs International | (8.322)                         | (0,00)               |
| 4.846.725 | Equinor ASA                           | Goldman Sachs International | (20.907)                        | (0,01)               |
| (37.434)  | Equity LifeStyle Properties Inc       | Morgan Stanley              | (1.813)                         | (0,00)               |
| 2.400.000 | Erste Group Bank AG                   | Société Générale            | (38.339)                        | (0,01)               |
| 26.307    | Esab Corp                             | Morgan Stanley              | (4.379)                         | (0,00)               |
| 10.400    | Essential Properties Realty Trust Inc | Goldman Sachs International | (15.382)                        | (0,00)               |
| 2.670     | Ethan Allen Interiors Inc             | Goldman Sachs International | (854)                           | (0,00)               |
| (67.794)  | Etsy Inc                              | Morgan Stanley              | (3.139)                         | (0,00)               |
| 25.404    | Evercore Inc Class A                  | Morgan Stanley              | (7.463)                         | (0,00)               |
| (104.576) | Everest Group Ltd                     | Morgan Stanley              | (4.090)                         | (0,00)               |
| 41.650    | EverQuote Inc Class A                 | JPMorgan Chase Bank         | (4.838)                         | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,66 %) (31. Dezember 2023: (1,26 %)) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung                      | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|--|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 6.000       | Everus Construction Group Inc              | Goldman Sachs International | (32.654)                        | (0,01)               |
| (686)       | Evolent Health Inc Class A                 | Goldman Sachs International | (71)                            | (0,00)               |
| 221.893     | Evraz Plc                                  | Goldman Sachs International | (233.183)                       | (0,03)               |
| 2.778       | Exelixis Inc                               | Goldman Sachs International | (1.195)                         | (0,00)               |
| (1.500)     | Expand Energy Corp                         | Goldman Sachs International | (5.334)                         | (0,00)               |
| 280         | Expeditors International of Washington Inc | Goldman Sachs International | (222)                           | (0,00)               |
| (59.529)    | Experian Plc                               | JPMorgan Chase Bank         | (3.504)                         | (0,00)               |
| (56.063)    | Experian Plc                               | Morgan Stanley              | (7.081)                         | (0,00)               |
| (221.872)   | Experian Plc                               | Goldman Sachs International | (18.891)                        | (0,00)               |
| 1.600       | Exponent Inc                               | Goldman Sachs International | (2.209)                         | (0,00)               |
| 54.121      | Extra Space Storage Inc                    | Morgan Stanley              | (2.198)                         | (0,00)               |
| 117.145     | F5 Inc                                     | Morgan Stanley              | (7.088)                         | (0,00)               |
| 129.149     | FactSet Research Systems Inc               | Morgan Stanley              | (4.091)                         | (0,00)               |
| 6.549       | FactSet Research Systems Inc               | JPMorgan Chase Bank         | (161)                           | (0,00)               |
| (195.639)   | Fair Isaac Corp                            | Goldman Sachs International | (16.545)                        | (0,00)               |
| (52.264)    | Fair Isaac Corp                            | Morgan Stanley              | (526)                           | (0,00)               |
| 5.302.696   | Fastighets AB Balder                       | BNP Paribas                 | (851.922)                       | (0,11)               |
| (40.729)    | Fastly Inc Class A                         | Goldman Sachs International | (1.829)                         | (0,00)               |
| (39.458)    | Fastly Inc Class A                         | JPMorgan Chase Bank         | (2.702)                         | (0,00)               |
| (25.487)    | Fastly Inc Class A                         | Morgan Stanley              | (2.809)                         | (0,00)               |
| 9.880       | Fathom Digital Manufacturing Corporation   | Goldman Sachs International | (108)                           | (0,00)               |
| 3.400       | Federal Realty Investment Trust            | Goldman Sachs International | (7.455)                         | (0,00)               |
| (30)        | FedEx Corp                                 | Goldman Sachs International | (317)                           | (0,00)               |
| 4.000       | Ferguson Enterprises Inc                   | Goldman Sachs International | (48.480)                        | (0,01)               |
| 49.041      | Fidelity National Information Services Inc | Morgan Stanley              | (9.909)                         | (0,00)               |
| 21.012      | Fifth Third Bancorp                        | Morgan Stanley              | (2.435)                         | (0,00)               |
| 158.808     | FincoBank SpA                              | Goldman Sachs International | (16.129)                        | (0,00)               |
| 53.957      | First Citizens BancShares Inc Class A      | Morgan Stanley              | (5.180)                         | (0,00)               |
| 1.600       | First Financial Bankshares Inc             | Goldman Sachs International | (1.284)                         | (0,00)               |
| 4.100       | First Horizon Corp                         | Goldman Sachs International | (1.091)                         | (0,00)               |
| (286.388)   | First Solar Inc                            | JPMorgan Chase Bank         | (17.570)                        | (0,00)               |
| (1.048.563) | First Solar Inc                            | Goldman Sachs International | (118.564)                       | (0,02)               |
| 3.200       | FirstEnergy Corp                           | Goldman Sachs International | (128)                           | (0,00)               |
| 92.311      | Fiserv Inc                                 | Morgan Stanley              | (22.164)                        | (0,00)               |
| (295.882)   | Fiserv Inc                                 | Goldman Sachs International | (1.926)                         | (0,00)               |
| 65.287      | Fiverr International Ltd                   | Goldman Sachs International | (4.500)                         | (0,00)               |
| (20.052)    | Flutter Entertainment Plc                  | JPMorgan Chase Bank         | (228)                           | (0,00)               |
| (100.138)   | Flutter Entertainment Plc                  | Goldman Sachs International | (53.203)                        | (0,01)               |
| 28.969      | FNB Corp                                   | Morgan Stanley              | (768)                           | (0,00)               |
| 52.293      | Fortinet Inc                               | Morgan Stanley              | (7.441)                         | (0,00)               |
| (50)        | Fortive Corp                               | Goldman Sachs International | (6)                             | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte (1,66 %) (31. Dezember 2023: (1,26 %)) (Fortsetzung)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung           | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|---------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 18.000    | Fortrea Holdings Inc            | Goldman Sachs International | (29.880)                        | (0,01)               |
| (5.900)   | Forward Air Corp                | Goldman Sachs International | (11.266)                        | (0,00)               |
| 25.493    | Fox Corp Class A                | Morgan Stanley              | (8.765)                         | (0,00)               |
| 800       | Franklin Electric Co Inc        | Goldman Sachs International | (1.262)                         | (0,00)               |
| 42.156    | Freshworks Inc Class A          | JPMorgan Chase Bank         | (2.171)                         | (0,00)               |
| (42.899)  | FTI Consulting Inc              | Morgan Stanley              | (2.211)                         | (0,00)               |
| 300       | FTI Consulting Inc              | Goldman Sachs International | (748)                           | (0,00)               |
| 303.157   | Fulton Financial Corp           | Goldman Sachs International | (7.932)                         | (0,00)               |
| 71.005    | Galderma Group AG               | Goldman Sachs International | (21.152)                        | (0,01)               |
| 180.870   | Garmin Ltd                      | Goldman Sachs International | (785)                           | (0,00)               |
| 4.000     | Gates Industrial Corp Plc       | Goldman Sachs International | (1.506)                         | (0,00)               |
| 2.580     | GE HealthCare Technologies Inc  | Goldman Sachs International | (3.698)                         | (0,00)               |
| (151.724) | GE Vernova Inc                  | Goldman Sachs International | (4.155)                         | (0,00)               |
| (10)      | Generac Holdings Inc            | Goldman Sachs International | (12)                            | (0,00)               |
| 1.000     | General Mills Inc               | Goldman Sachs International | (1.796)                         | (0,00)               |
| 261.368   | Gibson Energy Inc               | JPMorgan Chase Bank         | (13.068)                        | (0,00)               |
| 356.673   | Gibson Energy Inc               | Goldman Sachs International | (20.040)                        | (0,01)               |
| 1.560     | Gilead Sciences Inc             | Goldman Sachs International | (2.810)                         | (0,00)               |
| 26.700    | Gitlab Inc Class A              | Morgan Stanley              | (4.573)                         | (0,00)               |
| 500       | Glacier Bancorp Inc             | Goldman Sachs International | (421)                           | (0,00)               |
| (600)     | Glaukos Corp                    | Goldman Sachs International | (3.468)                         | (0,00)               |
| (104.172) | Global Payments Inc             | Morgan Stanley              | (4.107)                         | (0,00)               |
| 79.677    | Global Payments Inc             | Goldman Sachs International | (2.952)                         | (0,00)               |
| 55.631    | Global-e Online Ltd             | Goldman Sachs International | (576)                           | (0,00)               |
| 26.636    | Global-e Online Ltd             | JPMorgan Chase Bank         | (718)                           | (0,00)               |
| 29.713    | Globant SA                      | Morgan Stanley              | (4.647)                         | (0,00)               |
| (71.511)  | Globus Medical Inc Class A      | Morgan Stanley              | (1.894)                         | (0,00)               |
| 52.014    | GoDaddy Inc Class A             | JPMorgan Chase Bank         | (19.072)                        | (0,00)               |
| 170.119   | GoDaddy Inc Class A             | Goldman Sachs International | (14.861)                        | (0,00)               |
| 74.056    | GoDaddy Inc Class A             | Morgan Stanley              | (7.241)                         | (0,00)               |
| (1.300)   | Goosehead Insurance Inc Class A | Goldman Sachs International | (1.059)                         | (0,00)               |
| 27.438    | GRAIL Inc                       | Morgan Stanley              | (5.032)                         | (0,00)               |
| 26.000    | GRAIL Inc                       | Goldman Sachs International | (127.140)                       | (0,02)               |
| 300       | Grand Canyon Education Inc      | Goldman Sachs International | (200)                           | (0,00)               |
| (6.900)   | Green Plains Inc                | Goldman Sachs International | (1.772)                         | (0,00)               |
| 400       | Greif Inc Class A               | Goldman Sachs International | (349)                           | (0,00)               |
| 22.652    | Guidewire Software Inc          | Morgan Stanley              | (7.009)                         | (0,00)               |
| (107.586) | Guidewire Software Inc          | JPMorgan Chase Bank         | (4.021)                         | (0,00)               |
| (900)     | GXO Logistics Inc               | Goldman Sachs International | (703)                           | (0,00)               |
| (37.931)  | Haleon Plc                      | JPMorgan Chase Bank         | (413)                           | (0,00)               |
| 284.928   | Haleon Plc                      | Goldman Sachs International | (45.570)                        | (0,01)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,66 %) (31. Dezember 2023: (1,26 %)) (Fortsetzung)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                 | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|---------------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| (337.630) | Hancock Whitney Corp                  | Goldman Sachs International | (22.723)                        | (0,01)               |
| 700       | Hartford Financial Services Group Inc | Goldman Sachs International | (1.053)                         | (0,00)               |
| 200       | Hawkins Inc                           | Goldman Sachs International | (838)                           | (0,00)               |
| 200       | Hayward Holdings Inc                  | Goldman Sachs International | (49)                            | (0,00)               |
| (67.089)  | Hayward Holdings Inc                  | Morgan Stanley              | (2.899)                         | (0,00)               |
| 800       | HB Fuller Co                          | Goldman Sachs International | (744)                           | (0,00)               |
| (259.929) | HCA Healthcare Inc                    | Goldman Sachs International | (7.147)                         | (0,00)               |
| 29.766    | Healthcare Realty Trust Inc           | Morgan Stanley              | (1.783)                         | (0,00)               |
| (7.077)   | Healthcare Services Group Inc         | Goldman Sachs International | (71)                            | (0,00)               |
| 55.813    | Healthpeak Properties Inc             | Morgan Stanley              | (840)                           | (0,00)               |
| 47.503    | Heico Corp                            | Morgan Stanley              | (8.368)                         | (0,00)               |
| 79.882    | Helvetia Holding AG                   | JPMorgan Chase Bank         | (451)                           | (0,00)               |
| (308.810) | Henry Schein Inc                      | Goldman Sachs International | (24.779)                        | (0,01)               |
| (595.201) | Hershey Co                            | Goldman Sachs International | (64.899)                        | (0,01)               |
| (236.633) | Hershey Co                            | JPMorgan Chase Bank         | (9.361)                         | (0,00)               |
| (1.000)   | Hess Corp                             | Goldman Sachs International | (2.548)                         | (0,00)               |
| (65.160)  | Hess Midstream LP Class A             | JPMorgan Chase Bank         | (306)                           | (0,00)               |
| (91.868)  | Hewlett Packard Enterprise Co         | Morgan Stanley              | (3.956)                         | (0,00)               |
| (5.965)   | Hexcel Corp                           | Morgan Stanley              | (103)                           | (0,00)               |
| (130.300) | HF Sinclair Corp                      | Morgan Stanley              | (39.387)                        | (0,01)               |
| (1.900)   | HF Sinclair Corp                      | Goldman Sachs International | (288)                           | (0,00)               |
| 200       | Highwoods Properties Inc              | Goldman Sachs International | (148)                           | (0,00)               |
| 200       | Hilltop Holdings Inc                  | Goldman Sachs International | (115)                           | (0,00)               |
| 50.755    | Hilton Worldwide Holdings Inc         | Morgan Stanley              | (11.277)                        | (0,00)               |
| (80.015)  | Hims & Hers Health Inc                | Goldman Sachs International | (3.845)                         | (0,00)               |
| 75.000    | Hive Digital Technologies Ltd         | Goldman Sachs International | (14.648)                        | (0,00)               |
| 3.300     | HNI Corp                              | Goldman Sachs International | (3.524)                         | (0,00)               |
| 1.900     | Home BancShares Inc                   | Goldman Sachs International | (858)                           | (0,00)               |
| (108.018) | Home Depot Inc                        | Morgan Stanley              | (9.469)                         | (0,00)               |
| 100       | Home Depot Inc                        | Goldman Sachs International | (605)                           | (0,00)               |
| 62.849    | Honeywell International Inc           | Morgan Stanley              | (120)                           | (0,00)               |
| 581.937   | Hormel Foods Corp                     | Goldman Sachs International | (3.506)                         | (0,00)               |
| (100)     | Host Hotels & Resorts Inc             | Goldman Sachs International | (32)                            | (0,00)               |
| 24.644    | Houlihan Lokey Inc                    | Morgan Stanley              | (8.507)                         | (0,00)               |
| (72.044)  | Howard Hughes Holdings Inc            | Morgan Stanley              | (7.815)                         | (0,00)               |
| 5.000     | Howard Hughes Holdings Inc            | Goldman Sachs International | (24.204)                        | (0,01)               |
| 53.689    | Howmet Aerospace Inc                  | Morgan Stanley              | (4.831)                         | (0,00)               |
| (15.984)  | HP Inc                                | Morgan Stanley              | (1.751)                         | (0,00)               |
| 1.400.000 | HSBC Holdings PLC                     | Société Générale            | (19.016)                        | (0,00)               |
| 90        | Hubbell Inc                           | Goldman Sachs International | (3.324)                         | (0,00)               |
| 18.113    | HubSpot Inc                           | Morgan Stanley              | (4.152)                         | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte (1,66 %) (31. Dezember 2023: (1,26 %)) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung                  | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|--|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 5.900       | Hudson Pacific Properties Inc          | Goldman Sachs International | (885)                           | (0,00)               |
| 195.722     | Humana Inc                             | Goldman Sachs International | (1.772)                         | (0,00)               |
| 42.373      | Huntington Bancshares Inc              | Morgan Stanley              | (11.087)                        | (0,00)               |
| (27.066)    | Huntington Ingalls Industries Inc      | Morgan Stanley              | (7.706)                         | (0,00)               |
| (75.753)    | Huntsman Corp                          | Morgan Stanley              | (14.394)                        | (0,00)               |
| 25.600      | Hut 8 Corp                             | Goldman Sachs International | (147.204)                       | (0,02)               |
| 50.796      | Hyatt Hotels Corp Class A              | Morgan Stanley              | (11.440)                        | (0,00)               |
| (52.165)    | Ibotta Inc Class A                     | JPMorgan Chase Bank         | (517)                           | (0,00)               |
| (30.320)    | Ibotta Inc Class A                     | Goldman Sachs International | (2.637)                         | (0,00)               |
| (29.723)    | Ibotta Inc Class A                     | Morgan Stanley              | (3.194)                         | (0,00)               |
| 196.514     | ICON Plc                               | Goldman Sachs International | (926)                           | (0,00)               |
| 900         | ICU Medical Inc                        | Goldman Sachs International | (1.286)                         | (0,00)               |
| 33.199      | Idacorp Inc                            | Morgan Stanley              | (43)                            | (0,00)               |
| 600         | IDEX Corp                              | Goldman Sachs International | (5.003)                         | (0,00)               |
| (116.430)   | IDEXX Laboratories Inc                 | Morgan Stanley              | (14.145)                        | (0,00)               |
| 460         | Illinois Tool Works Inc                | Goldman Sachs International | (2.428)                         | (0,00)               |
| (94.620)    | Illinois Tool Works Inc                | Morgan Stanley              | (7.739)                         | (0,00)               |
| 2.000       | Illumina Inc                           | Goldman Sachs International | (2.848)                         | (0,00)               |
| 58.806      | Illumina Inc                           | Morgan Stanley              | (82)                            | (0,00)               |
| 900         | Impinj Inc                             | Goldman Sachs International | (2.609)                         | (0,00)               |
| 1.535       | Incyte Corp                            | Morgan Stanley              | (99)                            | (0,00)               |
| 200         | Independent Bank Corp                  | Goldman Sachs International | (332)                           | (0,00)               |
| 33.166      | Informatica Inc Class A                | Morgan Stanley              | (140)                           | (0,00)               |
| (130.876)   | ING Groep NV                           | JPMorgan Chase Bank         | (3.837)                         | (0,00)               |
| 52.201      | Ingersoll Rand Inc                     | Morgan Stanley              | (2.012)                         | (0,00)               |
| 556         | Innovid Corp                           | Goldman Sachs International | (12)                            | (0,00)               |
| (956.612)   | Insmed Inc                             | Goldman Sachs International | (3.099)                         | (0,00)               |
| 1.100       | Insperty Inc                           | Goldman Sachs International | (366)                           | (0,00)               |
| 30.244      | Inspire Medical Systems Inc            | Morgan Stanley              | (3.866)                         | (0,00)               |
| (175.162)   | Insulet Corp                           | Goldman Sachs International | (1.176)                         | (0,00)               |
| (96.109)    | Inter & Co Inc ClassA                  | Morgan Stanley              | (7.710)                         | (0,00)               |
| (94.378)    | Intercontinental Exchange Inc          | Goldman Sachs International | (3.944)                         | (0,00)               |
| (72.437)    | Intercontinental Exchange Inc          | Morgan Stanley              | (4.501)                         | (0,00)               |
| (133.805)   | Intermediate Capital Group Plc         | Goldman Sachs International | (12.458)                        | (0,00)               |
| 107.031     | International Business Machines Corp   | Morgan Stanley              | (12.888)                        | (0,00)               |
| (1.726.354) | International Flavors & Fragrances Inc | Goldman Sachs International | (200.063)                       | (0,03)               |
| (581.041)   | International Flavors & Fragrances Inc | JPMorgan Chase Bank         | (77.068)                        | (0,01)               |
| 49.159      | International Paper Co                 | Morgan Stanley              | (11.109)                        | (0,00)               |
| 321.858     | Intesa Sanpaolo                        | Goldman Sachs International | (1.290)                         | (0,00)               |
| 30.082      | Intra-Cellular Therapies Inc           | Morgan Stanley              | (4.576)                         | (0,00)               |
| (369.899)   | Intuitive Surgical Inc                 | Goldman Sachs International | (10.436)                        | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,66 %) (31. Dezember 2023: (1,26 %)) (Fortsetzung)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung              | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|------------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 6.090     | Invesco Ltd                        | Goldman Sachs International | (2.313)                         | (0,00)               |
| (107.037) | Invitation Homes Inc               | Morgan Stanley              | (7.778)                         | (0,00)               |
| (110.808) | Iovance Biotherapeutics Inc        | JPMorgan Chase Bank         | (35.883)                        | (0,01)               |
| (243.861) | Iovance Biotherapeutics Inc        | Goldman Sachs International | (47.643)                        | (0,01)               |
| (228.611) | IQVIA Holdings Inc                 | Goldman Sachs International | (4.361)                         | (0,00)               |
| 40.000    | IREN Ltd                           | Goldman Sachs International | (163.600)                       | (0,02)               |
| 3.100     | Iron Mountain Inc                  | Goldman Sachs International | (13.469)                        | (0,00)               |
| 300       | Itron Inc                          | Goldman Sachs International | (560)                           | (0,00)               |
| 400       | J & J Snack Foods Corp             | Goldman Sachs International | (1.169)                         | (0,00)               |
| 114.915   | Jabil Inc                          | Morgan Stanley              | (16.267)                        | (0,00)               |
| 100       | Jabil Inc                          | Goldman Sachs International | (405)                           | (0,00)               |
| 1.400     | Jack Henry & Associates Inc        | Goldman Sachs International | (2.754)                         | (0,00)               |
| 69.631    | Jacobs Solutions Inc               | Morgan Stanley              | (554)                           | (0,00)               |
| 3.000     | Jacobs Solutions Inc               | Goldman Sachs International | (10.473)                        | (0,00)               |
| 3.961     | Jazz Pharmaceuticals Plc           | Goldman Sachs International | (437)                           | (0,00)               |
| 1.000     | JB Hunt Transport Services Inc     | Goldman Sachs International | (1.389)                         | (0,00)               |
| 178.476   | JB Hunt Transport Services Inc     | JPMorgan Chase Bank         | (2.721)                         | (0,00)               |
| 4.000     | JBG SMITH Properties               | Goldman Sachs International | (818)                           | (0,00)               |
| (10.241)  | JD.com Inc                         | JPMorgan Chase Bank         | (106)                           | (0,00)               |
| (73.818)  | JD.com Inc                         | Goldman Sachs International | (6.040)                         | (0,00)               |
| 17.849    | JD.com Inc                         | Morgan Stanley              | (332)                           | (0,00)               |
| 35.660    | Jefferies Financial Group Inc      | Morgan Stanley              | (177)                           | (0,00)               |
| (745.223) | JM Smucker Co                      | Goldman Sachs International | (8.663)                         | (0,00)               |
| (101.196) | JM Smucker Co                      | JPMorgan Chase Bank         | (2.988)                         | (0,00)               |
| (464)     | John Bean Technologies Corp        | Goldman Sachs International | (2.250)                         | (0,00)               |
| 47.839    | Johnson Controls International Plc | Morgan Stanley              | (11.544)                        | (0,00)               |
| (780)     | JPMorgan Chase & Co                | Goldman Sachs International | (3.190)                         | (0,00)               |
| (78.658)  | Julius Baer Group Ltd              | Goldman Sachs International | (583)                           | (0,00)               |
| 600       | Juniper Networks Inc               | Goldman Sachs International | (90)                            | (0,00)               |
| 123.981   | KBC Group NV                       | JPMorgan Chase Bank         | (8.689)                         | (0,00)               |
| 184.619   | KBC Group NV                       | Goldman Sachs International | (14.434)                        | (0,00)               |
| (77.081)  | KBR Inc                            | Morgan Stanley              | (9.733)                         | (0,00)               |
| 25.000    | Kenvue Inc                         | Goldman Sachs International | (17.068)                        | (0,00)               |
| (66.708)  | Keros Therapeutics Inc             | JPMorgan Chase Bank         | (48.289)                        | (0,01)               |
| (12.290)  | Keros Therapeutics Inc             | Morgan Stanley              | (8.168)                         | (0,00)               |
| (380.143) | Keros Therapeutics Inc             | Goldman Sachs International | (257.988)                       | (0,03)               |
| 1.500     | Keurig Dr Pepper Inc               | Goldman Sachs International | (754)                           | (0,00)               |
| 5.870     | KeyCorp                            | Goldman Sachs International | (1.004)                         | (0,00)               |
| 1.000     | Kimberly-Clark Corp                | Goldman Sachs International | (1.881)                         | (0,00)               |
| (105.411) | Kimberly-Clark Corp                | Morgan Stanley              | (3.330)                         | (0,00)               |
| 47.709    | Kimco Realty Corp                  | Morgan Stanley              | (8.747)                         | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte (1,66 %) (31. Dezember 2023: (1,26 %)) (Fortsetzung)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                   | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|---|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 42.882    | Kinder Morgan Inc                       | Morgan Stanley              | (18.076)                        | (0,00)               |
| 34.643    | King Slide Works Co Ltd                 | Morgan Stanley              | (11.636)                        | (0,00)               |
| 20.872    | Kinsale Capital Group Inc               | Morgan Stanley              | (478)                           | (0,00)               |
| 42.390    | KKR & Co Inc                            | Morgan Stanley              | (15.492)                        | (0,00)               |
| (107.358) | KLA Corp                                | Morgan Stanley              | (5.441)                         | (0,00)               |
| 29.579    | Klaviyo Inc Class A                     | Goldman Sachs International | (6.677)                         | (0,00)               |
| 2.100     | Knowles Corp                            | Goldman Sachs International | (630)                           | (0,00)               |
| 400       | Kontoor Brands Inc                      | Goldman Sachs International | (351)                           | (0,00)               |
| (248.273) | Korro Bio Inc                           | Goldman Sachs International | (82.051)                        | (0,01)               |
| (175.710) | Korro Bio Inc                           | JPMorgan Chase Bank         | (69.319)                        | (0,01)               |
| (3.000)   | Kraft Heinz Co                          | Goldman Sachs International | (406)                           | (0,00)               |
| 400       | Kroger Co                               | Goldman Sachs International | (632)                           | (0,00)               |
| 1.146     | Kymera Therapeutics Inc                 | Goldman Sachs International | (305)                           | (0,00)               |
| 57.103    | Labcorp Holdings Inc                    | Morgan Stanley              | (2.488)                         | (0,00)               |
| (119.835) | Lam Research Corp                       | Morgan Stanley              | (21.823)                        | (0,01)               |
| (509.277) | Lamb Weston Holdings Inc                | JPMorgan Chase Bank         | (5.678)                         | (0,00)               |
| (71.330)  | Landstar System Inc                     | Morgan Stanley              | (4.353)                         | (0,00)               |
| 57.715    | Las Vegas Sands Corp                    | Morgan Stanley              | (804)                           | (0,00)               |
| 24.289    | Lazard Inc                              | Morgan Stanley              | (2.364)                         | (0,00)               |
| 500       | La-Z-Boy Inc                            | Goldman Sachs International | (330)                           | (0,00)               |
| 10.027    | Lear Corp                               | JPMorgan Chase Bank         | (92)                            | (0,00)               |
| (81.776)  | Lear Corp                               | Morgan Stanley              | (13.656)                        | (0,00)               |
| 400       | Lear Corp                               | Goldman Sachs International | (251)                           | (0,00)               |
| (31.858)  | Legal & General Group Plc               | JPMorgan Chase Bank         | (2.075)                         | (0,00)               |
| (84.996)  | Legal & General Group Plc               | Goldman Sachs International | (6.089)                         | (0,00)               |
| (107.720) | Leidos Holdings Inc                     | Morgan Stanley              | (14.015)                        | (0,00)               |
| 121.420   | Lennox International Inc                | Goldman Sachs International | (240)                           | (0,00)               |
| 300       | LGI Homes Inc                           | Goldman Sachs International | (386)                           | (0,00)               |
| 12.729    | Liberty Broadband Corp Class C          | Goldman Sachs International | (42.506)                        | (0,01)               |
| 41.892    | Liberty Global Ltd Class C              | Morgan Stanley              | (3.297)                         | (0,00)               |
| 40.000    | Liberty Global Ltd Class C              | Goldman Sachs International | (14.800)                        | (0,00)               |
| 19.428    | Liberty Media Corp Class A              | Morgan Stanley              | (16.564)                        | (0,00)               |
| 68.124    | Liberty Media Corp Class C              | Morgan Stanley              | (20.546)                        | (0,00)               |
| 5.888     | Lightspeed Commerce Inc                 | JPMorgan Chase Bank         | (644)                           | (0,00)               |
| (65.469)  | Lincoln National Corp                   | Morgan Stanley              | (1.868)                         | (0,00)               |
| 56.999    | Linde Plc                               | Morgan Stanley              | (221)                           | (0,00)               |
| 200       | Littelfuse Inc                          | Goldman Sachs International | (1.791)                         | (0,00)               |
| 121.807   | Lloyds Banking Group Plc                | JPMorgan Chase Bank         | (360)                           | (0,00)               |
| 18.118    | Lumentum Holdings Inc                   | Morgan Stanley              | (15.228)                        | (0,00)               |
| 51.739    | M&T Bank Corp                           | Morgan Stanley              | (3.241)                         | (0,00)               |
| 25.469    | MACOM Technology Solutions Holdings Inc | Morgan Stanley              | (7.274)                         | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte (1,66 %) (31. Dezember 2023: (1,26 %)) (Fortsetzung)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                    | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|--|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| (14.628)  | Madison Square Garden Entertainment Corp | JPMorgan Chase Bank         | (615)                           | (0,00)               |
| (12.408)  | Madison Square Garden Entertainment Corp | Goldman Sachs International | (195)                           | (0,00)               |
| (37.576)  | Madison Square Garden Entertainment Corp | Morgan Stanley              | (2.699)                         | (0,00)               |
| 634.553   | Magna International Inc                  | Goldman Sachs International | (18.544)                        | (0,00)               |
| 20.000    | Magnera Corp                             | Goldman Sachs International | (13.800)                        | (0,00)               |
| (2.200)   | ManpowerGroup Inc                        | Goldman Sachs International | (95)                            | (0,00)               |
| (78.636)  | ManpowerGroup Inc                        | Morgan Stanley              | (13.522)                        | (0,00)               |
| (178.257) | Maplebear Inc                            | Morgan Stanley              | (5.584)                         | (0,00)               |
| (43.258)  | Maplebear Inc                            | JPMorgan Chase Bank         | (251)                           | (0,00)               |
| (138.628) | Maplebear Inc                            | Goldman Sachs International | (4.353)                         | (0,00)               |
| 10.000    | MARA Holdings Inc                        | Goldman Sachs International | (51.103)                        | (0,01)               |
| 100       | Marriott International Inc Class A       | Goldman Sachs International | (767)                           | (0,00)               |
| (71.393)  | Marriott Vacations Worldwide Corp        | Morgan Stanley              | (5.326)                         | (0,00)               |
| 47.687    | Marvell Technology Inc                   | Morgan Stanley              | (30.460)                        | (0,01)               |
| 800       | Masco Corp                               | Goldman Sachs International | (934)                           | (0,00)               |
| 46.308    | Mastercard Inc Class A                   | Morgan Stanley              | (993)                           | (0,00)               |
| 89.808    | Mastercard Inc Class A                   | JPMorgan Chase Bank         | (1.116)                         | (0,00)               |
| 44.721    | Mastercard Inc Class A                   | Goldman Sachs International | (478)                           | (0,00)               |
| (3.800)   | Matador Resources Co                     | Goldman Sachs International | (8.221)                         | (0,00)               |
| (72.460)  | Mattel Inc                               | Morgan Stanley              | (8.552)                         | (0,00)               |
| (107.783) | McDonald's Corp                          | Morgan Stanley              | (1.183)                         | (0,00)               |
| 20.000    | MDU Resources Group Inc                  | Goldman Sachs International | (16.371)                        | (0,00)               |
| (3.600)   | Medical Properties Trust Inc             | Goldman Sachs International | (180)                           | (0,00)               |
| (180.806) | Mediobanca SpA                           | Goldman Sachs International | (4.117)                         | (0,00)               |
| (188.241) | Mediobanca SpA                           | JPMorgan Chase Bank         | (11.816)                        | (0,00)               |
| (69.715)  | Medpace Holdings Inc                     | Morgan Stanley              | (156)                           | (0,00)               |
| (239.316) | Medtronic Plc                            | Goldman Sachs International | (7.902)                         | (0,00)               |
| 133.569   | Merck & Co Inc                           | Goldman Sachs International | (285)                           | (0,00)               |
| (115.909) | Merck & Co Inc                           | Morgan Stanley              | (12.111)                        | (0,00)               |
| (100)     | Mercury Systems Inc                      | Goldman Sachs International | (385)                           | (0,00)               |
| 700       | Merit Medical Systems Inc                | Goldman Sachs International | (1.289)                         | (0,00)               |
| (124.994) | Merus NV                                 | JPMorgan Chase Bank         | (11.039)                        | (0,00)               |
| (401.235) | Merus NV                                 | Goldman Sachs International | (36.259)                        | (0,01)               |
| (48.176)  | Meta Platforms Inc Class A               | JPMorgan Chase Bank         | (246)                           | (0,00)               |
| (104.418) | Meta Platforms Inc Class A               | Morgan Stanley              | (375)                           | (0,00)               |
| 13.020    | Metallus Inc                             | Goldman Sachs International | (9.262)                         | (0,00)               |
| 580       | MetLife Inc                              | Goldman Sachs International | (285)                           | (0,00)               |
| (121.007) | Mettler-Toledo International Inc         | Morgan Stanley              | (15.856)                        | (0,00)               |
| (63.521)  | Mgic Investment Corp                     | Morgan Stanley              | (478)                           | (0,00)               |
| 3.400     | MGIC Investment Corp                     | Goldman Sachs International | (814)                           | (0,00)               |
| (115.826) | MGP Ingredients Inc                      | Goldman Sachs International | (33.470)                        | (0,01)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,66 %) (31. Dezember 2023: (1,26 %)) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung                                     | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|---|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| (20.362)    | MGP Ingredients Inc                                       | JPMorgan Chase Bank         | (3.096)                         | (0,00)               |
| (17.265)    | Micron Technology Inc                                     | Morgan Stanley              | (2.213)                         | (0,00)               |
| (295.389)   | Microsoft Corp  | Goldman Sachs International | (5.665)                         | (0,00)               |
| (89.480)    | Microsoft Corp  | JPMorgan Chase Bank         | (2.437)                         | (0,00)               |
| (607)       | Mirati Therapeutics                                       | Morgan Stanley              | (303)                           | (0,00)               |
| 4.100       | Mister Car Wash Inc                                       | Goldman Sachs International | (243)                           | (0,00)               |
| (20)        | Moderna Inc   | Goldman Sachs International | (37)                            | (0,00)               |
| (107.805)   | Molina Healthcare Inc                                     | Morgan Stanley              | (7.738)                         | (0,00)               |
| (289.937)   | Molina Healthcare Inc                                     | Goldman Sachs International | (5.398)                         | (0,00)               |
| (57.170)    | Monday.com Ltd  | Goldman Sachs International | (6.531)                         | (0,00)               |
| 55.354      | Monster Beverage Corp                                     | Morgan Stanley              | (4.095)                         | (0,00)               |
| (386.998)   | Monster Beverage Corp                                     | Goldman Sachs International | (19.994)                        | (0,00)               |
| (105.115)   | Moody's Corp  | Morgan Stanley              | (2.138)                         | (0,00)               |
| 114.190     | MoonLake Immunotherapeutics                               | Goldman Sachs International | (14.646)                        | (0,00)               |
| (2.770)     | Mosaic Co   | Goldman Sachs International | (1.346)                         | (0,00)               |
| (74.136)    | MSA Safety Inc  | Morgan Stanley              | (5.262)                         | (0,00)               |
| 300.098     | Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen | Goldman Sachs International | (3.344)                         | (0,00)               |
| (136.216)   | Murphy USA Inc  | JPMorgan Chase Bank         | (1.014)                         | (0,00)               |
| (14.200)    | Myriad Genetics Inc                                       | Goldman Sachs International | (2.306)                         | (0,00)               |
| 100.000     | Nano Dimension Ltd  | Goldman Sachs International | (1.651)                         | (0,00)               |
| 45.373      | Nasdaq Inc  | Morgan Stanley              | (13.996)                        | (0,00)               |
| (3.515.345) | Naspers Ltd   | Goldman Sachs International | (3.440)                         | (0,00)               |
| 3.000       | Natera Inc  | Goldman Sachs International | (27.474)                        | (0,01)               |
| 160.239     | National Bank of Greece SA                                | Morgan Stanley              | (13.862)                        | (0,00)               |
| (71.070)    | National Fuel Gas Co                                      | Morgan Stanley              | (2.737)                         | (0,00)               |
| 1.500.000   | National Storage Finance Pty Ltd                          | Nomura                      | (143.534)                       | (0,02)               |
| 104.641     | Natwest Group Plc   | Goldman Sachs International | (13.065)                        | (0,00)               |
| (9.600)     | Navient Corp  | Goldman Sachs International | (57)                            | (0,00)               |
| 1.400       | NBT Bancorp Inc   | Goldman Sachs International | (1.921)                         | (0,00)               |
| 20.000      | Nebius Group NV   | Goldman Sachs International | (114.000)                       | (0,02)               |
| 1.055.328   | Nedbank Group Ltd   | JPMorgan Chase Bank         | (6.464)                         | (0,00)               |
| 3.636.964   | Nedbank Group Ltd   | Goldman Sachs International | (12.462)                        | (0,00)               |
| (241.527)   | NetApp Inc  | Morgan Stanley              | (12.172)                        | (0,00)               |
| (121.900)   | Neumora Therapeutics Inc                                  | Goldman Sachs International | (24.739)                        | (0,01)               |
| 166.030     | Neurocrine Biosciences Inc                                | Goldman Sachs International | (19.087)                        | (0,00)               |
| (71.876)    | New York Times Co Class A                                 | Morgan Stanley              | (4.133)                         | (0,00)               |
| 27.563      | Newell Brands Inc   | Morgan Stanley              | (3.117)                         | (0,00)               |
| 80.911      | Newell Brands Inc   | Goldman Sachs International | (11.825)                        | (0,00)               |
| 21.753      | News Corp Class A   | Morgan Stanley              | (699)                           | (0,00)               |
| (134.316)   | News Corp Class A   | Goldman Sachs International | (6.792)                         | (0,00)               |
| 28.859      | News Corp Class B   | Morgan Stanley              | (2.337)                         | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,66 %) (31. Dezember 2023: (1,26 %)) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung               | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|-------------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 2.200       | NexPoint Residential Trust Inc      | Goldman Sachs International | (5.566)                         | (0,00)               |
| 2.300       | NIKE Inc Class B                    | Goldman Sachs International | (3.163)                         | (0,00)               |
| 100         | NMI Holdings Inc                    | Goldman Sachs International | (44)                            | (0,00)               |
| (90.769)    | NN Group NV                         | JPMorgan Chase Bank         | (2.131)                         | (0,00)               |
| (200)       | NNN REIT Inc                        | Goldman Sachs International | (52)                            | (0,00)               |
| (1.996.761) | Nordea Bank Abp                     | Goldman Sachs International | (9.373)                         | (0,00)               |
| (3.500)     | Northwestern Energy Group Inc       | Goldman Sachs International | (1.449)                         | (0,00)               |
| (72.925)    | NOV Inc                             | Morgan Stanley              | (12.541)                        | (0,00)               |
| (22.600)    | NOV Inc                             | Goldman Sachs International | (2.807)                         | (0,00)               |
| (18.539)    | Novartis AG                         | Goldman Sachs International | (2.898)                         | (0,00)               |
| (69.257)    | Novo Nordisk A/S                    | Goldman Sachs International | (2.211)                         | (0,00)               |
| (53.567)    | NU Holdings Ltd Class A             | JPMorgan Chase Bank         | (4.988)                         | (0,00)               |
| (90.740)    | NU Holdings Ltd Class A             | Morgan Stanley              | (9.523)                         | (0,00)               |
| (85.594)    | NU Holdings Ltd Class A             | Goldman Sachs International | (5.229)                         | (0,00)               |
| (410.033)   | NVIDIA Corp                         | Morgan Stanley              | (12.296)                        | (0,00)               |
| 870         | Old Dominion Freight Line Inc       | Goldman Sachs International | (4.729)                         | (0,00)               |
| (149.922)   | Olema Pharmaceuticals Inc           | Goldman Sachs International | (31.948)                        | (0,01)               |
| 34.081      | Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc | Morgan Stanley              | (4.954)                         | (0,00)               |
| 1.200       | ON Semiconductor Corp               | Goldman Sachs International | (3.406)                         | (0,00)               |
| (133.027)   | ON Semiconductor Corp               | Morgan Stanley              | (12.898)                        | (0,00)               |
| 15.770      | Opera Ltd                           | Goldman Sachs International | (1.807)                         | (0,00)               |
| (79.206)    | Option Care Health Inc              | Goldman Sachs International | (996)                           | (0,00)               |
| (138.438)   | Oracle Corp                         | Morgan Stanley              | (7.086)                         | (0,00)               |
| 200         | O'Reilly Automotive Inc             | Goldman Sachs International | (4.949)                         | (0,00)               |
| (1.100)     | Organon & Co                        | Goldman Sachs International | (207)                           | (0,00)               |
| 1.900       | Oxford Industries Inc               | Goldman Sachs International | (624)                           | (0,00)               |
| 53.466      | PACCAR Inc                          | Morgan Stanley              | (2.165)                         | (0,00)               |
| (67.123)    | Palo Alto Networks Inc              | Morgan Stanley              | (1.615)                         | (0,00)               |
| (200)       | Par Pacific Holdings Inc            | Goldman Sachs International | (27)                            | (0,00)               |
| 600         | Park National Corp                  | Goldman Sachs International | (3.745)                         | (0,00)               |
| (89.436)    | Parker-Hannifin Corp                | JPMorgan Chase Bank         | (1.802)                         | (0,00)               |
| (2.142.565) | Parker-Hannifin Corp                | Goldman Sachs International | (93.959)                        | (0,01)               |
| 44.757      | Partners Group Holding AG           | JPMorgan Chase Bank         | (902)                           | (0,00)               |
| 15.711      | Patterson Cos Inc                   | Goldman Sachs International | (1.787)                         | (0,00)               |
| 134.830     | Paychex Inc                         | Goldman Sachs International | (1.063)                         | (0,00)               |
| 18.947      | Paychex Inc                         | JPMorgan Chase Bank         | (265)                           | (0,00)               |
| 24.211      | Paycor HCM Inc                      | Morgan Stanley              | (12.738)                        | (0,00)               |
| 26.090      | Paylocity Holding Corp              | Morgan Stanley              | (6.261)                         | (0,00)               |
| 86.413      | PayPal Holdings Inc                 | Morgan Stanley              | (5.782)                         | (0,00)               |
| (179.103)   | PayPal Holdings Inc                 | JPMorgan Chase Bank         | (2.474)                         | (0,00)               |
| (425.105)   | Pentair Plc                         | JPMorgan Chase Bank         | (9.207)                         | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte (1,66 %) (31. Dezember 2023: (1,26 %)) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung                       | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|---|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| (54.891)    | Penumbra Inc                                | Morgan Stanley              | (1.920)                         | (0,00)               |
| (307.081)   | PepsiCo Inc                                 | Goldman Sachs International | (35.173)                        | (0,01)               |
| 1.500       | Performance Food Group Co                   | Goldman Sachs International | (1.465)                         | (0,00)               |
| 28.471      | Permian Resources Corp                      | Morgan Stanley              | (1.794)                         | (0,00)               |
| (6.400)     | Permian Resources Corp                      | Goldman Sachs International | (3.353)                         | (0,00)               |
| (135.553)   | Perrigo Co Plc                              | Goldman Sachs International | (4.442)                         | (0,00)               |
| (95.798)    | Perrigo Co Plc                              | JPMorgan Chase Bank         | (4.519)                         | (0,00)               |
| 84.177      | Pfizer Inc                                  | Goldman Sachs International | (1.425)                         | (0,00)               |
| (113.401)   | Pfizer Inc                                  | Morgan Stanley              | (6.481)                         | (0,00)               |
| 147.927     | Phillips 66                                 | JPMorgan Chase Bank         | (4.529)                         | (0,00)               |
| 21.870      | Pinnacle Financial Partners Inc             | Morgan Stanley              | (9.199)                         | (0,00)               |
| (193.022)   | Pinterest Inc Class A                       | Goldman Sachs International | (7.326)                         | (0,00)               |
| (76.532)    | Pinterest Inc Class A                       | Morgan Stanley              | (3.872)                         | (0,00)               |
| (40.074)    | Pinterest Inc Class A                       | JPMorgan Chase Bank         | (678)                           | (0,00)               |
| (118.900)   | Piraeus Financial Holdings SA               | Morgan Stanley              | (3.923)                         | (0,00)               |
| 1.200       | Planet Fitness Inc Class A                  | Goldman Sachs International | (1.811)                         | (0,00)               |
| 90          | PNC Financial Services Group Inc            | Goldman Sachs International | (691)                           | (0,00)               |
| (73.070)    | Popular Inc                                 | Morgan Stanley              | (4.577)                         | (0,00)               |
| 400         | Post Holdings Inc                           | Goldman Sachs International | (175)                           | (0,00)               |
| 28.632      | Post Holdings Inc                           | Morgan Stanley              | (3.364)                         | (0,00)               |
| 223.410     | Poste Italiane SpA                          | Goldman Sachs International | (13.196)                        | (0,00)               |
| (469.242)   | Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA | JPMorgan Chase Bank         | (1.345)                         | (0,00)               |
| (436.639)   | PPL Corp                                    | JPMorgan Chase Bank         | (11.929)                        | (0,00)               |
| 500         | Preferred Bank                              | Goldman Sachs International | (3.340)                         | (0,00)               |
| (156.606)   | Procter & Gamble Co                         | JPMorgan Chase Bank         | (6.621)                         | (0,00)               |
| (1.383.787) | Procter & Gamble Co                         | Goldman Sachs International | (33.922)                        | (0,01)               |
| 6.500       | PROG Holdings Inc                           | Goldman Sachs International | (4.126)                         | (0,00)               |
| 1.900       | Progress Software Corp                      | Goldman Sachs International | (2.410)                         | (0,00)               |
| 2.200       | Prologis Inc                                | Goldman Sachs International | (1.628)                         | (0,00)               |
| 30.664      | Prosperity Bancshares Inc                   | Morgan Stanley              | (712)                           | (0,00)               |
| (107.530)   | Prudential Financial Inc                    | Morgan Stanley              | (7.512)                         | (0,00)               |
| 55.314      | PTC Inc                                     | Morgan Stanley              | (2.472)                         | (0,00)               |
| 1.708       | PTC Therapeutics Inc                        | Goldman Sachs International | (719)                           | (0,00)               |
| 73.913      | Pure Storage Inc Class A                    | Morgan Stanley              | (4.525)                         | (0,00)               |
| 1.300       | PVH Corp                                    | Goldman Sachs International | (3.657)                         | (0,00)               |
| 700         | Qorvo Inc                                   | Goldman Sachs International | (1.398)                         | (0,00)               |
| (161.894)   | Qorvo Inc                                   | Morgan Stanley              | (40.577)                        | (0,01)               |
| (108.160)   | QUALCOMM Inc                                | Morgan Stanley              | (6.973)                         | (0,00)               |
| 200         | Qualys Inc                                  | Goldman Sachs International | (1.200)                         | (0,00)               |
| 57.655      | Quanta Services Inc                         | Morgan Stanley              | (629)                           | (0,00)               |
| (1.275.431) | Quanta Services Inc                         | Goldman Sachs International | (60.283)                        | (0,01)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte (1,66 %) (31. Dezember 2023: (1,26 %)) (Fortsetzung)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung         | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|-------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| (355.032) | Quanta Services Inc           | JPMorgan Chase Bank         | (9.422)                         | (0,00)               |
| (230.378) | Quest Diagnostics Inc         | Goldman Sachs International | (5.587)                         | (0,00)               |
| 29.542    | QuidelOrtho Corp              | Morgan Stanley              | (6.604)                         | (0,00)               |
| (26.143)  | RadNet Inc                    | Goldman Sachs International | (535)                           | (0,00)               |
| (71.379)  | Ralph Lauren Corp             | Morgan Stanley              | (1.235)                         | (0,00)               |
| 227.085   | Range Resources Corp          | Goldman Sachs International | (11.715)                        | (0,00)               |
| 46.695    | Raymond James Financial Inc   | Morgan Stanley              | (12.104)                        | (0,00)               |
| 28.919    | RBC Bearings Inc              | Morgan Stanley              | (2.982)                         | (0,00)               |
| 300       | RBC Bearings Inc              | Goldman Sachs International | (1.404)                         | (0,00)               |
| 45.570    | REA Group Ltd                 | JPMorgan Chase Bank         | (5.011)                         | (0,00)               |
| 5.059     | REA Group Ltd                 | Morgan Stanley              | (320)                           | (0,00)               |
| 227.800   | REA Group Ltd                 | Goldman Sachs International | (14.586)                        | (0,00)               |
| 100       | Regal Rexnord Corp            | Goldman Sachs International | (398)                           | (0,00)               |
| 59.378    | Regency Centers Corp          | Morgan Stanley              | (2.102)                         | (0,00)               |
| 3.200     | Regency Centers Corp          | Goldman Sachs International | (4.416)                         | (0,00)               |
| 700       | Reliance Inc                  | Goldman Sachs International | (1.681)                         | (0,00)               |
| 500       | RenaissanceRe Holdings Ltd    | Goldman Sachs International | (1.193)                         | (0,00)               |
| 5.000     | Renasant Corp                 | Goldman Sachs International | (8.250)                         | (0,00)               |
| 153.181   | Repsol SA                     | Goldman Sachs International | (5.763)                         | (0,00)               |
| 32.904    | Repsol SA                     | JPMorgan Chase Bank         | (797)                           | (0,00)               |
| 570       | Republic Services Inc         | Goldman Sachs International | (3.046)                         | (0,00)               |
| (14.300)  | Resolute Forest Products Inc  | Goldman Sachs International | (8.294)                         | (0,00)               |
| (21.647)  | REVOLUTION Medicines Inc      | JPMorgan Chase Bank         | (2.157)                         | (0,00)               |
| (151.944) | REVOLUTION Medicines Inc      | Goldman Sachs International | (14.193)                        | (0,00)               |
| 33.280    | RH                            | Morgan Stanley              | (5.194)                         | (0,00)               |
| 1.457     | Rhythm Pharmaceuticals Inc    | Goldman Sachs International | (467)                           | (0,00)               |
| 15.900    | Riot Platforms Inc            | Goldman Sachs International | (48.424)                        | (0,01)               |
| (64.271)  | Rithm Capital Corp            | Morgan Stanley              | (799)                           | (0,00)               |
| 3.200     | Robert Half Inc               | Goldman Sachs International | (3.112)                         | (0,00)               |
| (60.456)  | Robert Half International Inc | Morgan Stanley              | (2.943)                         | (0,00)               |
| (24.158)  | Robinhood Markets Inc Class A | JPMorgan Chase Bank         | (806)                           | (0,00)               |
| 4.710     | Robinhood Markets Inc Class A | Morgan Stanley              | (29.664)                        | (0,01)               |
| (95.475)  | Robinhood Markets Inc Class A | Goldman Sachs International | (38)                            | (0,00)               |
| 418.377   | Roche Holding AG              | JPMorgan Chase Bank         | (7.181)                         | (0,00)               |
| 37.904    | Roku Inc                      | Goldman Sachs International | (13)                            | (0,00)               |
| 329.486   | Ross Stores Inc               | Goldman Sachs International | (8.622)                         | (0,00)               |
| 800       | Royal Gold Inc                | Goldman Sachs International | (1.987)                         | (0,00)               |
| (72.594)  | Royal Gold Inc                | Morgan Stanley              | (9.786)                         | (0,00)               |
| (99.704)  | RPM International Inc         | Morgan Stanley              | (4.253)                         | (0,00)               |
| 1.300     | Ryder System Inc              | Goldman Sachs International | (1.025)                         | (0,00)               |
| 2.000     | S&T Bancorp Inc               | Goldman Sachs International | (1.733)                         | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte (1,66 %) (31. Dezember 2023: (1,26 %)) (Fortsetzung)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                   | Gegenpartei                   | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|---|-------------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 900       | Safety Insurance Group Inc              | Goldman Sachs International   | (124)                           | (0,00)               |
| 27.580    | Saia Inc                                | Morgan Stanley                | (1.068)                         | (0,00)               |
| (96.171)  | Salesforce Inc                          | Goldman Sachs International   | (4.505)                         | (0,00)               |
| (44.909)  | Salesforce Inc                          | JPMorgan Chase Bank           | (3.243)                         | (0,00)               |
| 7.900     | Sally Beauty Holdings Inc               | Goldman Sachs International   | (6.157)                         | (0,00)               |
| 4.327.354 | Sanlam Ltd                              | Goldman Sachs International   | (922)                           | (0,00)               |
| (14.381)  | Sanofi                                  | JPMorgan Chase Bank           | (583)                           | (0,00)               |
| 61.287    | SAP SE                                  | Morgan Stanley                | (5.165)                         | (0,00)               |
| (452.581) | Sarepta Therapeutics Inc                | Goldman Sachs International   | (26.295)                        | (0,01)               |
| (273.828) | Sarepta Therapeutics Inc                | JPMorgan Chase Bank           | (8.289)                         | (0,00)               |
| (107.861) | SBA Communications Corp                 | Morgan Stanley                | (9.908)                         | (0,00)               |
| 3.600     | Schneider National Inc Class B          | Goldman Sachs International   | (1.960)                         | (0,00)               |
| 2.297     | Schrodinger Inc                         | Goldman Sachs International   | (62)                            | (0,00)               |
| (79.198)  | Science Applications International Corp | Morgan Stanley                | (14.059)                        | (0,00)               |
| (177.941) | SCOR SE                                 | Goldman Sachs International   | (2.335)                         | (0,00)               |
| 4.000.000 | Seagate HDD Cayman                      | Nomura                        | (651.997)                       | (0,08)               |
| (64.439)  | Sealed Air Corp                         | Morgan Stanley                | (519)                           | (0,00)               |
| 22.000    | Select Medical Holdings Corp            | Goldman Sachs International   | (17.160)                        | (0,00)               |
| (76.147)  | Sensata Technologies Holding            | Morgan Stanley                | (16.958)                        | (0,00)               |
| 26.405    | SentinelOne Inc Class A                 | Morgan Stanley                | (1.346)                         | (0,00)               |
| 29.492    | Service Corp International              | Morgan Stanley                | (2.746)                         | (0,00)               |
| 800       | Service Corp International              | Goldman Sachs International   | (1.110)                         | (0,00)               |
| (19.619)  | ServiceTitan Inc Class A                | Morgan Stanley                | (366)                           | (0,00)               |
| (233.505) | Shake Shack Inc Class A                 | JPMorgan Chase Bank           | (1.665)                         | (0,00)               |
| (32.416)  | Sharkninja Inc                          | JPMorgan Chase Bank           | (1.292)                         | (0,00)               |
| (208.023) | Shell Plc                               | JPMorgan Chase Bank           | (6.105)                         | (0,00)               |
| (129.571) | Shell Plc                               | Goldman Sachs International   | (1.587)                         | (0,00)               |
| 250       | Sherwin-Williams Co                     | Goldman Sachs International   | (1.603)                         | (0,00)               |
| 68.631    | Shift4 Payments Inc Class A             | Goldman Sachs International   | (437)                           | (0,00)               |
| 54.382    | Shift4 Payments Inc Class A             | Morgan Stanley                | (8.005)                         | (0,00)               |
| 4.700     | Shoe Carnival Inc                       | Goldman Sachs International   | (13.607)                        | (0,00)               |
| 3.800     | Silgan Holdings Inc                     | Goldman Sachs International   | (2.898)                         | (0,00)               |
| 83.875    | Simply Good Foods Co                    | Goldman Sachs International   | (1.580)                         | (0,00)               |
| 100       | Simpson Manufacturing Co Inc            | Goldman Sachs International   | (1.835)                         | (0,00)               |
| 27.579    | SiteOne Landscape Supply Inc            | Morgan Stanley                | (536)                           | (0,00)               |
| 2.200.000 | SK Hynix Inc                            | Bank of America Merrill Lynch | (299.965)                       | (0,04)               |
| 158.513   | Skechers USA Inc Class A                | Goldman Sachs International   | (16.309)                        | (0,00)               |
| (3.200)   | SM Energy Co                            | Goldman Sachs International   | (752)                           | (0,00)               |
| 55.566    | Smurfit WestRock Plc                    | Morgan Stanley                | (4.959)                         | (0,00)               |
| 43.193    | Snowflake Inc Class A                   | Morgan Stanley                | (12.495)                        | (0,00)               |
| 2.200.000 | Societe Generale SA                     | BNP Paribas                   | (126.632)                       | (0,02)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,66 %) (31. Dezember 2023: (1,26 %)) (Fortsetzung)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                     | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|---|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 1.500.000 | Société Générale SA                       | BNP Paribas                 | (13.455)                        | (0,00)               |
| (106.043) | SoFi Technologies Inc                     | Goldman Sachs International | (6.251)                         | (0,00)               |
| (37.844)  | SoFi Technologies Inc                     | Morgan Stanley              | (21.947)                        | (0,00)               |
| 65.161    | Solidcore Resources PLC                   | Goldman Sachs International | (180.255)                       | (0,02)               |
| (69.231)  | Sonoco Products Co                        | Morgan Stanley              | (2.863)                         | (0,00)               |
| 55.190    | Southern Co                               | Morgan Stanley              | (3.604)                         | (0,00)               |
| (445.117) | SouthState Corp                           | Goldman Sachs International | (20.077)                        | (0,01)               |
| 120       | Southwest Airlines Co                     | Goldman Sachs International | (72)                            | (0,00)               |
| 61.440    | Southwest Airlines Co                     | Morgan Stanley              | (343)                           | (0,00)               |
| 7.000     | Southwest Gas Holdings Inc                | Goldman Sachs International | (10.430)                        | (0,00)               |
| (43.017)  | Spotify Technology SA                     | JPMorgan Chase Bank         | (611)                           | (0,00)               |
| 35.897    | SpringWorks Therapeutics Inc              | Goldman Sachs International | (1.411)                         | (0,00)               |
| (70.157)  | STAG Industrial Inc                       | Morgan Stanley              | (5.043)                         | (0,00)               |
| 270       | Stanley Black & Decker Inc                | Goldman Sachs International | (133)                           | (0,00)               |
| (343.800) | Starbucks Corp                            | JPMorgan Chase Bank         | (18.900)                        | (0,00)               |
| (695.871) | Starbucks Corp                            | Goldman Sachs International | (45.485)                        | (0,01)               |
| 1.000     | Stepan Co                                 | Goldman Sachs International | (2.221)                         | (0,00)               |
| 600       | STERIS Plc                                | Goldman Sachs International | (1.516)                         | (0,00)               |
| (107.599) | STERIS Plc                                | Morgan Stanley              | (6.341)                         | (0,00)               |
| (138.156) | Structure Therapeutics Inc                | Goldman Sachs International | (26.936)                        | (0,01)               |
| (317.021) | Structure Therapeutics Inc                | JPMorgan Chase Bank         | (93.195)                        | (0,01)               |
| 3.318     | Stryker Corp                              | Goldman Sachs International | (5.106)                         | (0,00)               |
| 600       | Summit Therapeutics Inc                   | Goldman Sachs International | (357)                           | (0,00)               |
| (112.054) | Sun Communities Inc                       | Morgan Stanley              | (8.380)                         | (0,00)               |
| (575.793) | Suncor Energy Inc                         | Goldman Sachs International | (22.560)                        | (0,01)               |
| 2.048     | Supernus Pharmaceuticals Inc              | Goldman Sachs International | (765)                           | (0,00)               |
| 3.372.238 | Svenska Handelsbanken                     | Goldman Sachs International | (5.975)                         | (0,00)               |
| 1.343.070 | Swedbank AB Class A                       | JPMorgan Chase Bank         | (2.441)                         | (0,00)               |
| 47.620    | Swedish Orphan Biovitrum AB               | Goldman Sachs International | (564)                           | (0,00)               |
| 1.400     | Synovus Financial Corp                    | Goldman Sachs International | (701)                           | (0,00)               |
| 800       | Sysco Corp                                | Goldman Sachs International | (1.736)                         | (0,00)               |
| (96.286)  | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd | Morgan Stanley              | (916)                           | (0,00)               |
| 49.713    | Take-Two Interactive Software Inc         | Morgan Stanley              | (11.253)                        | (0,00)               |
| 3.000     | Talen Energy Corp                         | Goldman Sachs International | (23.250)                        | (0,01)               |
| (4.200)   | Talos Energy Inc                          | Goldman Sachs International | (2.347)                         | (0,00)               |
| (2.300)   | Tandem Diabetes Care Inc                  | Goldman Sachs International | (815)                           | (0,00)               |
| (108.565) | Targa Resources Corp                      | Morgan Stanley              | (10.407)                        | (0,00)               |
| (300)     | Targa Resources Corp                      | Goldman Sachs International | (227)                           | (0,00)               |
| 178.227   | Target Corp                               | JPMorgan Chase Bank         | (7.210)                         | (0,00)               |
| 800       | TD SYNnex Corp                            | Goldman Sachs International | (3.265)                         | (0,00)               |
| (90.938)  | Teleflex Inc                              | Goldman Sachs International | (2.403)                         | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte (1,66 %) (31. Dezember 2023: (1,26 %)) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung         | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|-------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 350.260     | Tencent Holdings Ltd          | Goldman Sachs International | (8.463)                         | (0,00)               |
| 69.533      | Tencent Holdings Ltd          | Morgan Stanley              | (5.345)                         | (0,00)               |
| (80.614)    | Tenet Healthcare Corp         | Goldman Sachs International | (5.682)                         | (0,00)               |
| (71.751)    | Tenet Healthcare Corp         | Morgan Stanley              | (8.134)                         | (0,00)               |
| 9.372       | Teradyne Inc                  | Morgan Stanley              | (1.996)                         | (0,00)               |
| 30.000      | Terawulf Inc                  | Goldman Sachs International | (77.043)                        | (0,01)               |
| (4.449)     | Terns Pharmaceuticals Inc     | JPMorgan Chase Bank         | (817)                           | (0,00)               |
| (152.055)   | Terns Pharmaceuticals Inc     | Goldman Sachs International | (32.908)                        | (0,01)               |
| (176.277)   | Texas Roadhouse Inc           | JPMorgan Chase Bank         | (14.790)                        | (0,00)               |
| 521         | TG Therapeutics Inc           | Goldman Sachs International | (469)                           | (0,00)               |
| 29.643      | TKO Group Holdings Inc        | Morgan Stanley              | (7.892)                         | (0,00)               |
| 44.296      | T-Mobile US Inc               | Morgan Stanley              | (11.955)                        | (0,00)               |
| 32.862      | Toast Inc Class A             | Morgan Stanley              | (19.533)                        | (0,00)               |
| 11.362      | Toast Inc Class A             | JPMorgan Chase Bank         | (230)                           | (0,00)               |
| 25.764      | TPG Inc                       | Morgan Stanley              | (6.764)                         | (0,00)               |
| 52.603      | Tractor Supply Co             | Morgan Stanley              | (5.184)                         | (0,00)               |
| (89.505)    | Trade Desk Inc Class A        | Goldman Sachs International | (6.302)                         | (0,00)               |
| 46.834      | Tradeweb Markets Inc Class A  | Morgan Stanley              | (13.969)                        | (0,00)               |
| 45.345      | TransUnion                    | Morgan Stanley              | (13.349)                        | (0,00)               |
| 1.500       | Travel + Leisure Co           | Goldman Sachs International | (1.009)                         | (0,00)               |
| 30.197      | Travel + Leisure Co           | Morgan Stanley              | (1.155)                         | (0,00)               |
| 2.300       | TreeHouse Foods Inc           | Goldman Sachs International | (506)                           | (0,00)               |
| 1.200       | Tri Pointe Homes Inc          | Goldman Sachs International | (805)                           | (0,00)               |
| 800         | Trimble Inc                   | Goldman Sachs International | (1.208)                         | (0,00)               |
| (103.633)   | Trinet Group Inc              | Goldman Sachs International | (1.296)                         | (0,00)               |
| (10.477)    | Trip.com Group Ltd            | JPMorgan Chase Bank         | (261)                           | (0,00)               |
| (80.638)    | TripAdvisor Inc               | Goldman Sachs International | (4.104)                         | (0,00)               |
| (25.708)    | TripAdvisor Inc               | Morgan Stanley              | (124)                           | (0,00)               |
| (26.870)    | TripAdvisor Inc               | JPMorgan Chase Bank         | (3.007)                         | (0,00)               |
| 51.582      | Truist Financial Corp         | Morgan Stanley              | (6.097)                         | (0,00)               |
| (242.686)   | Uber Technologies Inc         | Morgan Stanley              | (34.473)                        | (0,00)               |
| 17.284      | Ubiquiti Inc                  | Morgan Stanley              | (19.119)                        | (0,00)               |
| 1.900.000   | UBS Group AG                  | Société Générale            | (20.170)                        | (0,01)               |
| 53.938      | UDR Inc                       | Morgan Stanley              | (5.606)                         | (0,00)               |
| (4.000)     | UGI Corp                      | Goldman Sachs International | (599)                           | (0,00)               |
| (1.412.739) | Ultragenyx Pharmaceutical Inc | Goldman Sachs International | (264.956)                       | (0,04)               |
| (181.791)   | Ultragenyx Pharmaceutical Inc | JPMorgan Chase Bank         | (23.795)                        | (0,01)               |
| 100         | UMB Financial Corp            | Goldman Sachs International | (276)                           | (0,00)               |
| (55.757)    | Under Armour Inc Class C      | Morgan Stanley              | (7.811)                         | (0,00)               |
| (75.774)    | Unicredit SpA                 | JPMorgan Chase Bank         | (3.657)                         | (0,00)               |
| (137.818)   | Unicredit SpA                 | Goldman Sachs International | (4.419)                         | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte (1,66 %) (31. Dezember 2023: (1,26 %)) (Fortsetzung)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-----------|--------------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 600       | UniFirst Corp                        | Goldman Sachs International | (2.977)                         | (0,00)               |
| (7.500)   | United Natural Foods Inc             | Goldman Sachs International | (1.617)                         | (0,00)               |
| (110)     | United Parcel Service Inc Class B    | Goldman Sachs International | (61)                            | (0,00)               |
| (220.507) | United Rentals Inc                   | Goldman Sachs International | (24.951)                        | (0,01)               |
| (179.370) | United Rentals Inc                   | JPMorgan Chase Bank         | (5.621)                         | (0,00)               |
| (40)      | UnitedHealth Group Inc               | Goldman Sachs International | (55)                            | (0,00)               |
| (8.400)   | Uniti Group Inc                      | Goldman Sachs International | (313)                           | (0,00)               |
| (33.460)  | Unity Software Inc                   | JPMorgan Chase Bank         | (6.515)                         | (0,00)               |
| 22.980    | Unity Software Inc                   | Morgan Stanley              | (9.418)                         | (0,00)               |
| 600       | Universal Display Corp               | Goldman Sachs International | (3.569)                         | (0,00)               |
| 500       | Universal Health Realty Income Trust | Goldman Sachs International | (76)                            | (0,00)               |
| 15.100    | Urban Edge Properties                | Goldman Sachs International | (15.705)                        | (0,00)               |
| 800       | Urban Outfitters Inc                 | Goldman Sachs International | (746)                           | (0,00)               |
| (122.761) | UroGen Pharma Ltd                    | Goldman Sachs International | (18.647)                        | (0,00)               |
| (55.863)  | UroGen Pharma Ltd                    | JPMorgan Chase Bank         | (7.275)                         | (0,00)               |
| 1.350     | US Bancorp                           | Goldman Sachs International | (1.384)                         | (0,00)               |
| 1.000     | US Foods Holding Corp                | Goldman Sachs International | (1.126)                         | (0,00)               |
| 1.300     | US Physical Therapy Inc              | Goldman Sachs International | (4.413)                         | (0,00)               |
| (59.201)  | Utz Brands Inc                       | Goldman Sachs International | (6.425)                         | (0,00)               |
| (61.080)  | UWM Holdings Corp                    | Morgan Stanley              | (7.179)                         | (0,00)               |
| (199.792) | Valley National Bancorp              | Goldman Sachs International | (14.686)                        | (0,00)               |
| 300       | Valmont Industries Inc               | Goldman Sachs International | (1.138)                         | (0,00)               |
| (212.852) | Vaxcyte Inc                          | JPMorgan Chase Bank         | (56.954)                        | (0,01)               |
| (1.608)   | Vaxcyte Inc                          | Goldman Sachs International | (476)                           | (0,00)               |
| 500       | Veeco Instruments Inc                | Goldman Sachs International | (546)                           | (0,00)               |
| 1.250.000 | Ventas Realty LP                     | Nomura                      | (111.848)                       | (0,02)               |
| (107.042) | Veralto Corp                         | Morgan Stanley              | (5.083)                         | (0,00)               |
| 4.000     | Veralto Corp                         | Goldman Sachs International | (9.261)                         | (0,00)               |
| (213.349) | Verisk Analytics Inc                 | Goldman Sachs International | (4.592)                         | (0,00)               |
| (55.980)  | Verisk Analytics Inc                 | JPMorgan Chase Bank         | (545)                           | (0,00)               |
| (35.350)  | Vertex Pharmaceuticals Inc           | Morgan Stanley              | (4.419)                         | (0,00)               |
| 218.650   | Vertex Pharmaceuticals Inc           | JPMorgan Chase Bank         | (5.498)                         | (0,00)               |
| 24.807    | VF Corp                              | Morgan Stanley              | (10.261)                        | (0,00)               |
| (13.100)  | VICI Properties Inc                  | Goldman Sachs International | (6.667)                         | (0,00)               |
| (95.968)  | VICI Properties Inc                  | Morgan Stanley              | (54)                            | (0,00)               |
| (31.645)  | Viridian Therapeutics Inc            | JPMorgan Chase Bank         | (901)                           | (0,00)               |
| (469.548) | Viridian Therapeutics Inc            | Goldman Sachs International | (33.178)                        | (0,01)               |
| 300       | Virtu Financial Inc Class A          | Goldman Sachs International | (352)                           | (0,00)               |
| 175.568   | Visa Inc Class A                     | Morgan Stanley              | (5.265)                         | (0,00)               |
| 73.458    | Visa Inc Class A                     | JPMorgan Chase Bank         | (262)                           | (0,00)               |
| 603.250   | Visa Inc Class A                     | Goldman Sachs International | (32.165)                        | (0,01)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte (1,66 %) (31. Dezember 2023: (1,26 %)) (Fortsetzung)

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung            | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|-------------|----------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 36.191      | Vistra Corp                      | Morgan Stanley              | (22.389)                        | (0,01)               |
| 6.300       | Vistra Corp                      | Goldman Sachs International | (24.894)                        | (0,01)               |
| 32.460      | Vornado Realty Trust             | Morgan Stanley              | (2.548)                         | (0,00)               |
| (62.405)    | Voya Financial Inc               | Morgan Stanley              | (3.257)                         | (0,00)               |
| (105.745)   | Vulcan Materials Co              | JPMorgan Chase Bank         | (7.096)                         | (0,00)               |
| (310.452)   | Vulcan Materials Co              | Goldman Sachs International | (25.780)                        | (0,01)               |
| 2.400       | Wabash National Corp             | Goldman Sachs International | (2.150)                         | (0,00)               |
| 49.227      | Walmart Inc                      | Morgan Stanley              | (9.297)                         | (0,00)               |
| (115)       | Warner Bros Discovery Inc        | Morgan Stanley              | (20.537)                        | (0,00)               |
| (107.635)   | Waters Corp                      | Morgan Stanley              | (4.041)                         | (0,00)               |
| 49.790      | Watsco Inc                       | Morgan Stanley              | (4.119)                         | (0,00)               |
| (70.535)    | Wayfair Inc Class A              | Goldman Sachs International | (4.819)                         | (0,00)               |
| 29.782      | Wayfair Inc Class A              | Morgan Stanley              | (846)                           | (0,00)               |
| (21.943)    | Wayfair Inc Class A              | JPMorgan Chase Bank         | (240)                           | (0,00)               |
| (4.600)     | Weatherford International Plc    | Goldman Sachs International | (15.588)                        | (0,00)               |
| (343)       | Webuild SpA                      | Société Générale            | (0)                             | (0,00)               |
| 410         | Wells Fargo & Co                 | Goldman Sachs International | (506)                           | (0,00)               |
| 56.533      | Welltower Inc                    | Morgan Stanley              | (2.356)                         | (0,00)               |
| (8.500)     | Welltower Inc                    | Goldman Sachs International | (4.481)                         | (0,00)               |
| 7.500       | Wendy's Co                       | Goldman Sachs International | (2.010)                         | (0,00)               |
| 6.800       | Werner Enterprises Inc           | Goldman Sachs International | (2.958)                         | (0,00)               |
| (9.895)     | WESCO International Inc          | Morgan Stanley              | (1.437)                         | (0,00)               |
| 92.756      | West Pharmaceutical Services Inc | Goldman Sachs International | (640)                           | (0,00)               |
| 2.288       | Westamerica BanCorp              | Goldman Sachs International | (1.318)                         | (0,00)               |
| (251.545)   | Western Alliance Bancorp         | Goldman Sachs International | (13.004)                        | (0,00)               |
| (248.933)   | Western Digital Corp             | Morgan Stanley              | (21.976)                        | (0,01)               |
| (74.231)    | Western Union Co                 | Morgan Stanley              | (10.679)                        | (0,00)               |
| 400         | Westlake Corp                    | Goldman Sachs International | (144)                           | (0,00)               |
| (9.000)     | Weyerhaeuser Co                  | Goldman Sachs International | (10.231)                        | (0,00)               |
| 28.416      | Whirlpool Corp                   | Morgan Stanley              | (5.969)                         | (0,00)               |
| 412.093     | Whitbread Plc                    | JPMorgan Chase Bank         | (12.949)                        | (0,00)               |
| 1.279       | Whitestone REIT                  | Goldman Sachs International | (1.305)                         | (0,00)               |
| 42.364      | Williams Cos Inc                 | Morgan Stanley              | (16.918)                        | (0,00)               |
| (90.719)    | Williams Cos Inc                 | Goldman Sachs International | (4.214)                         | (0,00)               |
| (1.116.479) | Williams Cos Inc                 | JPMorgan Chase Bank         | (8.024)                         | (0,00)               |
| 32.051      | Williams-Sonoma Inc              | JPMorgan Chase Bank         | (917)                           | (0,00)               |
| 296.449     | Williams-Sonoma Inc              | Goldman Sachs International | (121.824)                       | (0,02)               |
| 200         | Wills Towers Watson Plc          | Goldman Sachs International | (626)                           | (0,00)               |
| (88.416)    | Wingstop Inc                     | Morgan Stanley              | (25.829)                        | (0,01)               |
| (77.112)    | Wix.com Ltd                      | Goldman Sachs International | (21)                            | (0,00)               |
| 200         | Woodward Inc                     | Goldman Sachs International | (908)                           | (0,00)               |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte (1,66 %) (31. Dezember 2023: (1,26 %)) (Fortsetzung)

| Anteile  | Wertpapierbezeichnung           | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| (51.895)   | Workday Inc Class A             | Morgan Stanley              | (3.059)                         | (0,00)               |
| (41.464)   | Workday Inc Class A             | Goldman Sachs International | (2.138)                         | (0,00)               |
| (71.503)   | Workday Inc Class A             | JPMorgan Chase Bank         | (3.904)                         | (0,00)               |
| 163  | World Acceptance Corp           | Goldman Sachs International | (875)                           | (0,00)               |
| 200  | Worthington Enterprises Inc     | Goldman Sachs International | (229)                           | (0,00)               |
| (106.818)  | WP Carey Inc                    | Morgan Stanley              | (2.746)                         | (0,00)               |
| 53.834   | WR Berkley Corp                 | Morgan Stanley              | (293)                           | (0,00)               |
| (108.454)  | WW Grainger Inc                 | Morgan Stanley              | (12.626)                        | (0,00)               |
| 35.687   | Wyndham Hotels & Resorts Inc    | Morgan Stanley              | (1.036)                         | (0,00)               |
| 1.200  | Wyndham Hotels & Resorts Inc    | Goldman Sachs International | (1.405)                         | (0,00)               |
| (245.860)  | Xenon Pharmaceuticals Inc       | Goldman Sachs International | (4.627)                         | (0,00)               |
| (70.238)   | XP Inc Class A                  | Morgan Stanley              | (1.883)                         | (0,00)               |
| (632.746)  | XPO Inc                         | JPMorgan Chase Bank         | (20.781)                        | (0,01)               |
| (110.258)  | Yelp Inc                        | JPMorgan Chase Bank         | (3.416)                         | (0,00)               |
| (87.930)   | Yelp Inc                        | Goldman Sachs International | (3.557)                         | (0,00)               |
| (22.811)   | YETI Holdings Inc               | Morgan Stanley              | (1.580)                         | (0,00)               |
| 119.723  | Yum! Brands Inc                 | JPMorgan Chase Bank         | (121)                           | (0,00)               |
| (8.885)  | Zai Lab Ltd                     | Goldman Sachs International | (1.555)                         | (0,00)               |
| (338.826)  | Zalando SE                      | JPMorgan Chase Bank         | (22.918)                        | (0,01)               |
| (1.145.688)  | Zealand Pharma A/S              | JPMorgan Chase Bank         | (501)                           | (0,00)               |
| (717.861)  | Zealand Pharma A/S              | Goldman Sachs International | (2.860)                         | (0,00)               |
| 100  | Zebra Technologies Corp Class A | Goldman Sachs International | (2.068)                         | (0,00)               |
| 35.046   | Zillow Group Inc Class C        | Morgan Stanley              | (19.961)                        | (0,00)               |
| (297.460)  | Zimmer Biomet Holdings Inc      | Goldman Sachs International | (8.158)                         | (0,00)               |
| 52.074   | Zscaler Inc                     | Morgan Stanley              | (2.467)                         | (0,00)               |
| 546.832  | Zurich Insurance Group AG       | JPMorgan Chase Bank         | (11.922)                        | (0,00)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Differenzkontrakten <sup>∞</sup></b> |                                 |                             | <b>(13.402.670)</b>             | <b>(1,66)</b>        |

### Credit-Default-Swap-Kontrakte (0,01 %) (31. Dezember 2023: (0,08 %))

| Nominalwert   | Datum der Schließung | Gegenpartei                 | Referenz-obligation   | Zeitwert US\$   | % des Nettovermögens |
|---|----------------------|-----------------------------|---|-----------------|----------------------|
| 500.000 USD   | 20.06.2027           | Goldman Sachs International | Selling default protection on SK Hynix, 2.38%, 19/01/2031         | (5.538)         | (0,00)               |
| 1.040.000 USD   | 20.06.2027           | Goldman Sachs International | Selling default protection on SK Hynix, 2.38%, 19/01/2031         | (11.519)        | (0,00)               |
| 750.000.000 JPY   | 20.12.2026           | JPMorgan Chase Bank         | Selling default protection on ANA Holdings Inc, 1.22%, 06/08/2026 | (79.170)        | (0,01)               |
| <b>Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt <sup>±</sup></b> |                      |                             |   | <b>(96.227)</b> | <b>(0,01)</b>        |

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Total Return Swap-Kontrakte (0,15 %) (31. Dezember 2023: (0,20 %))

| Nominalwert   | Datum der Schließung | Variabler Zinssatz  | Referenzunternehmen                         | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|----------------------|---------------------|---|---------------------------------|----------------------|
| 105.783 USD   | 06.11.2026           | 4,76 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUSPY <sup>2</sup> | (368)                           | (0,00)               |
| (261.877) USD   | 06.11.2026           | 4,11 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUSPY <sup>2</sup> | (387)                           | (0,00)               |
| (953.837) USD   | 06.12.2049           | 3,51 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSACWLUP <sup>2</sup> | (604)                           | (0,00)               |
| (537.382) USD   | 04.05.2026           | 3,53 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSCBSMMU <sup>2</sup> | (708)                           | (0,00)               |
| (114.921) USD   | 06.11.2026           | 4,08 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUXLV <sup>2</sup> | (741)                           | (0,00)               |
| (63.492) USD  | 06.11.2026           | 4,11 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUSQQ <sup>2</sup> | (1.033)                         | (0,00)               |
| 53.215 USD  | 06.11.2026           | 4,76 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUXBI <sup>2</sup> | (1.102)                         | (0,00)               |
| 176.175 USD   | 11.02.2026           | 4,76 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUSMH <sup>2</sup> | (1.863)                         | (0,00)               |
| (24.394) USD  | 28.01.2025           | (0,80) <sup>3</sup> | Morgan Stanley Basket MSCBSMMU <sup>2</sup> | (2.679)                         | (0,00)               |
| (151.707) USD   | 11.03.2025           | (0,80) <sup>3</sup> | Morgan Stanley Basket MSCBSMMU <sup>2</sup> | (3.135)                         | (0,00)               |
| (157.028) USD   | 05.11.2026           | 4,11 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUSPY <sup>2</sup> | (3.556)                         | (0,00)               |
| (704.991) USD   | 05.03.2025           | 4,03 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUIWF <sup>2</sup> | (3.602)                         | (0,00)               |
| 253.049 USD   | 06.11.2026           | 4,76 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUIWM <sup>2</sup> | (3.779)                         | (0,00)               |
| (304.480) USD   | 07.12.2049           | 4,02 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUIGV <sup>2</sup> | (7.013)                         | (0,00)               |
| 312.603 USD   | 06.11.2026           | 4,76 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUIHI <sup>2</sup> | (7.639)                         | (0,00)               |
| (609.168) USD   | 05.03.2025           | 4,03 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUXLC <sup>2</sup> | (8.078)                         | (0,00)               |
| (230.493) USD   | 06.11.2026           | 4,08 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUXOP <sup>2</sup> | (8.806)                         | (0,00)               |
| (543.798) USD   | 02.06.2025           | (0,80) <sup>3</sup> | Morgan Stanley Basket MSCBSMMU <sup>2</sup> | (10.429)                        | (0,00)               |
| (107.049) USD   | 06.11.2026           | 4,05 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUIWM <sup>2</sup> | (10.952)                        | (0,00)               |
| (1.375.324) USD   | 05.03.2025           | 4,11 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUSPY <sup>2</sup> | (11.024)                        | (0,00)               |
| (284.206) USD   | 06.11.2026           | 4,03 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUXLY <sup>2</sup> | (16.393)                        | (0,00)               |
| (840.607) EUR   | 21.12.2049           | 2,45 <sup>4</sup>   | Morgan Stanley Basket MSABECDS <sup>2</sup> | (16.692)                        | (0,00)               |
| (197.260) USD   | 06.11.2026           | 4,02 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUXRT <sup>2</sup> | (16.924)                        | (0,00)               |
| (710.505) USD   | 02.06.2025           | (0,80) <sup>3</sup> | Morgan Stanley Basket MSCBSBTU <sup>2</sup> | (17.501)                        | (0,01)               |
| (1.079.081) USD   | 06.11.2026           | 4,11 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUSQQ <sup>2</sup> | (70.285)                        | (0,01)               |
| (272.532) USD   | 06.11.2026           | 3,99 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUSMH <sup>2</sup> | (73.475)                        | (0,01)               |
| (997.909) USD   | 06.11.2026           | 4,03 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUXLK <sup>2</sup> | (171.235)                       | (0,02)               |
| (1.252.111) USD   | 06.11.2026           | 4,11 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUSPY <sup>2</sup> | (179.390)                       | (0,03)               |
| (1.224.499) USD   | 06.11.2026           | 4,03 <sup>1</sup>   | Morgan Stanley Basket MSNBUXLC <sup>2</sup> | (234.239)                       | (0,03)               |
| 178.492 USD   | 13.03.2025           | 3,75 <sup>1</sup>   | Goldman Sachs Basket GSUCPSL8 <sup>5</sup>  | (314.175)                       | (0,04)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Total Return Swap-Kontrakten <sup>∞</sup></b> |                      |                     |   | <b>(1.197.807)</b>              | <b>(0,15)</b>        |

<sup>1</sup> Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist der 1-Tag-FEDEF.

<sup>2</sup> Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist Morgan Stanley.

<sup>3</sup> Feste Finanzierungskosten.

<sup>4</sup> Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist der 1-Monat-EURIBOR.

<sup>5</sup> Die Gegenpartei für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist Goldman Sachs International.

## Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Variance-Swap-Kontrakte (0,07 %) (31. Dezember 2023: (0,03 %))

| Vega Nominalwert   | Datum der Schließung | Gegenpartei      | Referenz-obligation                           | Variance-Ausübungssatz | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|----------------------|------------------|---|------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 100.000 USD  | 19.12.2025           | BNP Paribas      | EURO STOXX 50 Index vs S&P 500 Index          | 27,55 % / 30,70 %      | (9.873)                         | (0,00)               |
| 500.000 USD  | 19.12.2025           | BNP Paribas      | EURO STOXX 50 Index vs S&P 500 Index          | 29,03 % / 32,03 %      | (20.021)                        | (0,00)               |
| 250.000 EUR  | 20.06.2025           | BNP Paribas      | MIB Total Return Index vs EURO STOXX 50 Index | 34,0 % / 33,0 %        | (28.733)                        | (0,00)               |
| 125.000 EUR  | 19.12.2025           | Société Générale | SG 14 Names EU Basket                         | Verschiedene           | (51.775)                        | (0,01)               |
| 63.000 EUR   | 20.06.2025           | BNP Paribas      | BNP 15 Names EU Basket                        | Verschiedene           | (63.489)                        | (0,01)               |
| 100.000 GBP  | 20.06.2025           | BNP Paribas      | FTSE 100 Index Up-Variance                    | 17,00 %                | (68.304)                        | (0,01)               |
| 125.000 GBP  | 20.06.2025           | BNP Paribas      | FTSE 100 Index Up-Variance                    | 17,00 %                | (82.715)                        | (0,01)               |
| 100.000 EUR  | 20.06.2025           | Citibank NA      | CITI 20 Names EU Basket                       | Verschiedene           | (107.255)                       | (0,01)               |
| 750.000 USD  | 19.12.2025           | BNP Paribas      | MIB Total Return Index vs S&P 500 Index       | 24,60 % / 27,95 %      | (128.794)                       | (0,02)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Inflation-Swap-Kontrakten <sup>∞</sup></b> |                      |                  |   |                        | <b>(560.959)</b>                | <b>(0,07)</b>        |

### Volatility-Swap-Kontrakte (0,36 %) (31. Dezember 2023: (0,56 %))

| Nominalwert   | Datum der Schließung | Gegenpartei     | Referenzobligation <sup>1</sup> | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |               |
|---|----------------------|-----------------|---------------------------------|---------------------------------|----------------------|---------------|
| 30.000.000 USD  | 20.06.2025           | Nomura          | Nomura 20 Names Global Basket   | (6.571)                         | (0,00)               |               |
| 1.875.000 USD   | 16.01.2026           | Morgan Stanley  | NVIDIA Corp.                    | (29.784)                        | (0,00)               |               |
| 20.000.000 USD  | 20.06.2025           | BNP             | BNP 31 Names Global Basket      | (155.056)                       | (0,02)               |               |
| 23.500.000 EUR  | 17.01.2025           | BNP             | BNP 43 Names EU Basket          | (409.886)                       | (0,05)               |               |
| 20.000.000 USD  | 17.01.2025           | BofA Securities | BAML 27 Names US Basket         | (801.509)                       | (0,10)               |               |
| 30.360.000 USD  | 17.01.2025           | Morgan Stanley  | MS 16 Names US Basket           | (1.540.883)                     | (0,19)               |               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Volatility-Swap-Kontrakten <sup>∞</sup></b> |                      |                 |                                 |                                 | <b>(2.943.689)</b>   | <b>(0,36)</b> |

<sup>1</sup> Die Volatilitäten lauten auf verschiedene Fremdwährungen, je nach den Landeswährungen der Positionen in den Swaps.

|   | Zeitwert US\$        | % des Nettovermögens |
|---|----------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(147.432.620)</b> | <b>(18,26)</b>       |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>425.414.871</b>   | <b>52,74</b>         |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>381.426.554</b>   | <b>47,26</b>         |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>806.841.425</b>   | <b>100,00</b>        |

| Portfolioanalyse  | US\$               | % des Gesamtvermögens |
|---|--------------------|-----------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 37.707.645         | 3,80                  |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden            | 361.758.359        | 36,45                 |
| ± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden                          | 32.441.304         | 3,27                  |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap                            | (6.492.437)        | (0,65)                |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>425.414.871</b> | <b>42,87</b>          |

## US Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der<br>Anteile                              | Wertpapierbezeichnung                   | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---|------------------|------------------------------|
| <b>Aktien 99,22 % (31. Dezember 2023: 93,23 %)</b> |   |                  |                              |
| <b>US-Dollar</b>                                   |   |                  |                              |
| 9.729  | AbbVie Inc                              | 1.728.843        | 1,61                         |
| 6.767  | Advanced Micro Devices Inc              | 817.386          | 0,76                         |
| 26.554   | Alphabet Inc Class A                    | 5.026.672        | 4,70                         |
| 44.419   | Amazon.com Inc                          | 9.745.084        | 9,10                         |
| 13.972   | Amphenol Corp Class A                   | 970.355          | 0,91                         |
| 5.362  | Analog Devices Inc                      | 1.139.211        | 1,06                         |
| 26.254   | Apple Inc                               | 6.574.527        | 6,14                         |
| 539  | ASML Holding NV                         | 373.570          | 0,35                         |
| 4.272  | Avery Dennison Corp                     | 799.419          | 0,75                         |
| 22.072   | Boston Scientific Corp                  | 1.971.471        | 1,84                         |
| 22.527   | Broadcom Inc                            | 5.222.660        | 4,88                         |
| 21.207   | Brookfield Asset Management Ltd Class A | 1.149.207        | 1,07                         |
| 5.114  | CDW Corp                                | 890.041          | 0,83                         |
| 20.582   | CenterPoint Energy Inc                  | 653.067          | 0,61                         |
| 19.459   | Chewy Inc Class A                       | 651.682          | 0,61                         |
| 7.812  | Chipotle Mexican Grill Inc Class A      | 471.064          | 0,44                         |
| 1.160  | CME Group Inc Class A                   | 269.387          | 0,25                         |
| 1.654  | Constellation Energy Corp               | 370.016          | 0,35                         |
| 1.541  | Costco Wholesale Corp                   | 1.411.972        | 1,32                         |
| 1.704  | Eli Lilly & Co                          | 1.315.488        | 1,23                         |
| 4.037  | Equifax Inc                             | 1.028.829        | 0,96                         |
| 6.524  | General Electric Co                     | 1.088.138        | 1,02                         |
| 3.656  | Home Depot Inc                          | 1.422.147        | 1,33                         |
| 662  | HubSpot Inc                             | 461.262          | 0,43                         |
| 3.519  | Intuit Inc                              | 2.211.692        | 2,07                         |
| 7.410  | KKR & Co Inc                            | 1.096.013        | 1,02                         |
| 4.346  | Mastercard Inc Class A                  | 2.288.473        | 2,14                         |
| 29.902   | Match Group Inc                         | 978.094          | 0,91                         |
| 5.592  | McDonald's Corp                         | 1.621.065        | 1,51                         |
| 11.302   | Meta Platforms Inc Class A              | 6.617.434        | 6,18                         |
| 21.348   | Microsoft Corp                          | 8.998.182        | 8,40                         |
| 3.537  | Netflix Inc                             | 3.152.599        | 2,94                         |
| 9.404  | NextEra Energy Inc                      | 674.173          | 0,63                         |
| 19.584   | NIKE Inc Class B                        | 1.481.921        | 1,38                         |
| 3.268  | Novo Nordisk A/S ADR                    | 281.113          | 0,26                         |
| 10.816   | nVent Electric Plc                      | 737.219          | 0,69                         |
| 60.894   | NVIDIA Corp                             | 8.177.455        | 7,64                         |
| 9.396  | Okta Inc Class A                        | 740.405          | 0,69                         |

## US Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile   | Wertpapierbezeichnung        | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens |
|--|------------------------------|--------------------|----------------------|
| <b>Aktien 99,22 % (31. Dezember 2023: 93,23 %) (Fortsetzung)</b> |                              |                    |                      |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>                                   |                              |                    |                      |
| 992  | Rockwell Automation Inc      | 283.504            | 0,27                 |
| 3.333  | S&P Global Inc               | 1.659.934          | 1,55                 |
| 8.474  | Salesforce Inc               | 2.833.112          | 2,65                 |
| 2.023  | ServiceNow Inc               | 2.144.623          | 2,00                 |
| 9.325  | Sweetgreen Inc Class A       | 298.960            | 0,28                 |
| 3.850  | Synopsis Inc                 | 1.868.636          | 1,75                 |
| 3.028  | Thermo Fisher Scientific Inc | 1.575.256          | 1,47                 |
| 18.211   | TJX Cos Inc                  | 2.200.071          | 2,06                 |
| 12.152   | Uber Technologies Inc        | 733.009            | 0,68                 |
| 4.012  | Union Pacific Corp           | 914.897            | 0,85                 |
| 9.980  | Visa Inc Class A             | 3.154.079          | 2,95                 |
| 17.224   | Walmart Inc                  | 1.556.188          | 1,45                 |
| 2.898  | Waste Management Inc         | 584.787            | 0,55                 |
| 7.051  | Workday Inc Class A          | 1.819.370          | 1,70                 |
| <b>Aktien insgesamt *</b>  |                              | <b>106.233.762</b> | <b>99,22</b>         |
| <b>Anlagen insgesamt</b>   |                              | <b>106.233.762</b> | <b>99,22</b>         |

### Devisenterminkontrakte 0,46 % (31. Dezember 2023: 2,55 %)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 277 US\$   | 262 €               | 16.01.2025       | Citibank NA                 | 1         | 6                              | 0,00                 |
| 422.158 US\$   | 406.011 €           | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 6         | 1.509                          | 0,00                 |
| 66.863 US\$  | 63.521 €            | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 5         | 1.053                          | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen JPY</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 947.746 US\$   | 142.089.517 ¥       | 16.01.2025       | Citibank NA                 | 6         | 42.214                         | 0,04                 |
| 326.605 US\$   | 47.249.397 ¥        | 16.01.2025       | UBS AG                      | 2         | 25.487                         | 0,03                 |
| 18.019.668 US\$  | 2.761.504.620 ¥     | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 3         | 420.691                        | 0,39                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>oo</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>490.960</b>                 | <b>0,46</b>          |

|  | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens |
|--|--------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> | <b>106.724.722</b> | <b>99,68</b>         |

## US Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (1,48 %) (31. Dezember 2023: (0,24 %))

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 30.979 €   | 34.437 US\$         | 16.01.2025       | Citibank NA                 | 7         | (2.340)                         | (0,00)               |
| 1.024 €  | 1.096 US\$          | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 3         | (35)                            | (0,00)               |
| 10.556.975 €   | 11.141.786 US\$     | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 13        | (204.227)                       | (0,19)               |
| 146.102 US\$   | 141.078 €           | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | (62)                            | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen JPY</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 71.654.486 ¥   | 474.133 US\$        | 16.01.2025       | Citibank NA                 | 3         | (17.481)                        | (0,02)               |
| 123.512.654 ¥  | 824.050 US\$        | 16.01.2025       | Royal Bank of Canada        | 6         | (36.908)                        | (0,03)               |
| 54.221.936 ¥   | 358.349 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                      | 3         | (12.794)                        | (0,01)               |
| 3.110.848.198 ¥  | 21.140.322 US\$     | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 6         | (1.314.990)                     | (1,23)               |
| 34.166 US\$  | 5.370.719 ¥         | 16.01.2025       | Royal Bank of Canada        | 1         | (61)                            | (0,00)               |
| 43.107 US\$  | 6.774.416 ¥         | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | (66)                            | (0,00)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>(1.588.964)</b>              | <b>(1,48)</b>        |

|   | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens |
|---|--------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(1.588.964)</b> | <b>(1,48)</b>        |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>105.135.758</b> | <b>98,20</b>         |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>1.931.277</b>   | <b>1,80</b>          |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>107.067.035</b> | <b>100,00</b>        |

| Portfolioanalyse  | US\$               | % des Gesamtvermögens |
|---|--------------------|-----------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 106.233.762        | 97,30                 |
| <sup>∞</sup> OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente  | (1.098.004)        | (1,01)                |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>105.135.758</b> | <b>96,29</b>          |

## US Equity Premium - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Kapital-<br>betrag   | Wertpapierbezeichnung            | Kupon  | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|----------------------------------|--------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Staatsanleihen 96,21 % (31. Dezember 2023: 90,98 %)</b> |                                  |        |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |                                  |        |                       |                    |                              |
| 97.500.000   | United States Treasury Note/Bond | 4,00 % | 15.12.2025            | 97.343.987         | 14,77                        |
| 96.900.000   | United States Treasury Note/Bond | 4,13 % | 15.06.2026            | 96.748.655         | 14,68                        |
| 108.300.000  | United States Treasury Note/Bond | 4,25 % | 31.05.2025            | 108.283.514        | 16,43                        |
| 87.200.000   | United States Treasury Note/Bond | 4,25 % | 31.01.2026            | 87.215.305         | 13,23                        |
| 102.200.000  | United States Treasury Note/Bond | 4,63 % | 15.03.2026            | 102.657.681        | 15,58                        |
| 26.900.000   | United States Treasury Note/Bond | 4,63 % | 15.09.2026            | 27.064.424         | 4,11                         |
| 114.200.000  | United States Treasury Note/Bond | 5,00 % | 31.08.2025            | 114.758.755        | 17,41                        |
| <b>Staatsanleihen insgesamt *</b>                          |                                  |        |                       | <b>634.072.321</b> | <b>96,21</b>                 |
| <b>Anlagen insgesamt</b>                                   |                                  |        |                       | <b>634.072.321</b> | <b>96,21</b>                 |

Devisenterminkontrakte 0,08 % (31. Dezember 2023: 1,67 %)

| Geforderter<br>Betrag  | Zu zahlender<br>Betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht<br>realisierter<br>Gewinn US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens          |
|--|------------------------|-----------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------------|---------------------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                        |                       |                             |           |                                      |                                       |
| 388.403 US\$   | 365.809 €              | 16.01.2025            | Goldman Sachs International | 4         | 9.406                                | 0,00                                  |
| 763.516 US\$   | 712.032 €              | 16.01.2025            | Westpac Banking Corp        | 47        | 25.815                               | 0,00                                  |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>  |                        |                       |                             |           |                                      |                                       |
| 53.157 £   | 66.528 US\$            | 16.01.2025            | Westpac Banking Corp        | 2         | 38                                   | 0,00                                  |
| 4.406.669 US\$   | 3.384.282 £            | 16.01.2025            | Goldman Sachs International | 3         | 168.678                              | 0,03                                  |
| 10.455.496 US\$  | 8.085.458 £            | 16.01.2025            | Westpac Banking Corp        | 65        | 330.419                              | 0,05                                  |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>  |                        |                       |                             |           |                                      |                                       |
| 69.585 US\$  | 91.109 SGD             | 16.01.2025            | Goldman Sachs International | 2         | 2.761                                | 0,00                                  |
| 225.233 US\$   | 301.533 SGD            | 16.01.2025            | Westpac Banking Corp        | 24        | 4.074                                | 0,00                                  |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>                        |                        |                       |                             |           | <b>541.191</b>                       | <b>0,08</b>                           |
|  |                        |                       |                             |           | <b>Zeitwert<br/>US\$</b>             | <b>% des<br/>Nettover-<br/>mögens</b> |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |                        |                       |                             |           | <b>634.613.512</b>                   | <b>96,29</b>                          |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (1,34 %) (31. Dezember 2023: (0,07 %))

| Geforderter<br>Betrag           | Zu zahlender<br>Betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht<br>realisierter<br>Verlust US\$ | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|---------------------------------|------------------------|-----------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------------|------------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i> |                        |                       |                             |           |                                       |                              |
| 78.712 €                        | 84.723 US\$            | 16.01.2025            | Citibank NA                 | 1         | (3.174)                               | (0,00)                       |
| 313.317 €                       | 341.072 US\$           | 16.01.2025            | Goldman Sachs International | 4         | (16.460)                              | (0,00)                       |
| 9.163.335 €                     | 10.084.693 US\$        | 16.01.2025            | Westpac Banking Corp        | 26        | (591.017)                             | (0,09)                       |
| 1.234 US\$                      | 1.192 €                | 16.01.2025            | Westpac Banking Corp        | 1         | (0)                                   | (0,00)                       |

## US Equity Premium - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte (1,34 %) (31. Dezember 2023: (0,07 %)) (Fortsetzung)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 2.421.819 €  | 3.105.197 US\$      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 2         | (72.457)                        | (0,01)               |
| 139.494.550 €  | 182.559.536 US\$    | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 51        | (7.876.485)                     | (1,20)               |
| 3.499.304 US\$   | 2.796.333 €         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (2.424)                         | (0,00)               |
| 295 US\$   | 236 €               | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | (0)                             | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 41.572 SGD   | 32.007 US\$         | 16.01.2025       | Citibank NA                 | 1         | (1.516)                         | (0,00)               |
| 309.013 SGD  | 231.957 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 5         | (5.313)                         | (0,00)               |
| 7.747.980 SGD  | 5.937.897 US\$      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 54        | (255.188)                       | (0,04)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>(8.824.034)</b>              | <b>(1,34)</b>        |

### Verkaufte Optionskontrakte (1,99 %) (31. Dezember 2023: (0,72 %))

| Anzahl Kontrakte   | Fälligkeit | Art   | Zeitwert US\$       | % des Nettovermögens |
|--|------------|---|---------------------|----------------------|
| <b>Verkaufsoptionen</b>  |            |   |                     |                      |
| (141)  | 10.01.2025 | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$5,890.00 | (729.675)           | (0,11)               |
| (52)   | 31.01.2025 | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$5,890.00 | (451.880)           | (0,07)               |
| (2)  | 24.01.2025 | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$5,955.00 | (20.870)            | (0,00)               |
| (101)  | 31.01.2025 | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$5,955.00 | (1.154.935)         | (0,17)               |
| (8)  | 24.01.2025 | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$5,980.00 | (94.480)            | (0,02)               |
| (80)   | 03.01.2025 | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$5,985.00 | (786.400)           | (0,12)               |
| (272)  | 24.01.2025 | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$5,985.00 | (3.291.200)         | (0,50)               |
| (2)  | 24.01.2025 | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$5,990.00 | (24.800)            | (0,00)               |
| (1)  | 24.01.2025 | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$6,055.00 | (16.920)            | (0,00)               |
| (50)   | 03.01.2025 | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$6,065.00 | (879.500)           | (0,13)               |
| (125)  | 10.01.2025 | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$6,070.00 | (2.266.250)         | (0,34)               |
| (15)   | 10.01.2025 | CBOE S&P 500 Index, Strike Price \$6,100.00 | (314.850)           | (0,05)               |
| (1)  | 17.01.2025 | S&P 500 Index, Strike Price \$5,890.00      | (6.395)             | (0,00)               |
| (76)   | 17.01.2025 | S&P 500 Index, Strike Price \$5,930.00      | (621.300)           | (0,10)               |
| (202)  | 17.01.2025 | S&P 500 Index, Strike Price \$5,990.00      | (2.360.370)         | (0,36)               |
| (2)  | 17.01.2025 | S&P 500 Index, Strike Price \$6,060.00      | (34.400)            | (0,01)               |
| (5)  | 17.01.2025 | S&P 500 Index, Strike Price \$6,070.00      | (90.275)            | (0,01)               |
| (1)  | 17.01.2025 | S&P 500 Index, Strike Price \$6,100.00      | (20.720)            | (0,00)               |
| <b>Beizulegender Zeitwert aus verkauften Optionskontrakten insgesamt <sup>*</sup> (Prämie: 8.603.788 US\$)</b> |            |   | <b>(13.165.220)</b> | <b>(1,99)</b>        |

## US Equity Premium - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

|   | Zeitwert<br>US\$    | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|---|---------------------|------------------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(21.989.254)</b> | <b>(3,33)</b>                |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>612.624.258</b>  | <b>92,96</b>                 |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>46.419.736</b>   | <b>7,04</b>                  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>659.043.994</b>  | <b>100,00</b>                |

| <b>Portfolioanalyse</b>   | US\$               | % des<br>Gesamtver-<br>mögens |
|---|--------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 634.072.321        | 92,34                         |
| ± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden                          | (13.165.220)       | (1,92)                        |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente   | (8.282.843)        | (1,21)                        |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>612.624.258</b> | <b>89,21</b>                  |

## US Large Cap Value - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der<br>Anteile                              | Wertpapierbezeichnung            | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|----------------------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Aktien 94,04 % (31. Dezember 2023: 95,28 %)</b> |                                  |                  |                              |
| <b>US-Dollar</b>                                   |                                  |                  |                              |
| 108.299  | 3M Co                            | 13.980.318       | 1,37                         |
| 76.786   | Accenture Plc Class A            | 27.012.547       | 2,65                         |
| 144.957  | Agnico Eagle Mines Ltd           | 11.337.087       | 1,11                         |
| 178.129  | American International Group Inc | 12.967.791       | 1,27                         |
| 65.923   | Amphenol Corp Class A            | 4.578.352        | 0,45                         |
| 19.030   | Analog Devices Inc               | 4.043.114        | 0,40                         |
| 9.729  | ANSYS Inc                        | 3.281.884        | 0,32                         |
| 21.804   | Aon Plc Class A                  | 7.831.125        | 0,77                         |
| 17.783   | Avery Dennison Corp              | 3.327.733        | 0,33                         |
| 248.679  | Baker Hughes Co Class A          | 10.200.813       | 1,00                         |
| 465.143  | Bank of America Corp             | 20.443.035       | 2,01                         |
| 40.525   | Berkshire Hathaway Inc Class B   | 18.369.172       | 1,80                         |
| 5.099  | Blackrock Inc                    | 5.227.036        | 0,51                         |
| 45.915   | Block Inc Class A                | 3.902.316        | 0,38                         |
| 132.850  | Bristol-Myers Squibb Co          | 7.513.996        | 0,74                         |
| 114.348  | Capital One Financial Corp       | 20.390.535       | 2,00                         |
| 445.192  | Carnival Corp                    | 11.094.185       | 1,09                         |
| 51.058   | Caterpillar Inc                  | 18.521.800       | 1,82                         |
| 135.500  | Charles Schwab Corp              | 10.028.355       | 0,98                         |
| 112.357  | Chevron Corp                     | 16.273.788       | 1,60                         |
| 87.537   | Cisco Systems Inc                | 5.182.190        | 0,51                         |
| 73.446   | CME Group Inc Class A            | 17.056.365       | 1,68                         |
| 175.360  | Colgate-Palmolive Co             | 15.941.978       | 1,57                         |
| 122.425  | CSX Corp                         | 3.950.655        | 0,39                         |
| 51.561   | Cummins Inc                      | 17.974.165       | 1,77                         |
| 86.234   | Danaher Corp                     | 19.795.015       | 1,94                         |
| 30.382   | Discover Financial Services      | 5.263.074        | 0,52                         |
| 76.067   | DTE Energy Co                    | 9.185.090        | 0,90                         |
| 231.382  | Duke Energy Corp                 | 24.929.097       | 2,45                         |
| 85.367   | EOG Resources Inc                | 10.464.287       | 1,03                         |
| 435.565  | Exxon Mobil Corp                 | 46.853.727       | 4,60                         |
| 212.704  | FirstEnergy Corp                 | 8.461.365        | 0,83                         |
| 341.282  | Freeport-McMoRan Inc             | 12.996.018       | 1,28                         |
| 107.049  | General Mills Inc                | 6.826.515        | 0,67                         |
| 12.763   | Home Depot Inc                   | 4.964.679        | 0,49                         |
| 19.694   | Illinois Tool Works Inc          | 4.993.611        | 0,49                         |
| 52.119   | Ingersoll Rand Inc               | 4.714.685        | 0,46                         |

## US Large Cap Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile   | Wertpapierbezeichnung                | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens |
|--|--------------------------------------|--------------------|----------------------|
| <b>Aktien 94,04 % (31. Dezember 2023: 95,28 %) (Fortsetzung)</b> |                                      |                    |                      |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>                                   |                                      |                    |                      |
| 74.304   | International Business Machines Corp | 16.334.248         | 1,60                 |
| 266.572  | Johnson & Johnson                    | 38.551.643         | 3,79                 |
| 127.636  | Johnson Controls International Plc   | 10.074.309         | 0,99                 |
| 115.960  | JPMorgan Chase & Co                  | 27.796.772         | 2,73                 |
| 333.930  | Kroger Co                            | 20.419.819         | 2,01                 |
| 443.556  | Las Vegas Sands Corp                 | 22.781.036         | 2,24                 |
| 24.928   | Lockheed Martin Corp                 | 12.113.512         | 1,19                 |
| 320.757  | Medtronic Plc                        | 25.622.069         | 2,52                 |
| 84.625   | Morgan Stanley                       | 10.639.055         | 1,04                 |
| 140.788  | Newmont Corp                         | 5.240.129          | 0,51                 |
| 214.459  | NextEra Energy Inc                   | 15.374.566         | 1,51                 |
| 535  | NIKE Inc Class B                     | 40.483             | 0,00                 |
| 67.885   | Norfolk Southern Corp                | 15.932.609         | 1,56                 |
| 46.967   | PACCAR Inc                           | 4.885.507          | 0,48                 |
| 23.194   | Paychex Inc                          | 3.252.263          | 0,32                 |
| 103.025  | PayPal Holdings Inc                  | 8.793.184          | 0,86                 |
| 231.105  | Pfizer Inc                           | 6.131.216          | 0,60                 |
| 118.734  | Philip Morris International Inc      | 14.289.637         | 1,40                 |
| 138.641  | PNC Financial Services Group Inc     | 26.736.917         | 2,63                 |
| 28.130   | Procter & Gamble Co                  | 4.715.994          | 0,46                 |
| 81.171   | Public Service Enterprise Group Inc  | 6.858.138          | 0,67                 |
| 32.147   | Rockwell Automation Inc              | 9.187.291          | 0,90                 |
| 30.364   | S&P Global Inc                       | 15.122.183         | 1,49                 |
| 45.905   | Salesforce Inc                       | 15.347.419         | 1,51                 |
| 194.402  | Sempra                               | 17.052.943         | 1,67                 |
| 139.193  | Southern Copper Corp                 | 12.684.658         | 1,25                 |
| 28.051   | Stryker Corp                         | 10.099.762         | 0,99                 |
| 37.670   | Take-Two Interactive Software Inc    | 6.934.294          | 0,68                 |
| 20.341   | Texas Instruments Inc                | 3.814.141          | 0,37                 |
| 26.022   | T-Mobile US Inc                      | 5.743.836          | 0,56                 |
| 285.869  | Truist Financial Corp                | 12.400.997         | 1,22                 |
| 22.574   | United Airlines Holdings Inc         | 2.191.935          | 0,22                 |
| 54.941   | UnitedHealth Group Inc               | 27.792.454         | 2,73                 |
| 258.643  | Verizon Communications Inc           | 10.343.134         | 1,02                 |
| 285.414  | Walmart Inc                          | 25.787.155         | 2,53                 |
| 288.283  | Wells Fargo & Co                     | 20.248.998         | 1,99                 |
| 293.610  | Wheaton Precious Metals Corp         | 16.512.626         | 1,62                 |
| <b>Aktien insgesamt *</b>  |                                      | <b>957.724.430</b> | <b>94,04</b>         |

## US Large Cap Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile   | Wertpapierbezeichnung    | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens |
|--|--------------------------|--------------------|----------------------|
| <b>Immobilienaktiengesellschaften 3,87 % (31. Dezember 2023: 0,20 %)</b> |                          |                    |                      |
| <b>US-Dollar</b>   |                          |                    |                      |
| 87.581   | Equity Residential       | 6.284.812          | 0,61                 |
| 73.470   | Public Storage           | 21.999.857         | 2,16                 |
| 64.891   | Simon Property Group Inc | 11.174.879         | 1,10                 |
| <b>Immobilienaktiengesellschaften insgesamt *</b>                        |                          | <b>39.459.548</b>  | <b>3,87</b>          |
| <b>Anlagen insgesamt</b>   |                          | <b>997.183.978</b> | <b>97,91</b>         |

Devisenterminkontrakte 0,02 % (31. Dezember 2023: 0,06 %)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei             | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens        |
|--|---------------------|------------------|-------------------------|-----------|--------------------------------|-----------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                     |                  |                         |           |                                |                             |
| 461.727 US\$   | 425.894 €           | 16.01.2025       | Citibank NA             | 2         | 20.479                         | 0,00                        |
| 1.967.814 US\$   | 1.853.795 €         | 16.01.2025       | Standard Chartered Bank | 6         | 47.189                         | 0,01                        |
| 11.117.432 US\$  | 10.645.321 €        | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp    | 77        | 88.343                         | 0,01                        |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>  |                     |                  |                         |           |                                |                             |
| 5.192 US\$   | 4.011 £             | 16.01.2025       | Citibank NA             | 1         | 169                            | 0,00                        |
| 11.194 US\$  | 8.726 £             | 16.01.2025       | Standard Chartered Bank | 3         | 267                            | 0,00                        |
| 176.965 US\$   | 136.080 £           | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp    | 14        | 6.558                          | 0,00                        |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>                        |                     |                  |                         |           | <b>163.005</b>                 | <b>0,02</b>                 |
|  |                     |                  |                         |           | <b>Zeitwert US\$</b>           | <b>% des Nettovermögens</b> |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |                     |                  |                         |           | <b>997.346.983</b>             | <b>97,93</b>                |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,18 %) (31. Dezember 2023: (0,01 %))

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei             | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                     |                  |                         |           |                                 |                      |
| 499.992 €  | 548.924 US\$        | 16.01.2025       | Citibank NA             | 2         | (30.907)                        | (0,00)               |
| 26.414.000 €   | 29.110.790 US\$     | 16.01.2025       | Standard Chartered Bank | 3         | (1.744.555)                     | (0,17)               |
| 1.455.241 €  | 1.555.358 US\$      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp    | 43        | (47.655)                        | (0,01)               |
| 138.747 US\$   | 134.015 €           | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp    | 1         | (99)                            | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>  |                     |                  |                         |           |                                 |                      |
| 19.056 £   | 24.696 US\$         | 16.01.2025       | Citibank NA             | 4         | (834)                           | (0,00)               |
| 8.226 £  | 10.420 US\$         | 16.01.2025       | Standard Chartered Bank | 2         | (119)                           | (0,00)               |
| 561.281 £  | 734.692 US\$        | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp    | 8         | (31.822)                        | (0,00)               |
| 20.820 US\$  | 16.637 £            | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp    | 2         | (14)                            | (0,00)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                         |           | <b>(1.856.005)</b>              | <b>(0,18)</b>        |

## US Large Cap Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

|   | Zeitwert<br>US\$     | % des<br>Nettover-<br>mögens  |
|---|----------------------|-------------------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(1.856.005)</b>   | <b>(0,18)</b>                 |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>995.490.978</b>   | <b>97,75</b>                  |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>22.939.203</b>    | <b>2,25</b>                   |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>1.018.430.181</b> | <b>100,00</b>                 |
| <b>Portfolioanalyse</b>   |                      |                               |
|   | US\$                 | % des<br>Gesamtver-<br>mögens |
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind   | 997.183.978          | 97,25                         |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente   | (1.693.000)          | (0,17)                        |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>995.490.978</b>   | <b>97,08</b>                  |

## US Long Short Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der<br>Anteile                              | Wertpapierbezeichnung                    | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|------------------|------------------------------|
| <b>Aktien 84,91 % (31. Dezember 2023: 85,22 %)</b> |  |                  |                              |
| <b>Euro</b>  |  |                  |                              |
| 11.569   | Airbus SE*                               | 1.854.218        | 0,82                         |
| <b>Euro insgesamt</b>                              |  | <b>1.854.218</b> | <b>0,82</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>                                   |  |                  |                              |
| 6.353  | Abbott Laboratories*                     | 718.588          | 0,32                         |
| 8.763  | AbbVie Inc*                              | 1.557.185        | 0,69                         |
| 5.231  | Advanced Micro Devices Inc*              | 631.852          | 0,28                         |
| 14.995   | Alliant Energy Corp*                     | 886.804          | 0,39                         |
| 37.879   | Alphabet Inc Class A*                    | 7.170.495        | 3,17                         |
| 43.922   | Amazon.com Inc*                          | 9.636.048        | 4,25                         |
| 29.937   | Amphenol Corp Class A*                   | 2.079.125        | 0,92                         |
| 8.462  | Analog Devices Inc*                      | 1.797.837        | 0,79                         |
| 32.342   | Apple Inc*                               | 8.099.084        | 3,58                         |
| 6.745  | Asbury Automotive Group Inc*             | 1.639.237        | 0,72                         |
| 1.915  | ASML Holding NV*                         | 1.327.248        | 0,59                         |
| 10.442   | Avery Dennison Corp*                     | 1.954.011        | 0,86                         |
| 58.872   | BGC Group Inc Class A*                   | 533.380          | 0,24                         |
| 35.072   | Boston Scientific Corp*                  | 3.132.631        | 1,38                         |
| 6.873  | Bread Financial Holdings Inc*            | 419.665          | 0,18                         |
| 14.687   | Broadcom Inc*                            | 3.405.034        | 1,50                         |
| 27.793   | Brookfield Asset Management Ltd Class A* | 1.506.103        | 0,66                         |
| 17.955   | Brookfield Corp*                         | 1.031.515        | 0,46                         |
| 1.006  | Burlington Stores Inc*                   | 286.770          | 0,13                         |
| 8.459  | CDW Corp*                                | 1.472.204        | 0,65                         |
| 102.578  | Celebration Bidco Holdings LLC**         | 1.538.670        | 0,68                         |
| 125.949  | CenterPoint Energy Inc*                  | 3.996.362        | 1,76                         |
| 25.385   | Chevron Corp*                            | 3.676.763        | 1,62                         |
| 35.644   | Chewy Inc Class A*                       | 1.193.718        | 0,53                         |
| 12.195   | Chipotle Mexican Grill Inc Class A*      | 735.358          | 0,32                         |
| 10.164   | CME Group Inc Class A*                   | 2.360.386        | 1,04                         |
| 9.615  | Comerica Inc*                            | 594.688          | 0,26                         |
| 2.298  | Constellation Energy Corp*               | 514.086          | 0,23                         |
| 777  | Costco Wholesale Corp*                   | 711.942          | 0,31                         |
| 1.053  | Eli Lilly & Co*                          | 812.916          | 0,36                         |
| 8.134  | Equifax Inc*                             | 2.072.950        | 0,91                         |
| 18.343   | First Watch Restaurant Group Inc*        | 341.363          | 0,15                         |
| 61.709   | FirstEnergy Corp*                        | 2.454.784        | 1,08                         |
| 7.301  | General Electric Co*                     | 1.217.734        | 0,54                         |

## US Long Short Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile   | Wertpapierbezeichnung               | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|-------------------------------------|---------------|----------------------|
| <b>Aktien 84,91 % (31. Dezember 2023: 85,22 %) (Fortsetzung)</b> |                                     |               |                      |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>                                   |                                     |               |                      |
| 6.566  | Home Depot Inc*                     | 2.554.108     | 1,13                 |
| 1.612  | HubSpot Inc*                        | 1.123.193     | 0,50                 |
| 2.956  | Humana Inc*                         | 749.967       | 0,33                 |
| 3.778  | Illumina Inc*                       | 504.854       | 0,22                 |
| 104.263  | indie Semiconductor Inc Class A*    | 422.265       | 0,19                 |
| 3.580  | Intuit Inc*                         | 2.250.030     | 0,99                 |
| 14.001   | Jacobs Solutions Inc*               | 1.870.814     | 0,83                 |
| 9.269  | Johnson & Johnson*                  | 1.340.483     | 0,59                 |
| 17.457   | JPMorgan Chase & Co*                | 4.184.617     | 1,85                 |
| 76.301   | Keurig Dr Pepper Inc*               | 2.450.788     | 1,08                 |
| 8.696  | KKR & Co Inc*                       | 1.286.225     | 0,57                 |
| 7.668  | Mastercard Inc Class A*             | 4.037.739     | 1,78                 |
| 97.941   | Match Group Inc*                    | 3.203.650     | 1,41                 |
| 16.605   | McDonald's Corp*                    | 4.813.623     | 2,12                 |
| 12.000   | Meta Platforms Inc Class A*         | 7.026.120     | 3,10                 |
| 24.543   | Microsoft Corp*                     | 10.344.874    | 4,57                 |
| 17.846   | Mondelez International Inc Class A* | 1.065.942     | 0,47                 |
| 1.151  | MSCI Inc Class A*                   | 690.612       | 0,30                 |
| 4.039  | Netflix Inc*                        | 3.600.041     | 1,59                 |
| 45.255   | NextEra Energy Inc*                 | 3.244.331     | 1,43                 |
| 25.118   | NIKE Inc Class B*                   | 1.900.679     | 0,84                 |
| 4.431  | Norfolk Southern Corp*              | 1.039.956     | 0,46                 |
| 2.335  | Novo Nordisk A/S ADR*               | 200.857       | 0,09                 |
| 29.193   | nVent Electric Plc*                 | 1.989.795     | 0,88                 |
| 49.019   | NVIDIA Corp*                        | 6.582.762     | 2,91                 |
| 14.622   | Okta Inc Class A*                   | 1.152.214     | 0,51                 |
| 3.575  | Onestream Inc Class A*              | 101.959       | 0,04                 |
| 76.383   | Paramount Global Class B*           | 798.966       | 0,35                 |
| 83.980   | Paycor HCM Inc*                     | 1.559.509     | 0,69                 |
| 15.553   | Philip Morris International Inc*    | 1.871.804     | 0,83                 |
| 5.174  | PNC Financial Services Group Inc*   | 997.806       | 0,44                 |
| 6.581  | Procter & Gamble Co*                | 1.103.305     | 0,49                 |
| 57.974   | Repay Holdings Corp Class A*        | 442.342       | 0,20                 |
| 1.018  | Rockwell Automation Inc*            | 290.934       | 0,13                 |
| 6.354  | S&P Global Inc*                     | 3.164.483     | 1,40                 |
| 12.710   | Salesforce Inc*                     | 4.249.334     | 1,88                 |
| 2.719  | ServiceNow Inc*                     | 2.882.466     | 1,27                 |
| 12.783   | Standardaero Inc*                   | 316.507       | 0,14                 |
| -  | -                                   | -             | -                    |
| -  | -                                   | -             | -                    |
| -  | -                                   | -             | -                    |

## US Long Short Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile  | Wertpapierbezeichnung                                   |         |                       | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|---|---|---------|-----------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Aktien 84,91 % (31. Dezember 2023: 85,22 %) (Fortsetzung)</b>                |   |         |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>  |   |         |                       |                    |                              |
| 14.489  | Sweetgreen Inc Class A*                                 |         |                       | 464.517            | 0,20                         |
| 4.538   | Synopsis Inc*   |         |                       | 2.202.564          | 0,97                         |
| 6.455   | TE Connectivity Plc*                                    |         |                       | 922.871            | 0,41                         |
| 3.689   | Thermo Fisher Scientific Inc*                           |         |                       | 1.919.128          | 0,85                         |
| 31.887  | TJX Cos Inc*  |         |                       | 3.852.268          | 1,70                         |
| 21.321  | Uber Technologies Inc*                                  |         |                       | 1.286.083          | 0,57                         |
| 14.278  | Union Pacific Corp*                                     |         |                       | 3.255.955          | 1,44                         |
| 1.779   | UnitedHealth Group Inc*                                 |         |                       | 899.925            | 0,40                         |
| 12.390  | Visa Inc Class A*                                       |         |                       | 3.915.736          | 1,73                         |
| 27.052  | Walmart Inc*  |         |                       | 2.444.148          | 1,08                         |
| 10.103  | Waste Management Inc*                                   |         |                       | 2.038.684          | 0,90                         |
| 75.725  | Waystar Holding Corp*                                   |         |                       | 2.779.107          | 1,23                         |
| 29.968  | Wells Fargo & Co*                                       |         |                       | 2.104.952          | 0,93                         |
| 10.569  | Workday Inc Class A*                                    |         |                       | 2.727.119          | 1,20                         |
| 5.658   | XPO Inc*  |         |                       | 742.047            | 0,33                         |
|   | <b>US-Dollar insgesamt</b>                              |         |                       | <b>190.471.594</b> | <b>84,09</b>                 |
|   | <b>Aktien insgesamt</b>                                 |         |                       | <b>192.325.812</b> | <b>84,91</b>                 |
| <b>Immobilienaktiengesellschaften 1,31 % (31. Dezember 2023: 1,81 %)</b>        |   |         |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar</b>  |   |         |                       |                    |                              |
| 2.279   | Equinix Inc   |         |                       | 2.148.847          | 0,95                         |
| 4.039   | SBA Communications Corp Class A                         |         |                       | 823.148            | 0,36                         |
|   | <b>Immobilienaktiengesellschaften insgesamt *</b>       |         |                       | <b>2.971.995</b>   | <b>1,31</b>                  |
| Kapital-<br>betrag  | Wertpapierbezeichnung                                   | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
| <b>Unternehmensanleihen 0,00 % (31. Dezember 2023: 3,92 %)</b>                  |   |         |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar</b>  |   |         |                       |                    |                              |
| 1.095.119   | Anagram Holdings LLC/Anagram International Inc          | 10,00 % | 15.08.2026            | 0                  | 0,00                         |
|   | <b>Unternehmensanleihen insgesamt**</b>                 |         |                       | <b>0</b>           | <b>0,00</b>                  |
| <b>Mittelfristige Schuldverschreibungen^ 0,22 % (31. Dezember 2023: 0,25 %)</b> |   |         |                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar</b>  |   |         |                       |                    |                              |
| 487.831   | Celebration Bidco LLC                                   | 0,00 %  | 29.12.2028            | 497.587            | 0,22                         |
|   | <b>Mittelfristige Schuldverschreibungen insgesamt †</b> |         |                       | <b>497.587</b>     | <b>0,22</b>                  |
|   | <b>Anlagen insgesamt</b>                                |         |                       | <b>195.795.394</b> | <b>86,44</b>                 |

## US Long Short Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Devisenterminkontrakte 0,20 % (31. Dezember 2023: 1,68 %)

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>   |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 247 €   | 256 US\$            | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | 0                              | 0,00                 |
| 1.390.713 US\$  | 1.301.310 €         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 2         | 42.490                         | 0,02                 |
| 1.694.168 US\$  | 1.599.762 €         | 16.01.2025       | UBS AG                      | 2         | 36.733                         | 0,02                 |
| 7.354.989 US\$  | 6.740.845 €         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 78        | 371.127                        | 0,16                 |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>   |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 21.921 £  | 27.422 US\$         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | 29                             | 0,00                 |
| 77.102 US\$   | 60.192 £            | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 2         | 1.726                          | 0,00                 |
| 22.539 US\$   | 17.394 £            | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | 757                            | 0,00                 |
| 85.100 US\$   | 65.381 £            | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 9         | 3.226                          | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>   |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 1.176 US\$  | 1.571 SGD           | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | 23                             | 0,00                 |
| 530 US\$  | 699 SGD             | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | 18                             | 0,00                 |
| 107.179 US\$  | 139.515 SGD         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 11        | 4.853                          | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>~</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>460.982</b>                 | <b>0,20</b>          |

### Futures-Kontrakte 1,15 % (31. Dezember 2023: 0,00 %)

| Anzahl Kontrakte   | Beschreibung                        | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|-------------------------------------|--------------------------------|----------------------|
| (23)   | Nasdaq 100 E-mini Future March 2025 | 384.257                        | 0,17                 |
| (197)  | S&P 500 E-mini Future March 2025    | 2.208.463                      | 0,98                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten <sup>*</sup></b> |                                     | <b>2.592.720</b>               | <b>1,15</b>          |

### Verkaufte Optionskontrakte 0,01 % (31. Dezember 2023: 0,00 %)

| Anzahl Kontrakte  | Fälligkeit | Art                                   | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|---|------------|---------------------------------------|---------------|----------------------|
| <b>Kaufoptionen</b>   |            |                                       |               |                      |
| 115   | 17.01.2025 | Match Group Inc, Strike Price \$35.00 | 4.428         | 0,00                 |
| 120   | 21.03.2025 | Match Group Inc, Strike Price \$35.00 | 19.440        | 0,01                 |
| <b>Beizulegender Zeitwert aus gekauften Optionskontrakten insgesamt<sup>+</sup> (Kosten: (31.144) US\$)</b> |            |                                       | <b>23.868</b> | <b>0,01</b>          |

### Differenzkontrakte 0,43 % (31. Dezember 2023: 0,32 %)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung | Gegenpartei                   | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---------|-----------------------|-------------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 111.600 | Arm Holdings Plc      | Goldman Sachs International   | 16.771                         | 0,01                 |
| 229.680 | Arm Holdings Plc      | JPMorgan Chase Bank           | 34.516                         | 0,02                 |
| 111.168 | Arm Holdings Plc ADR  | Bank of America Merrill Lynch | 16.706                         | 0,01                 |
| 486.169 | Campbell Soup Co      | Goldman Sachs International   | 7.955                          | 0,00                 |
| 523.026 | CarMax Inc            | Citibank NA                   | 10.604                         | 0,01                 |
| 115.063 | CarMax Inc            | Bank of America Merrill Lynch | 5.714                          | 0,00                 |

## US Long Short Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 0,43 % (31. Dezember 2023: 0,32 %) (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung              | Gegenpartei                   | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---------|------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 506.226 | CarMax Inc                         | Goldman Sachs International   | 25.139                         | 0,01                 |
| 111.383 | Casey's General Stores Inc         | Goldman Sachs International   | 7.438                          | 0,00                 |
| 372.818 | Cava Group Inc                     | Citibank NA                   | 28.921                         | 0,01                 |
| 119.866 | Conagra Brands Inc                 | Goldman Sachs International   | 668                            | 0,00                 |
| 169.981 | Conagra Brands Inc                 | JPMorgan Chase Bank           | 948                            | 0,00                 |
| 307.108 | Davita Healthcare Partner Inc      | Goldman Sachs International   | 2.135                          | 0,00                 |
| 488.806 | Dexcom Inc                         | Citibank NA                   | 9.608                          | 0,01                 |
| 83.615  | Exlservice Holdings Inc            | Goldman Sachs International   | 3.189                          | 0,00                 |
| 404.908 | Exlservice Holdings Inc            | Bank of America Merrill Lynch | 15.442                         | 0,01                 |
| 686.578 | Factset Research Systems Inc       | Goldman Sachs International   | 10.314                         | 0,01                 |
| 118.397 | Floor & Decor Holdings Inc Class A | Bank of America Merrill Lynch | 8.939                          | 0,01                 |
| 296.473 | Floor & Decor Holdings Inc Class A | Goldman Sachs International   | 22.383                         | 0,01                 |
| 85.835  | Floor & Decor Holdings Inc Class A | JPMorgan Chase Bank           | 6.480                          | 0,00                 |
| 277.576 | Floor & Decor Holdings Inc Class A | Citibank NA                   | 20.956                         | 0,01                 |
| 157.014 | Flowers Foods Inc                  | Citibank NA                   | 1.110                          | 0,00                 |
| 238.697 | General Mills Inc                  | Bank of America Merrill Lynch | 6.762                          | 0,00                 |
| 136.694 | General Mills Inc                  | Goldman Sachs International   | 3.872                          | 0,00                 |
| 81.357  | Genpact Ltd                        | Citibank NA                   | 1.316                          | 0,00                 |
| 27.332  | Genpact Ltd                        | Goldman Sachs International   | 442                            | 0,00                 |
| 340.694 | Genpact Ltd                        | Bank of America Merrill Lynch | 5.513                          | 0,00                 |
| 216.775 | G-III Apparel Group Ltd            | Goldman Sachs International   | 14.818                         | 0,01                 |
| 161.019 | Graco Inc                          | JPMorgan Chase Bank           | 5.850                          | 0,00                 |
| 76.415  | Helen of Troy Ltd                  | Citibank NA                   | 8.702                          | 0,01                 |
| 180.714 | Helen of Troy Ltd                  | Goldman Sachs International   | 20.578                         | 0,01                 |
| 309.228 | Illinois Tool Works Inc            | Goldman Sachs International   | 18.531                         | 0,01                 |
| 310.302 | Illinois Tool Works Inc            | JPMorgan Chase Bank           | 18.595                         | 0,01                 |
| 749.491 | Interpublic Group of Cos Inc       | Goldman Sachs International   | 49.240                         | 0,02                 |
| 173.722 | Interpublic Group of Cos Inc       | Bank of America Merrill Lynch | 11.413                         | 0,01                 |
| 265.533 | ITT Inc                            | Goldman Sachs International   | 15.541                         | 0,01                 |
| 517.237 | JM Smucker Co                      | Citibank NA                   | 4.919                          | 0,00                 |
| 252.846 | JM Smucker Co                      | Goldman Sachs International   | 6.017                          | 0,00                 |
| 232.726 | JM Smucker Co                      | JPMorgan Chase Bank           | 5.538                          | 0,00                 |
| 153.362 | JM Smucker Co                      | Bank of America Merrill Lynch | 3.649                          | 0,00                 |
| 100.958 | Kontoor Brands Inc                 | Bank of America Merrill Lynch | 5.153                          | 0,00                 |
| 52.392  | Kontoor Brands Inc                 | Citibank NA                   | 2.674                          | 0,00                 |
| 753.878 | Lamar Advertising Co Class A       | JPMorgan Chase Bank           | 47.669                         | 0,02                 |
| 136.108 | Lamar Advertising Co Class A       | Goldman Sachs International   | 8.606                          | 0,00                 |
| 241.019 | Lululemon Athletica Inc            | Bank of America Merrill Lynch | 4.545                          | 0,00                 |
| 113.512 | Lululemon Athletica Inc            | Citibank NA                   | 2.140                          | 0,00                 |
| 274.688 | Moelis & Co Class A                | Bank of America Merrill Lynch | 7.729                          | 0,00                 |
| 625.117 | Moelis & Co Class A                | Goldman Sachs International   | 17.589                         | 0,01                 |

## US Long Short Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 0,43 % (31. Dezember 2023: 0,32 %) (Fortsetzung)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung               | Gegenpartei                   | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|-------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------|----------------------|
| 521.542   | Omnicom Group Inc                   | Goldman Sachs International   | 28.140                         | 0,01                 |
| 90.609  | Oxford Industries Inc               | Goldman Sachs International   | 8.085                          | 0,00                 |
| 107.092   | Oxford Industries Inc               | Citibank NA                   | 9.555                          | 0,01                 |
| 51.295  | Paycom Software Inc                 | Bank of America Merrill Lynch | 6.014                          | 0,00                 |
| 545.995   | Paycom Software Inc                 | Goldman Sachs International   | 64.014                         | 0,03                 |
| 222.522   | PVH Corp                            | Citibank NA                   | 9.146                          | 0,01                 |
| 221.179   | Restaurant Brands International Inc | Goldman Sachs International   | 7.780                          | 0,00                 |
| 39.114  | Restaurant Brands International Inc | Bank of America Merrill Lynch | 1.376                          | 0,00                 |
| 280.985   | Robert Half Inc                     | Goldman Sachs International   | 17.524                         | 0,01                 |
| 42.596  | Robert Half Inc                     | JPMorgan Chase Bank           | 2.656                          | 0,00                 |
| 58.825  | Sonic Automotive Inc Class A        | Citibank NA                   | 3.396                          | 0,00                 |
| 382.926   | Sonic Automotive Inc Class A        | JPMorgan Chase Bank           | 22.106                         | 0,01                 |
| 177.269   | Sonic Automotive Inc Class A        | Goldman Sachs International   | 10.234                         | 0,01                 |
| 27.250  | Super Micro Computer Inc            | Bank of America Merrill Lynch | 2.486                          | 0,00                 |
| 50.931  | Super Micro Computer Inc            | Goldman Sachs International   | 4.647                          | 0,00                 |
| 339.700   | T Rowe Price Group Inc              | JPMorgan Chase Bank           | 17.778                         | 0,01                 |
| 671.594   | T Rowe Price Group Inc              | Goldman Sachs International   | 35.147                         | 0,02                 |
| 202.365   | Tesla Inc                           | Bank of America Merrill Lynch | 25.921                         | 0,01                 |
| 1.386   | Tesla Inc                           | Goldman Sachs International   | 178                            | 0,00                 |
| 307.243   | Tesla Inc                           | Citibank NA                   | 39.355                         | 0,02                 |
| 182.618   | Texas Instruments Inc               | JPMorgan Chase Bank           | 1.890                          | 0,00                 |
| 287.273   | Upbound Group Inc                   | Goldman Sachs International   | 28.645                         | 0,01                 |
| 173.439   | Wendy's Co                          | Goldman Sachs International   | 6.440                          | 0,00                 |
| 100.472   | Wendy's Co                          | Bank of America Merrill Lynch | 3.731                          | 0,00                 |
| 690.161   | WW Grainger Inc                     | Goldman Sachs International   | 52.013                         | 0,02                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Differenzkontrakten <sup>∞</sup></b> |                                     |                               | <b>961.594</b>                 | <b>0,43</b>          |

Total Return Swap-Kontrakte 0,00 % (31. Dezember 2023: 0,00 %)

| Nominalwert  | Datum der Schließung | Variabler Zinssatz | Referenzunternehmen                   | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|--|----------------------|--------------------|---------------------------------------|--------------------------------|----------------------|
| USD (2.109.698)  | 08.09.2025           | 4,87 <sup>1</sup>  | JPMorgan Basket JPNBSX10 <sup>2</sup> | 9.764                          | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Total Return Swap-Kontrakten <sup>∞</sup></b> |                      |                    |                                       | <b>9.764</b>                   | <b>0,00</b>          |

<sup>1</sup> Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist die 1-Tages-Overnight Bank Funding Rate.

<sup>2</sup> Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist die JPMorgan Chase Bank.

|  | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens |
|--|--------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> | <b>199.844.322</b> | <b>88,23</b>         |

## US Long Short Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

### Devisenterminkontrakte (2,51 %) (31. Dezember 2023: (0,18 %))

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 2.016.273 €  | 2.177.467 US\$      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 4         | (88.507)                        | (0,04)               |
| 79.116.166 €   | 87.195.676 US\$     | 16.01.2025       | UBS AG                      | 3         | (5.227.339)                     | (2,31)               |
| 6.918.896 €  | 7.294.124 US\$      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 42        | (125.802)                       | (0,06)               |
| 145 US\$   | 140 €               | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | (0)                             | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 25.442 £   | 33.044 US\$         | 16.01.2025       | Citibank NA                 | 1         | (1.184)                         | (0,00)               |
| 73.835 £   | 94.788 US\$         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 3         | (2.327)                         | (0,00)               |
| 83.985 £   | 106.844 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                      | 3         | (1.673)                         | (0,00)               |
| 4.922.922 £  | 6.389.785 US\$      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 27        | (225.019)                       | (0,10)               |
| 81.994 US\$  | 65.522 £            | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (57)                            | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 792 SGD  | 610 US\$            | 16.01.2025       | Citibank NA                 | 1         | (29)                            | (0,00)               |
| 1.785 SGD  | 1.343 US\$          | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 2         | (33)                            | (0,00)               |
| 1.925 SGD  | 1.438 US\$          | 16.01.2025       | UBS AG                      | 2         | (26)                            | (0,00)               |
| 270.971 SGD  | 208.655 US\$        | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 12        | (9.913)                         | (0,00)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>(5.681.909)</b>              | <b>(2,51)</b>        |

### Verkaufte Optionskontrakte (0,01 %) (31. Dezember 2023: (0,01 %))

| Anzahl Kontrakte   | Fälligkeit | Art                                   | Zeitwert US\$   | % des Nettovermögens |
|--|------------|---------------------------------------|-----------------|----------------------|
| <b>Verkaufsoptionen</b>  |            |                                       |                 |                      |
| (115)  | 21.03.2025 | Match Group Inc, Strike Price \$25.00 | (4.140)         | (0,00)               |
| (120)  | 16.05.2025 | Match Group Inc, Strike Price \$27.50 | (14.040)        | (0,01)               |
| <b>Beizulegender Zeitwert aus verkauften Optionskontrakten insgesamt * (Prämie: 21.223 US\$)</b> |            |                                       | <b>(18.180)</b> | <b>(0,01)</b>        |

### Differenzkontrakte (0,07 %) (31. Dezember 2023: (1,40 %))

| Anteile | Wertpapierbezeichnung        | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---------|------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 348.583 | Advance Auto Parts Inc       | Citibank NA                 | (20.950)                        | (0,01)               |
| 449.737 | Agco Corp                    | Citibank NA                 | (12.663)                        | (0,01)               |
| 307.079 | Centene Corp                 | Goldman Sachs International | (7.443)                         | (0,00)               |
| 78.788  | Darden Restaurants Inc       | Goldman Sachs International | (9.044)                         | (0,00)               |
| 317.816 | Darden Restaurants Inc       | JPMorgan Chase Bank         | (36.481)                        | (0,03)               |
| 226.035 | Darden Restaurants Inc       | Citibank NA                 | (25.946)                        | (0,01)               |
| 612.706 | Dexcom Inc                   | Goldman Sachs International | (11.050)                        | (0,00)               |
| 468.849 | Exelon Corp                  | Goldman Sachs International | (18.903)                        | (0,01)               |
| 70.722  | Exelon Corp                  | Citibank NA                 | (2.851)                         | (0,00)               |
| 204.288 | Interpublic Group of Cos Inc | Citibank NA                 | (10)                            | (0,00)               |

## US Long Short Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

### Differenzkontrakte (0,07 %) (31. Dezember 2023: (1,40 %)) (Fortsetzung)

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung        | Gegenpartei                 | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|----------------------|
| 210.504   | Lamar Advertising Co Class A | Citibank NA                 | (912)                           | (0,00)               |
| 100.453   | Southern Co                  | JPMorgan Chase Bank         | (546)                           | (0,00)               |
| 316.483   | Southern Co                  | Goldman Sachs International | (1.722)                         | (0,00)               |
| 30.089  | Ultra Beauty Inc             | Citibank NA                 | (720)                           | (0,00)               |
| <b>Gesamtverlust aus Differenzkontrakten <sup>∞</sup></b> |                              |                             | <b>(149.241)</b>                | <b>(0,07)</b>        |

### Total Return Swap-Kontrakte (0,39 %) (31. Dezember 2023: (2,37 %))

| Nominalwert   | Datum der Schließung | Variabler Zinssatz | Referenzunternehmen                   | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|---|----------------------|--------------------|---------------------------------------|---------------------------------|----------------------|
| USD 3.577.876   | 06.05.2026           | 5,33 <sup>1</sup>  | Russell 1000 Value Index <sup>2</sup> | (161.766)                       | (0,07)               |
| USD (5.101.038)   | 21.01.2026           | 4,88 <sup>1</sup>  | JPMorgan Basket JPNBLQGS <sup>2</sup> | (720.482)                       | (0,32)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Total Return Swap-Kontrakten <sup>∞</sup></b> |                      |                    |                                       | <b>(882.248)</b>                | <b>(0,39)</b>        |

<sup>1</sup> Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist die 1-Tages-Overnight Bank Funding Rate.

<sup>2</sup> Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist die JPMorgan Chase Bank.

|   | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens |
|---|--------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(6.731.578)</b> | <b>(2,98)</b>        |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>193.112.744</b> | <b>85,25</b>         |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>33.399.333</b>  | <b>14,75</b>         |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>226.512.077</b> | <b>100,00</b>        |

^ Schuldverschreibungen mit einem Zinssatz von 0,00 %, wurden zum 31. Dezember 2024 eventuell noch nicht abgerechnet und haben somit keinen gültigen Zinssatz. Die Zinssätze werden erst bei Abrechnung gültig.

| Portfolioanalyse  | US\$               | % des Gesamtvermögens |
|---|--------------------|-----------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 193.759.137        | 82,77                 |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden            | 1.538.670          | 0,66                  |
| † Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente  | 497.587            | 0,21                  |
| ± Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden                          | 2.598.408          | 1,11                  |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente   | (5.281.058)        | (2,26)                |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>193.112.744</b> | <b>82,49</b>          |

## US Multi Cap Opportunities - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der<br>Anteile                               | Wertpapierbezeichnung                        | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---|--|------------------|------------------------------|
| <b>Aktien 100,53 % (31. Dezember 2023: 99,12 %)</b> |  |                  |                              |
| <b>US-Dollar</b>                                    |  |                  |                              |
| 83.000  | Alliant Energy Corp                          | 4.908.620        | 1,27                         |
| 100.000   | Alphabet Inc Class C                         | 19.044.000       | 4,94                         |
| 73.000  | Amazon.com Inc                               | 16.015.470       | 4,15                         |
| 58.000  | Apollo Global Management Inc                 | 9.579.280        | 2,48                         |
| 78.000  | Apple Inc                                    | 19.532.760       | 5,06                         |
| 313.000   | Aramark                                      | 11.678.030       | 3,03                         |
| 5.000   | ASML Holding NV                              | 3.465.400        | 0,90                         |
| 41.500  | Avery Dennison Corp                          | 7.765.895        | 2,01                         |
| 116.500   | Ball Corp                                    | 6.422.645        | 1,66                         |
| 17.000  | Becton Dickinson & Co                        | 3.856.790        | 1,00                         |
| 41.500  | Berkshire Hathaway Inc Class B               | 18.811.120       | 4,88                         |
| 58.500  | BJ's Wholesale Club Holdings Inc             | 5.226.975        | 1,35                         |
| 875   | Booking Holdings Inc                         | 4.347.368        | 1,13                         |
| 257.500   | Brookfield Corp                              | 14.793.375       | 3,83                         |
| 27.000  | Charles River Laboratories International Inc | 4.984.200        | 1,29                         |
| 29.500  | Chubb Ltd                                    | 8.150.850        | 2,11                         |
| 271.000   | CSX Corp                                     | 8.745.170        | 2,27                         |
| 34.000  | Eagle Materials Inc                          | 8.389.840        | 2,17                         |
| 83.500  | EOG Resources Inc                            | 10.235.430       | 2,65                         |
| 440.000   | Graphic Packaging Holding Co                 | 11.950.400       | 3,10                         |
| 32.500  | HCA Healthcare Inc                           | 9.754.875        | 2,53                         |
| 64.000  | Intercontinental Exchange Inc                | 9.536.640        | 2,47                         |
| 49.000  | JPMorgan Chase & Co                          | 11.745.790       | 3,04                         |
| 19.000  | Lowe's Cos Inc                               | 4.689.200        | 1,22                         |
| 28.000  | McDonald's Corp                              | 8.116.920        | 2,10                         |
| 48.500  | Microsoft Corp                               | 20.442.750       | 5,30                         |
| 91.000  | Mondelez International Inc Class A           | 5.435.430        | 1,41                         |
| 37.000  | Morgan Stanley                               | 4.651.640        | 1,21                         |
| 25.000  | Motorola Solutions Inc                       | 11.555.750       | 2,99                         |
| 129.000   | Nasdaq Inc                                   | 9.972.990        | 2,58                         |
| 68.000  | NextEra Energy Inc                           | 4.874.920        | 1,26                         |
| 26.000  | Nordson Corp                                 | 5.440.240        | 1,41                         |
| 68.000  | Oracle Corp                                  | 11.331.520       | 2,94                         |
| 44.500  | QUALCOMM Inc                                 | 6.836.090        | 1,77                         |
| 18.500  | Rockwell Automation Inc                      | 5.287.115        | 1,37                         |
| 46.500  | TJX Cos Inc                                  | 5.617.665        | 1,46                         |
| 50.500  | T-Mobile US Inc                              | 11.146.865       | 2,89                         |
| 58.500  | TransUnion                                   | 5.423.535        | 1,41                         |

## US Multi Cap Opportunities - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile  | Wertpapierbezeichnung                    | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens |
|---|--|--------------------|----------------------|
| <b>Aktien 100,53 % (31. Dezember 2023: 99,12 %) (Fortsetzung)</b> |  |                    |                      |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>                                    |  |                    |                      |
| 79.000  | Uber Technologies Inc                    | 4.765.280          | 1,24                 |
| 177.000   | US Foods Holding Corp                    | 11.940.420         | 3,09                 |
| 54.500  | Veralto Corp                             | 5.550.825          | 1,44                 |
| 25.000  | Verisk Analytics Inc Class A             | 6.885.750          | 1,78                 |
| 9.500   | WD-40 Co                                 | 2.305.460          | 0,60                 |
| 35.500  | Westinghouse Air Brake Technologies Corp | 6.730.445          | 1,74                 |
| <b>Aktien insgesamt *</b>   |  | <b>387.941.733</b> | <b>100,53</b>        |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  |  | <b>387.941.733</b> | <b>100,53</b>        |

### Devisenterminkontrakte 0,13 % (31. Dezember 2023: 0,46 %)

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i>                                       |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 172.812 US\$  | 266.030 AUD         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 10        | 8.097                          | 0,00                 |
| 1.834.055 US\$  | 2.723.796 AUD       | 16.01.2025       | UBS AG                      | 2         | 147.585                        | 0,04                 |
| 418.936 US\$  | 634.803 AUD         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 35        | 25.889                         | 0,01                 |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>                                       |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 15.031 €  | 15.573 US\$         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | 1                              | 0,00                 |
| 168.690 US\$  | 156.362 €           | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 3         | 6.691                          | 0,00                 |
| 521.539 US\$  | 491.820 €           | 16.01.2025       | UBS AG                      | 6         | 11.989                         | 0,00                 |
| 925.692 US\$  | 843.118 €           | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 19        | 52.180                         | 0,01                 |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>                                       |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 1.308 US\$  | 1.014 £             | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 3         | 38                             | 0,00                 |
| 787 US\$  | 614 £               | 16.01.2025       | UBS AG                      | 3         | 18                             | 0,00                 |
| 1.331 US\$  | 1.037 £             | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 5         | 34                             | 0,00                 |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>                                       |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 445 SGD   | 326 US\$            | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | 0                              | 0,00                 |
| 689.653 US\$  | 924.296 SGD         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 2         | 11.733                         | 0,00                 |
| 997.930 US\$  | 1.333.874 SGD       | 16.01.2025       | UBS AG                      | 3         | 19.608                         | 0,01                 |
| 4.312.576 US\$  | 5.736.975 SGD       | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 43        | 104.830                        | 0,03                 |
| <i>Abgesicherte Klassen ZAR</i>                                       |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 502.521 US\$  | 9.164.012 ZAR       | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 5         | 17.482                         | 0,01                 |
| 124.806 US\$  | 2.255.580 ZAR       | 16.01.2025       | UBS AG                      | 2         | 5.421                          | 0,00                 |
| 1.983.554 US\$  | 35.796.964 ZAR      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 58        | 88.864                         | 0,02                 |
| 730 ZAR   | 39 US\$             | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | 0                              | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten **</b> |                     |                  |                             |           | <b>500.460</b>                 | <b>0,13</b>          |

## US Multi Cap Opportunities - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

|  | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|--|--------------------|------------------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> | <b>388.442.193</b> | <b>100,66</b>                |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,92 %) (31. Dezember 2023: (0,08 %))

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 227.650 AUD  | 150.584 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 10        | (9.633)                         | (0,00)               |
| 5.158.936 AUD  | 3.475.106 US\$      | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | (280.890)                       | (0,07)               |
| 750.832 AUD  | 495.717 US\$        | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 56        | (30.828)                        | (0,01)               |
| 12.194 US\$  | 19.721 AUD          | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (16)                            | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 199.279 €  | 216.630 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 3         | (10.166)                        | (0,00)               |
| 503.020 €  | 543.780 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                      | 7         | (22.626)                        | (0,01)               |
| 7.421.773 €  | 8.166.080 US\$      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 19        | (476.749)                       | (0,12)               |
| 51.325 US\$  | 49.565 €            | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | (27)                            | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen GBP</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 1.468 £  | 1.887 US\$          | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 5         | (48)                            | (0,00)               |
| 27.928 £   | 36.563 US\$         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 9         | (1.589)                         | (0,00)               |
| 985 US\$   | 787 £               | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (1)                             | (0,00)               |
| 242 US\$   | 193 £               | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | (0)                             | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 3.351.018 SGD  | 2.517.409 US\$      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 5         | (59.626)                        | (0,02)               |
| 389.699 SGD  | 289.971 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | (4.148)                         | (0,00)               |
| 58.811.469 SGD   | 45.152.777 US\$     | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 89        | (2.017.871)                     | (0,52)               |
| <i>Abgesicherte Klassen ZAR</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 65.447 US\$  | 1.238.908 ZAR       | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (127)                           | (0,00)               |
| 95.480.591 ZAR   | 5.390.861 US\$      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 8         | (337.196)                       | (0,09)               |
| 671.174 ZAR  | 38.296 US\$         | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | (2.772)                         | (0,00)               |
| 111.925.470 ZAR  | 6.213.819 US\$      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 71        | (289.748)                       | (0,08)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>(3.544.061)</b>              | <b>(0,92)</b>        |

|   | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|---|--------------------|------------------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(3.544.061)</b> | <b>(0,92)</b>                |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>384.898.132</b> | <b>99,74</b>                 |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>986.660</b>     | <b>0,26</b>                  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>385.884.792</b> | <b>100,00</b>                |

## US Multi Cap Opportunities - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

| Portfolioanalyse  | US\$               | % des<br>Gesamtver-<br>mögens |
|---|--------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 387.941.733        | 99,18                         |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente   | (3.043.601)        | (0,78)                        |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>384.898.132</b> | <b>98,40</b>                  |

## US Real Estate Securities - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der<br>Anteile  | Wertpapierbezeichnung                 | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---------------------------------------|--------------------|------------------------------|
| <b>Aktien 2,12 % (31. Dezember 2023: 0,00 %)</b>                           |                                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |                                       |                    |                              |
| 33.111   | Marriott International Inc Class A    | 9.235.982          | 2,12                         |
| <b>Aktien insgesamt *</b>  |                                       | <b>9.235.982</b>   | <b>2,12</b>                  |
| <b>Immobilienaktiengesellschaften 97,00 % (31. Dezember 2023: 97,54 %)</b> |                                       |                    |                              |
| <b>US-Dollar</b>   |                                       |                    |                              |
| 168.801  | American Healthcare REIT Inc          | 4.797.324          | 1,10                         |
| 186.331  | American Homes 4 Rent Class A         | 6.972.506          | 1,60                         |
| 159.249  | American Tower Corp                   | 29.207.859         | 6,69                         |
| 101.288  | AvalonBay Communities Inc             | 22.280.321         | 5,11                         |
| 73.986   | BXP Inc                               | 5.501.599          | 1,26                         |
| 63.822   | Camden Property Trust                 | 7.405.905          | 1,70                         |
| 107.289  | Crown Castle Inc                      | 9.737.550          | 2,23                         |
| 58.397   | Digital Realty Trust Inc              | 10.355.540         | 2,37                         |
| 38.900   | Equinix Inc                           | 36.678.421         | 8,41                         |
| 114.575  | Equity LifeStyle Properties Inc       | 7.630.695          | 1,75                         |
| 295.187  | Essential Properties Realty Trust Inc | 9.233.449          | 2,12                         |
| 65.449   | Extra Space Storage Inc               | 9.791.170          | 2,24                         |
| 77.262   | Federal Realty Investment Trust       | 8.649.481          | 1,98                         |
| 141.129  | FrontView REIT Inc                    | 2.558.669          | 0,59                         |
| 146.107  | Gaming & Leisure Properties Inc       | 7.036.513          | 1,61                         |
| 1.367.939  | Hudson Pacific Properties Inc         | 4.144.855          | 0,95                         |
| 358.884  | Invitation Homes Inc                  | 11.473.521         | 2,63                         |
| 144.897  | Iron Mountain Inc                     | 15.230.124         | 3,49                         |
| 178.459  | Kilroy Realty Corp                    | 7.218.667          | 1,65                         |
| 502.703  | Kimco Realty Corp                     | 11.778.331         | 2,70                         |
| 386.503  | Macerich Co                           | 7.699.140          | 1,76                         |
| 217.168  | Omega Healthcare Investors Inc        | 8.219.809          | 1,88                         |
| 339.471  | Prologis Inc                          | 35.882.085         | 8,22                         |
| 53.041   | Public Storage                        | 15.882.597         | 3,64                         |
| 198.309  | Realty Income Corp                    | 10.591.684         | 2,43                         |
| 150.906  | Rexford Industrial Realty Inc         | 5.834.026          | 1,34                         |
| 54.452   | SBA Communications Corp Class A       | 11.097.318         | 2,54                         |
| 125.308  | Simon Property Group Inc              | 21.579.291         | 4,95                         |
| 139.885  | Sun Communities Inc                   | 17.201.658         | 3,94                         |
| 254.555  | UDR Inc                               | 11.050.233         | 2,53                         |
| 331.390  | Ventas Inc                            | 19.515.557         | 4,47                         |
| 141.776  | VICI Properties Inc Class A           | 4.141.277          | 0,95                         |
| 160.883  | Welltower Inc                         | 20.276.084         | 4,65                         |
| 236.300  | Weyerhaeuser Co                       | 6.651.845          | 1,52                         |
| <b>Immobilienaktiengesellschaften insgesamt *</b>                          |                                       | <b>423.305.104</b> | <b>97,00</b>                 |
| <b>Anlagen insgesamt</b>   |                                       | <b>432.541.086</b> | <b>99,12</b>                 |

## US Real Estate Securities - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 0,29 % (31. Dezember 2023: 0,44 %)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens        |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|-----------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 9 AUD  | 5 US\$              | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | 0                              | 0,00                        |
| 2.265.739 US\$   | 3.476.306 AUD       | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 15        | 113.343                        | 0,03                        |
| 255.182 US\$   | 387.600 AUD         | 16.01.2025       | UBS AG                      | 2         | 15.194                         | 0,00                        |
| 1.864.091 US\$   | 2.853.416 AUD       | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 58        | 97.363                         | 0,02                        |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 43.544 US\$  | 37.212 CHF          | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 2         | 2.421                          | 0,00                        |
| 197.012 US\$   | 172.858 CHF         | 16.01.2025       | UBS AG                      | 9         | 5.985                          | 0,00                        |
| 371.763 US\$   | 322.170 CHF         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 13        | 15.733                         | 0,00                        |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 1 €  | 2 US\$              | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | 0                              | 0,00                        |
| 1.217.106 US\$   | 1.131.466 €         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 5         | 44.850                         | 0,01                        |
| 1.548.891 US\$   | 1.435.596 €         | 16.01.2025       | UBS AG                      | 9         | 61.541                         | 0,02                        |
| 20.357.256 US\$  | 19.140.004 €        | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 68        | 527.244                        | 0,12                        |
| <i>Abgesicherte Klassen HKD</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 1.453.190 HKD  | 186.923 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 3         | 167                            | 0,00                        |
| 1.388.099 HKD  | 178.640 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                      | 3         | 70                             | 0,00                        |
| 2.487.905 HKD  | 319.938 US\$        | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 26        | 368                            | 0,00                        |
| 30.658 US\$  | 237.841 HKD         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | 38                             | 0,00                        |
| 205.315 US\$   | 1.593.628 HKD       | 16.01.2025       | UBS AG                      | 5         | 144                            | 0,00                        |
| 640.828 US\$   | 4.974.272 HKD       | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 30        | 420                            | 0,00                        |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 50.255 US\$  | 66.837 SGD          | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 3         | 1.233                          | 0,00                        |
| 50.885 US\$  | 67.670 SGD          | 16.01.2025       | UBS AG                      | 6         | 1.254                          | 0,00                        |
| 294.787 US\$   | 391.536 SGD         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 50        | 7.615                          | 0,00                        |
| <i>Abgesicherte Klassen ZAR</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 2.662.578 US\$   | 47.773.097 ZAR      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 11        | 134.010                        | 0,03                        |
| 805.234 US\$   | 14.609.103 ZAR      | 16.01.2025       | UBS AG                      | 4         | 31.993                         | 0,01                        |
| 4.138.048 US\$   | 74.236.125 ZAR      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 66        | 208.820                        | 0,05                        |
| 328 ZAR  | 17 US\$             | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | 0                              | 0,00                        |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>                        |                     |                  |                             |           | <b>1.269.806</b>               | <b>0,29</b>                 |
|  |                     |                  |                             |           | <b>Zeitwert US\$</b>           | <b>% des Nettovermögens</b> |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |                     |                  |                             |           | <b>433.810.892</b>             | <b>99,41</b>                |

## US Real Estate Securities - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,99 %) (31. Dezember 2023: (0,08 %))

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 2.037.903 AUD  | 1.350.650 US\$      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 10        | (88.859)                        | (0,02)               |
| 18.247.298 AUD   | 12.285.055 US\$     | 16.01.2025       | UBS AG                      | 4         | (987.027)                       | (0,23)               |
| 2.002.128 AUD  | 1.318.256 US\$      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 62        | (78.613)                        | (0,02)               |
| <i>Abgesicherte Klassen CHF</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 21.474 CHF   | 24.712 US\$         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 2         | (981)                           | (0,00)               |
| 143.290 CHF  | 164.814 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                      | 9         | (6.463)                         | (0,00)               |
| 1.502.301 CHF  | 1.772.079 US\$      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 4         | (111.886)                       | (0,03)               |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 845.682 €  | 913.658 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 5         | (37.489)                        | (0,01)               |
| 17.232.657 €   | 18.964.370 US\$     | 16.01.2025       | UBS AG                      | 9         | (1.110.468)                     | (0,26)               |
| 7.840.058 €  | 8.530.793 US\$      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 47        | (408.096)                       | (0,09)               |
| <i>Abgesicherte Klassen HKD</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 370.404 HKD  | 47.762 US\$         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (74)                            | (0,00)               |
| 42.099.880 HKD   | 5.424.666 US\$      | 16.01.2025       | UBS AG                      | 8         | (4.543)                         | (0,00)               |
| 2.834.937 HKD  | 365.274 US\$        | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 24        | (289)                           | (0,00)               |
| 205.283 US\$   | 1.595.665 HKD       | 16.01.2025       | UBS AG                      | 3         | (150)                           | (0,00)               |
| 692.386 US\$   | 5.382.688 HKD       | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 34        | (605)                           | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen SGD</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 37.484 SGD   | 27.886 US\$         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 2         | (393)                           | (0,00)               |
| 19.147 SGD   | 14.611 US\$         | 16.01.2025       | UBS AG                      | 2         | (568)                           | (0,00)               |
| 1.605.286 SGD  | 1.232.926 US\$      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 57        | (55.538)                        | (0,01)               |
| <i>Abgesicherte Klassen ZAR</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 348.999.360 ZAR  | 19.697.958 US\$     | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 8         | (1.225.869)                     | (0,28)               |
| 3.621.688 ZAR  | 203.279 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | (11.588)                        | (0,00)               |
| 57.989.002 ZAR   | 3.262.547 US\$      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 62        | (193.264)                       | (0,04)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>(4.322.763)</b>              | <b>(0,99)</b>        |

|   | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens |
|---|--------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(4.322.763)</b> | <b>(0,99)</b>        |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>429.488.129</b> | <b>98,42</b>         |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>6.885.388</b>   | <b>1,58</b>          |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>436.373.517</b> | <b>100,00</b>        |

| Portfolioanalyse  | US\$               | % des Gesamtvermögens |
|---|--------------------|-----------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 432.541.086        | 97,29                 |
| <sup>∞</sup> OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente  | (3.052.957)        | (0,69)                |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>429.488.129</b> | <b>96,60</b>          |

## US Small Cap - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der<br>Anteile                              | Wertpapierbezeichnung                 | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|---------------------------------------|------------------|------------------------------|
| <b>Aktien 98,47 % (31. Dezember 2023: 98,17 %)</b> |                                       |                  |                              |
| <b>Kanadischer Dollar</b>                          |                                       |                  |                              |
| 18.616   | TerraVest Industries Inc**            | 1.447.134        | 0,16                         |
| <b>Kanadischer Dollar insgesamt</b>                |                                       | <b>1.447.134</b> | <b>0,16</b>                  |
| <b>US-Dollar</b>                                   |                                       |                  |                              |
| 58.073   | Advanced Energy Industries Inc*       | 6.714.981        | 0,76                         |
| 70.433   | American States Water Co*             | 5.474.053        | 0,62                         |
| 76.543   | AMERISAFE Inc*                        | 3.945.026        | 0,44                         |
| 68.802   | Amphastar Pharmaceuticals Inc*        | 2.554.618        | 0,29                         |
| 61.505   | AptarGroup Inc*                       | 9.662.435        | 1,09                         |
| 127.744  | Arcosa Inc*                           | 12.357.955       | 1,39                         |
| 50.216   | Armstrong World Industries Inc*       | 7.097.027        | 0,80                         |
| 44.749   | Asbury Automotive Group Inc*          | 10.875.349       | 1,22                         |
| 5.811  | Badger Meter Inc*                     | 1.232.629        | 0,14                         |
| 25.449   | Bank of Hawaii Corp*                  | 1.812.987        | 0,20                         |
| 179.657  | Bio-Techne Corp*                      | 12.940.694       | 1,46                         |
| 24.302   | Brady Corp Class A*                   | 1.794.703        | 0,20                         |
| 61.718   | Bright Horizons Family Solutions Inc* | 6.841.440        | 0,77                         |
| 98.726   | Cactus Inc Class A*                   | 5.761.649        | 0,65                         |
| 40.545   | Casella Waste Systems Inc Class A*    | 4.290.066        | 0,48                         |
| 27.687   | Chemed Corp*                          | 14.668.573       | 1,65                         |
| 38.842   | Chesapeake Utilities Corp*            | 4.713.477        | 0,53                         |
| 36.020   | Church & Dwight Co Inc*               | 3.771.654        | 0,42                         |
| 376.342  | CNX Resources Corp*                   | 13.800.461       | 1,55                         |
| 32.977   | Colliers International Group Inc*     | 4.483.883        | 0,50                         |
| 182.744  | Community Financial System Inc*       | 11.271.650       | 1,27                         |
| 84.828   | Commvault Systems Inc*                | 12.801.393       | 1,44                         |
| 308.536  | Computer Modelling Group Ltd**        | 2.289.029        | 0,26                         |
| 48.510   | CorVel Corp*                          | 5.397.223        | 0,61                         |
| 38.961   | CRA International Inc*                | 7.293.499        | 0,82                         |
| 40.502   | Crane Co*                             | 6.146.178        | 0,69                         |
| 33.418   | CSW Industrials Inc*                  | 11.789.870       | 1,33                         |
| 84.946   | Cullen/Frost Bankers Inc*             | 11.404.001       | 1,28                         |
| 54.226   | Eagle Materials Inc*                  | 13.380.808       | 1,51                         |
| 328.928  | Element Solutions Inc*                | 8.364.639        | 0,94                         |
| 113.718  | Enerpac Tool Group Corp Class A*      | 4.672.673        | 0,53                         |
| 30.176   | Enpro Inc*                            | 5.203.851        | 0,59                         |
| 101.994  | Esab Corp*                            | 12.233.160       | 1,38                         |
| 59.998   | ESCO Technologies Inc*                | 7.992.334        | 0,90                         |
| 104.033  | Exponent Inc*                         | 9.269.340        | 1,04                         |
| 8.029  | Fair Isaac Corp*                      | 15.985.177       | 1,80                         |

## US Small Cap - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile   | Wertpapierbezeichnung               | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|-------------------------------------|---------------|----------------------|
| <b>Aktien 98,47 % (31. Dezember 2023: 98,17 %) (Fortsetzung)</b> |                                     |               |                      |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>                                   |                                     |               |                      |
| 79.678   | Federal Signal Corp*                | 7.361.450     | 0,83                 |
| 162.606  | First Financial Bankshares Inc*     | 5.861.946     | 0,66                 |
| 84.948   | FirstService Corp*                  | 15.377.287    | 1,73                 |
| 72.619   | Floor & Decor Holdings Inc Class A* | 7.240.114     | 0,81                 |
| 37.240   | FTI Consulting Inc*                 | 7.117.681     | 0,80                 |
| 255.834  | Gates Industrial Corp Plc*          | 5.262.505     | 0,59                 |
| 163.051  | Glacier Bancorp Inc*                | 8.188.421     | 0,92                 |
| 94.561   | Graco Inc*                          | 7.970.547     | 0,90                 |
| 189.955  | Haemonetics Corp*                   | 14.831.686    | 1,67                 |
| 269.681  | Hagerty Inc Class A*                | 2.602.422     | 0,29                 |
| 36.524   | Hamilton Lane Inc Class A*          | 5.407.378     | 0,61                 |
| 406.667  | Hayward Holdings Inc*               | 6.217.938     | 0,70                 |
| 477.124  | Hillman Solutions Corp*             | 4.647.188     | 0,52                 |
| 53.473   | Houlihan Lokey Inc Class A*         | 9.286.121     | 1,05                 |
| 27.273   | ICON Plc*                           | 5.719.421     | 0,64                 |
| 53.487   | IDACORP Inc*                        | 5.845.059     | 0,66                 |
| 30.155   | Installed Building Products Inc*    | 5.284.664     | 0,59                 |
| 32.882   | Jack Henry & Associates Inc*        | 5.764.215     | 0,65                 |
| 37.976   | Kadant Inc*                         | 13.101.340    | 1,47                 |
| 164.847  | Kirby Corp*                         | 17.440.813    | 1,96                 |
| 96.869   | Knowles Corp*                       | 1.930.599     | 0,22                 |
| 69.087   | Lakeland Financial Corp*            | 4.750.422     | 0,53                 |
| 242.227  | Lattice Semiconductor Corp*         | 13.722.160    | 1,54                 |
| 58.908   | Lindsay Corp*                       | 6.969.405     | 0,78                 |
| 56.330   | Littelfuse Inc*                     | 13.274.165    | 1,49                 |
| 65.593   | Manhattan Associates Inc*           | 17.725.852    | 2,00                 |
| 28.096   | Miller Industries Inc*              | 1.836.355     | 0,21                 |
| 91.614   | MKS Instruments Inc*                | 9.563.585     | 1,08                 |
| 76.130   | Nexstar Media Group Inc Class A*    | 12.026.256    | 1,35                 |
| 19.042   | Nordson Corp*                       | 3.984.348     | 0,45                 |
| 41.139   | Novanta Inc*                        | 6.284.805     | 0,71                 |
| 267.575  | Oceaneering International Inc*      | 6.978.356     | 0,79                 |
| 4.569  | Omega Flex Inc*                     | 191.761       | 0,02                 |
| 31.498   | Pool Corp*                          | 10.738.928    | 1,21                 |
| 194.513  | Power Integrations Inc*             | 12.001.452    | 1,35                 |
| 137.429  | Prosperity Bancshares Inc*          | 10.355.275    | 1,17                 |
| 56.567   | Qualys Inc*                         | 7.931.825     | 0,89                 |
| 54.407   | RBC Bearings Inc*                   | 16.275.310    | 1,83                 |
| 105.725  | Richelieu Hardware Ltd**            | 2.869.910     | 0,32                 |
| 58.946   | RLI Corp*                           | 9.716.069     | 1,09                 |

## US Small Cap - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile   | Wertpapierbezeichnung                | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens |
|--|--------------------------------------|--------------------|----------------------|
| <b>Aktien 98,47 % (31. Dezember 2023: 98,17 %) (Fortsetzung)</b> |                                      |                    |                      |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>                                   |                                      |                    |                      |
| 57.057   | Rogers Corp*                         | 5.797.562          | 0,65                 |
| 127.868  | Rollins Inc*                         | 5.926.682          | 0,67                 |
| 73.170   | Shift4 Payments Inc Class A*         | 7.593.583          | 0,85                 |
| 38.450   | Simpson Manufacturing Co Inc*        | 6.376.164          | 0,72                 |
| 32.226   | SiteOne Landscape Supply Inc*        | 4.246.420          | 0,48                 |
| 270.331  | Sitio Royalties Corp Class A*        | 5.184.949          | 0,58                 |
| 88.180   | SPS Commerce Inc*                    | 16.224.238         | 1,83                 |
| 82.255   | SPX Technologies Inc*                | 11.969.748         | 1,35                 |
| 51.616   | Standex International Corp*          | 9.651.676          | 1,09                 |
| 237.947  | Stevanato Group SpA*                 | 5.184.865          | 0,58                 |
| 85.930   | Stewart Information Services Corp*   | 5.799.416          | 0,65                 |
| 87.885   | Stock Yards Bancorp Inc*             | 6.293.445          | 0,71                 |
| 384.491  | Tetra Tech Inc*                      | 15.318.121         | 1,72                 |
| 2.721  | Texas Pacific Land Corp*             | 3.009.317          | 0,34                 |
| 82.681   | Texas Roadhouse Inc Class A*         | 14.918.133         | 1,68                 |
| 163.338  | Tidewater Inc*                       | 8.936.222          | 1,01                 |
| 109.732  | Toro Co*                             | 8.789.533          | 0,99                 |
| 137.400  | Tractor Supply Co*                   | 7.290.444          | 0,82                 |
| 60.269   | Transcat Inc*                        | 6.372.844          | 0,72                 |
| 30.829   | Trex Co Inc*                         | 2.128.126          | 0,24                 |
| 19.335   | Tyler Technologies Inc*              | 11.149.334         | 1,25                 |
| 24.958   | UFP Technologies Inc*                | 6.102.481          | 0,69                 |
| 25.170   | UMB Financial Corp*                  | 2.840.686          | 0,32                 |
| 238.831  | United Community Banks Inc*          | 7.716.630          | 0,87                 |
| 218.546  | Utz Brands Inc*                      | 3.422.430          | 0,39                 |
| 53.596   | Valmont Industries Inc*              | 16.436.285         | 1,85                 |
| 50.711   | Valvoline Inc*                       | 1.834.724          | 0,21                 |
| 199.080  | Vertex Inc Class A*                  | 10.620.918         | 1,20                 |
| 122.602  | Viper Energy Inc Class A*            | 6.016.080          | 0,68                 |
| 22.300   | VSE Corp*                            | 2.120.730          | 0,24                 |
| 23.668   | Watsco Inc*                          | 11.216.029         | 1,26                 |
| 20.542   | WD-40 Co*                            | 4.985.133          | 0,56                 |
| 20.277   | West Pharmaceutical Services Inc*    | 6.641.934          | 0,75                 |
| 2.615  | White Mountains Insurance Group Ltd* | 5.086.332          | 0,57                 |
| 68.699   | WillScot Holdings Corp*              | 2.297.982          | 0,26                 |
| 20.408   | Winmark Corp*                        | 8.021.773          | 0,90                 |
|  | <b>US-Dollar insgesamt</b>           | <b>873.464.488</b> | <b>98,31</b>         |
|  | <b>Aktien insgesamt</b>              | <b>874.911.622</b> | <b>98,47</b>         |
|  | <b>Anlagen insgesamt</b>             | <b>874.911.622</b> | <b>98,47</b>         |

## US Small Cap - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 0,03 % (31. Dezember 2023: 0,12 %)

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens        |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|-----------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 56 AUD   | 35 US\$             | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | 0                              | 0,00                        |
| 440.481 US\$   | 678.986 AUD         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 13        | 20.078                         | 0,00                        |
| 55.147 US\$  | 86.791 AUD          | 16.01.2025       | UBS AG                      | 2         | 1.409                          | 0,00                        |
| 1.525.377 US\$   | 2.298.282 AUD       | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 44        | 102.369                        | 0,01                        |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 10.281 €   | 10.651 US\$         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | 0                              | 0,00                        |
| 967.211 US\$   | 916.371 €           | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 6         | 17.804                         | 0,00                        |
| 3.591.549 US\$   | 3.437.517 €         | 16.01.2025       | UBS AG                      | 6         | 30.109                         | 0,01                        |
| 2.385.513 US\$   | 2.226.769 €         | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 37        | 78.467                         | 0,01                        |
| <i>Abgesicherte Klassen ZAR</i>  |                     |                  |                             |           |                                |                             |
| 187.121 US\$   | 3.398.371 ZAR       | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 11        | 7.250                          | 0,00                        |
| 20.049 US\$  | 363.388 ZAR         | 16.01.2025       | UBS AG                      | 2         | 815                            | 0,00                        |
| 358.212 US\$   | 6.332.610 ZAR       | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 32        | 23.033                         | 0,00                        |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>~</sup></b>                        |                     |                  |                             |           | <b>281.334</b>                 | <b>0,03</b>                 |
|  |                     |                  |                             |           | <b>Zeitwert US\$</b>           | <b>% des Nettovermögens</b> |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> |                     |                  |                             |           | <b>875.192.956</b>             | <b>98,50</b>                |

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,22 %) (31. Dezember 2023: (0,02 %))

| Geforderter Betrag   | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Verlust US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen AUD</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 410.264 AUD  | 270.906 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 7         | (16.887)                        | (0,00)               |
| 5.296.652 AUD  | 3.567.514 US\$      | 16.01.2025       | UBS AG                      | 3         | (288.029)                       | (0,03)               |
| 2.975.889 AUD  | 1.912.672 US\$      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 66        | (70.113)                        | (0,01)               |
| 27.820 US\$  | 44.991 AUD          | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (37)                            | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 1.014.064 €  | 1.072.837 US\$      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 4         | (22.215)                        | (0,00)               |
| 1.007.525 €  | 1.064.427 US\$      | 16.01.2025       | UBS AG                      | 6         | (20.580)                        | (0,00)               |
| 54.426.511 €   | 57.787.445 US\$     | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 60        | (1.398.838)                     | (0,16)               |
| 398.366 US\$   | 384.700 €           | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | (203)                           | (0,00)               |
| 497 US\$   | 480 €               | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | (0)                             | (0,00)               |
| <i>Abgesicherte Klassen ZAR</i>  |                     |                  |                             |           |                                 |                      |
| 14.132 US\$  | 267.519 ZAR         | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 1         | (27)                            | (0,00)               |
| 20.768.497 ZAR   | 1.174.114 US\$      | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 4         | (74.864)                        | (0,01)               |
| 591.598 ZAR  | 33.166 US\$         | 16.01.2025       | UBS AG                      | 4         | (1.854)                         | (0,00)               |
| 25.866.624 ZAR   | 1.418.075 US\$      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 72        | (48.987)                        | (0,01)               |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>~</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>(1.942.634)</b>              | <b>(0,22)</b>        |

## US Small Cap - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

|   | Zeitwert<br>US\$   | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|---|--------------------|------------------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(1.942.634)</b> | <b>(0,22)</b>                |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              | <b>873.250.322</b> | <b>98,28</b>                 |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  | <b>15.288.100</b>  | <b>1,72</b>                  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   | <b>888.538.422</b> | <b>100,00</b>                |

| <b>Portfolioanalyse</b>   | US\$               | % des<br>Gesamtver-<br>mögens |
|---|--------------------|-------------------------------|
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind | 868.305.549        | 97,19                         |
| ** Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden            | 6.606.073          | 0,74                          |
| ∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente   | (1.661.300)        | (0,19)                        |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  | <b>873.250.322</b> | <b>97,74</b>                  |

## US Small Cap Intrinsic Value - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

| Anzahl der<br>Anteile                              | Wertpapierbezeichnung                        | Zeitwert<br>US\$ | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--|--|------------------|------------------------------|
| <b>Aktien 98,71 % (31. Dezember 2023: 93,24 %)</b> |  |                  |                              |
| <b>US-Dollar</b>                                   |  |                  |                              |
| 128.354  | Acadia Healthcare Co Inc                     | 5.089.236        | 1,27                         |
| 459.611  | Accuray Inc                                  | 910.030          | 0,23                         |
| 300.241  | Adeia Inc                                    | 4.197.369        | 1,05                         |
| 102.522  | AerCap Holdings NV                           | 9.811.355        | 2,45                         |
| 447.783  | Alight Inc Class A                           | 3.098.658        | 0,77                         |
| 60.416   | ALLETE Inc                                   | 3.914.957        | 0,98                         |
| 307.631  | Amneal Pharmaceuticals Inc                   | 2.436.437        | 0,61                         |
| 62.582   | Arcosa Inc                                   | 6.054.183        | 1,51                         |
| 41.475   | Atmos Energy Corp                            | 5.776.223        | 1,44                         |
| 88.801   | AtriCure Inc                                 | 2.713.759        | 0,68                         |
| 97.101   | Avanos Medical Inc                           | 1.545.848        | 0,39                         |
| 44.370   | Avery Dennison Corp                          | 8.302.958        | 2,07                         |
| 551.491  | Babcock & Wilcox Enterprises Inc             | 904.445          | 0,23                         |
| 268.028  | Banc of California Inc                       | 4.143.713        | 1,03                         |
| 162.934  | Bloom Energy Corp Class A                    | 3.618.764        | 0,90                         |
| 86.563   | Box Inc Class A                              | 2.735.391        | 0,68                         |
| 37.840   | Bread Financial Holdings Inc                 | 2.310.510        | 0,58                         |
| 83.920   | Caleres Inc                                  | 1.943.587        | 0,48                         |
| 56.067   | Cannae Holdings Inc                          | 1.113.491        | 0,28                         |
| 66.356   | CEVA Inc                                     | 2.093.532        | 0,52                         |
| 17.607   | Charles River Laboratories International Inc | 3.250.252        | 0,81                         |
| 166.243  | Ciena Corp                                   | 14.099.069       | 3,52                         |
| 16.721   | Clean Harbors Inc                            | 3.848.171        | 0,96                         |
| 369.402  | Cleveland-Cliffs Inc                         | 3.472.379        | 0,87                         |
| 165.260  | CNX Resources Corp                           | 6.060.084        | 1,51                         |
| 505.134  | Cognyte Software Ltd                         | 4.369.409        | 1,09                         |
| 33.215   | Coherent Corp                                | 3.146.457        | 0,79                         |
| 1.280.025  | Conduent Inc                                 | 5.171.301        | 1,29                         |
| 29.214   | CONMED Corp                                  | 1.999.406        | 0,50                         |
| 349.204  | Criteo SA ADR                                | 13.814.510       | 3,45                         |
| 96.959   | CytoSorbents Corp (Right Shares, 12/31/2049) | 0                | 0,00                         |
| 96.959   | CytoSorbents Corp                            | 88.233           | 0,02                         |
| 144.869  | Devon Energy Corp                            | 4.741.562        | 1,18                         |
| 458.379  | Enviri Corp                                  | 3.529.518        | 0,88                         |
| 72.177   | Haemonetics Corp                             | 5.635.580        | 1,41                         |
| 235.344  | Hain Celestial Group Inc                     | 1.447.366        | 0,36                         |
| 43.456   | Harmonic Inc                                 | 574.923          | 0,14                         |
| 48.301   | Helios Technologies Inc                      | 2.156.157        | 0,54                         |
| 409.780  | Huntington Bancshares Inc                    | 6.667.121        | 1,66                         |

## US Small Cap Intrinsic Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile   | Wertpapierbezeichnung                   | Zeitwert US\$ | % des Nettovermögens |
|--|---|---------------|----------------------|
| <b>Aktien 98,71 % (31. Dezember 2023: 93,24 %) (Fortsetzung)</b> |   |               |                      |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>                                   |   |               |                      |
| 512.137  | indie Semiconductor Inc Class A         | 2.074.155     | 0,52                 |
| 69.828   | Innovex International Inc               | 975.497       | 0,24                 |
| 360.216  | Innoviz Technologies Ltd                | 605.163       | 0,15                 |
| 86.490   | Integra LifeSciences Holdings Corp      | 1.961.593     | 0,49                 |
| 503.326  | International Game Technology Plc       | 8.888.737     | 2,22                 |
| 11.018   | ION Geophysical Corp                    | 0             | 0,00                 |
| 40.506   | IPG Photonics Corp                      | 2.945.597     | 0,73                 |
| 34.328   | Itron Inc                               | 3.727.334     | 0,93                 |
| 192.210  | KBR Inc                                 | 11.134.725    | 2,78                 |
| 460.310  | Kyndryl Holdings Inc                    | 15.926.726    | 3,97                 |
| 597.639  | Lions Gate Entertainment Corp Class B   | 4.512.174     | 1,13                 |
| 61.935   | MACOM Technology Solutions Holdings Inc | 8.045.976     | 2,01                 |
| 101.869  | Mercury Systems Inc                     | 4.278.498     | 1,07                 |
| 15.423   | Molina Healthcare Inc                   | 4.488.864     | 1,12                 |
| 114.433  | New Jersey Resources Corp               | 5.338.299     | 1,34                 |
| 128.021  | nLight Inc                              | 1.342.941     | 0,34                 |
| 96.859   | Northwestern Energy Group Inc           | 5.178.082     | 1,29                 |
| 85.756   | ODP Corp                                | 1.950.091     | 0,49                 |
| 144.076  | OneSpan Inc                             | 2.671.169     | 0,67                 |
| 364.700  | OPENLANE Inc                            | 7.235.648     | 1,81                 |
| 369.855  | OraSure Technologies Inc                | 1.335.177     | 0,33                 |
| 141.864  | Ormat Technologies Inc                  | 9.607.030     | 2,40                 |
| 28.501   | OSI Systems Inc                         | 4.771.922     | 1,19                 |
| 140.117  | Patterson Cos Inc                       | 4.324.010     | 1,08                 |
| 172.675  | Patterson-UTI Energy Inc                | 1.426.295     | 0,36                 |
| 115.194  | Portland General Electric Co            | 5.024.762     | 1,25                 |
| 30.353   | QuidelOrtho Corp                        | 1.352.226     | 0,34                 |
| 101.354  | Radware Ltd                             | 2.283.506     | 0,57                 |
| 121.042  | Rambus Inc                              | 6.398.280     | 1,60                 |
| 409.658  | Resideo Technologies Inc                | 9.442.617     | 2,36                 |
| 1.245.498  | Ribbon Communications Inc               | 5.181.272     | 1,30                 |
| 66.728   | Semtech Corp                            | 4.127.127     | 1,03                 |
| 391.292  | Standard BioTools Inc                   | 684.761       | 0,17                 |
| 447.618  | Stratasys Ltd                           | 3.979.324     | 0,99                 |
| 279.370  | TechnipFMC Plc                          | 8.084.968     | 2,02                 |
| 7.842  | Teledyne Technologies Inc               | 3.639.708     | 0,91                 |
| 83.388   | Tempur Sealy International Inc          | 4.727.266     | 1,18                 |
| 844.024  | TETRA Technologies Inc                  | 3.021.606     | 0,76                 |
| 81.054   | Texas Capital Bancshares Inc            | 6.338.423     | 1,58                 |

## US Small Cap Intrinsic Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile   | Wertpapierbezeichnung       | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens |
|--|-----------------------------|--------------------|----------------------|
| <b>Aktien 98,71 % (31. Dezember 2023: 93,24 %) (Fortsetzung)</b> |                             |                    |                      |
| <b>US-Dollar (Fortsetzung)</b>                                   |                             |                    |                      |
| 121.300  | TreeHouse Foods Inc         | 4.261.269          | 1,07                 |
| 14.148   | Twin Discount Inc           | 166.239            | 0,04                 |
| 232.857  | UiPath Inc Class A          | 2.959.612          | 0,74                 |
| 368.224  | Under Armour Inc Class C    | 2.746.951          | 0,69                 |
| 473.584  | Unisys Corp                 | 2.997.787          | 0,75                 |
| 45.282   | United Parks & Resorts Inc  | 2.544.396          | 0,63                 |
| 122.661  | Varex Imaging Corp          | 1.789.624          | 0,45                 |
| 43.413   | Varonis Systems Inc Class B | 1.928.840          | 0,48                 |
| 327.186  | Veeco Instruments Inc       | 8.768.585          | 2,19                 |
| 104.714  | Verint Systems Inc          | 2.874.399          | 0,72                 |
| 507.638  | Viasat Inc                  | 4.319.999          | 1,08                 |
| 229.741  | Viavi Solutions Inc         | 2.320.384          | 0,58                 |
| 47.141   | Vistra Corp                 | 6.499.330          | 1,62                 |
| 26.437   | Whirlpool Corp              | 3.026.508          | 0,75                 |
| 29.018   | Wix.com Ltd                 | 6.225.812          | 1,56                 |
| 264.325  | Wolfspeed Inc               | 1.760.405          | 0,44                 |
| 240.188  | Xperi Inc                   | 2.466.731          | 0,62                 |
| 128.094  | Zimvie Inc                  | 1.786.911          | 0,45                 |
| <b>Aktien insgesamt *</b>  |                             | <b>395.261.275</b> | <b>98,71</b>         |
| <b>Anlagen insgesamt</b>   |                             | <b>395.261.275</b> | <b>98,71</b>         |

### Devisenterminkontrakte 0,01 % (31. Dezember 2023: 0,00 %)

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens |
|---|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>   |                     |                  |                             |           |                                |                      |
| 767.822 US\$  | 711.294 €           | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 7         | 30.885                         | 0,01                 |
| 554.711 US\$  | 526.160 €           | 16.01.2025       | UBS AG                      | 4         | 9.583                          | 0,00                 |
| 90.577 US\$   | 85.670 €            | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 1         | 1.819                          | 0,00                 |
| <b>Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b> |                     |                  |                             |           | <b>42.287</b>                  | <b>0,01</b>          |

|  | Zeitwert US\$      | % des Nettovermögens |
|--|--------------------|----------------------|
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> | <b>395.303.562</b> | <b>98,72</b>         |

## US Small Cap Intrinsic Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,13 %) (31. Dezember 2023: (0,00 %))

| Geforderter Betrag  | Zu zahlender Betrag | Fälligkeitsdatum | Gegenpartei                 | Kontrakte | Nicht realisierter Gewinn US\$ | % des Nettovermögens         |
|---|---------------------|------------------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|------------------------------|
| <i>Abgesicherte Klassen EUR</i>   |                     |                  |                             |           |                                |                              |
| 572.161 €   | 625.213 US\$        | 16.01.2025       | Goldman Sachs International | 3         | (32.426)                       | (0,01)                       |
| 686.005 €   | 731.745 US\$        | 16.01.2025       | UBS AG                      | 6         | (21.011)                       | (0,00)                       |
| 7.743.326 €   | 8.516.760 US\$      | 16.01.2025       | Westpac Banking Corp        | 7         | (494.283)                      | (0,12)                       |
| 79.997 US\$   | 77.253 €            | 16.01.2025       | UBS AG                      | 1         | (41)                           | (0,00)                       |
| <b>Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten <sup>∞</sup></b>                          |                     |                  |                             |           | <b>(547.761)</b>               | <b>(0,13)</b>                |
|   |                     |                  |                             |           | <b>Zeitwert US\$</b>           | <b>% des Nettovermögens</b>  |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> |                     |                  |                             |           | <b>(547.761)</b>               | <b>(0,13)</b>                |
| <b>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto</b>              |                     |                  |                             |           | <b>394.755.801</b>             | <b>98,59</b>                 |
| <b>Sonstiges Nettovermögen</b>  |                     |                  |                             |           | <b>5.657.424</b>               | <b>1,41</b>                  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                   |                     |                  |                             |           | <b>400.413.225</b>             | <b>100,00</b>                |
| <b>Portfolioanalyse</b>   |                     |                  |                             |           | <b>US\$</b>                    | <b>% des Gesamtvermögens</b> |
| * Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind   |                     |                  |                             |           | 395.261.275                    | 98,40                        |
| <sup>∞</sup> OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente  |                     |                  |                             |           | (505.474)                      | (0,13)                       |
| <b>Anlagen insgesamt</b>  |                     |                  |                             |           | <b>394.755.801</b>             | <b>98,27</b>                 |

## Bilanzen

|   | Anm. | Absolute Return<br>Multi Strategy | Asia Responsible<br>Transition Bond | China A-Share<br>Equity     | China Bond                  | China Equity                | Climate Innovation          | CLO Income                  | Commodities                 |
|---|------|-----------------------------------|-------------------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
|   |      | Zum<br>31. Dezember<br>2024*      | Zum<br>31. Dezember<br>2024         | Zum<br>31. Dezember<br>2024 | Zum<br>31. Dezember<br>2024 | Zum<br>31. Dezember<br>2024 | Zum<br>31. Dezember<br>2024 | Zum<br>31. Dezember<br>2024 | Zum<br>31. Dezember<br>2024 |
|   |      | US\$                              | US\$                                | CNY                         | CNY                         | US\$                        | US\$                        | US\$                        | US\$                        |
| <b>Umlaufvermögen</b>   |      |                                   |                                     |                             |                             |                             |                             |                             |                             |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                      | 2    | –                                 | 26.239.901                          | 14.682.825                  | 118.467.634                 | 135.453.969                 | 2.949.182                   | 1.127.364.100               | 133.209.594                 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 3    | 183.031                           | 1.834.346                           | 198.041                     | 7.556.799                   | 4.388.700                   | 121.826                     | 13.609.709                  | 22.706.391                  |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen   |      | 13.358                            | –                                   | –                           | –                           | 379.671                     | –                           | –                           | 69                          |
| Forderungen aus ausgegebenen Anteilen   |      | –                                 | –                                   | –                           | 308                         | –                           | –                           | –                           | 82.767                      |
| Forderungen gegenüber Brokern   |      | –                                 | 299.921                             | –                           | 113.148                     | –                           | –                           | 280.000                     | 1.280.000                   |
| Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen   |      | 1.028                             | 364.705                             | 76.804                      | 1.536.166                   | 1.578                       | 38.372                      | 18.073.978                  | 654.311                     |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   |      | 197.417                           | 28.738.873                          | 14.957.670                  | 127.674.055                 | 140.223.918                 | 3.109.380                   | 1.159.327.787               | 157.933.132                 |
| <b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>   |      |                                   |                                     |                             |                             |                             |                             |                             |                             |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                   | 2    | –                                 | 149.916                             | –                           | 1.502.829                   | 866.976                     | –                           | 8.294.605                   | 1.617.307                   |
| Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen   |      | –                                 | –                                   | –                           | 10                          | 296.643                     | –                           | –                           | 182.778                     |
| Antizipative Passiva  |      | 501                               | 38.596                              | 207.424                     | 148.719                     | 182.373                     | 18.795                      | 626.388                     | 102.559                     |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen  |      | –                                 | –                                   | –                           | –                           | 1.020.719                   | –                           | 79.211.073                  | 911.240                     |
| Sonstige Verbindlichkeiten  |      | 196.916                           | 13.700                              | 87.545                      | 288.633                     | 42.459                      | 9.109                       | 58.216                      | 10.658                      |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b> |      | 197.417                           | 202.212                             | 294.969                     | 1.940.191                   | 2.409.170                   | 27.904                      | 88.190.282                  | 2.824.542                   |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                             |      | –                                 | 28.536.661                          | 14.662.701                  | 125.733.864                 | 137.814.748                 | 3.081.476                   | 1.071.137.505               | 155.108.590                 |

\* Der Absolute Return Multi Strategy wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Bilanzen (Fortsetzung)

|   |      | Corporate Hybrid<br>Bond    | Developed Market<br>FMP – 2027 | EMD Corporate –<br>Social and<br>Environmental<br>Transition | Emerging Market<br>Debt - Hard<br>Currency | Emerging Market<br>Debt - Local<br>Currency | Emerging Market<br>Debt Blend | Emerging Market<br>Debt Sustainable<br>Investment Grade<br>Blend | Emerging Markets<br>Equity  |
|---|------|-----------------------------|--------------------------------|--|--|---|-------------------------------|--|-----------------------------|
|   | Anm. | Zum<br>31. Dezember<br>2024 | Zum<br>31. Dezember<br>2024    | Zum<br>31. Dezember<br>2024                                  | Zum<br>31. Dezember<br>2024                | Zum<br>31. Dezember<br>2024                 | Zum<br>31. Dezember<br>2024   | Zum<br>31. Dezember<br>2024                                      | Zum<br>31. Dezember<br>2024 |
|   |      | EUR                         | US\$                           | US\$   | US\$                                       | US\$  | US\$                          | US\$   | US\$                        |
| <b>Umlaufvermögen</b>   |      |                             |                                |  |  |   |                               |  |                             |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                      | 2    | 2.213.487.095               | 125.680.069                    | 112.411.128  | 2.635.963.909                              | 1.057.194.355                               | 469.383.288                   | 52.887.691   | 107.187.495                 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 3    | 112.576.339                 | 563.777                        | 1.999.150  | 39.879.035                                 | 12.909.847                                  | 45.252.303                    | 4.462.142  | 2.889.414                   |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen   |      | –                           | –                              | –  | 2.351.883                                  | 2.846.453                                   | 1.449.461                     | –  | 445.683                     |
| Forderungen an ausgegebenen Anteilen  |      | 4.444.540                   | –                              | 15.023   | 4.262.323                                  | 117.904                                     | 108.265                       | 176  | 21.424                      |
| Forderungen gegenüber Brokern   |      | –                           | –                              | 108.497  | 5.396.830                                  | 22.598.277                                  | 8.615.226                     | 940.360  | –                           |
| Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen   |      | 45.117.294                  | 1.331.872                      | 1.940.567  | 52.128.404                                 | 24.490.277                                  | 10.157.793                    | 916.420  | 203.628                     |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   |      | <b>2.375.625.268</b>        | <b>127.575.718</b>             | <b>116.474.365</b>   | <b>2.739.982.384</b>                       | <b>1.120.157.113</b>                        | <b>534.966.336</b>            | <b>59.206.789</b>  | <b>110.747.644</b>          |
| <b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>   |      |                             |                                |  |  |   |                               |  |                             |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                   | 2    | 27.715.188                  | 69.447                         | 2.507.885  | 26.249.695                                 | 37.425.529                                  | 16.357.432                    | 1.573.810  | 1.965.401                   |
| Kontenüberziehung   | 4    | –                           | –                              | –  | –  | 2.396                                       | –                             | –  | –                           |
| Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen   |      | 3.084.123                   | –                              | 64.495   | 6.044.012                                  | 434.001                                     | 818.457                       | –  | 911.158                     |
| Verbindlichkeiten gegenüber dem Makler  |      | –                           | –                              | –  | –  | 1.230.000                                   | 620.000                       | –  | –                           |
| Antizipative Passiva  |      | 1.444.668                   | 110.464                        | 137.524  | 1.942.402                                  | 810.142                                     | 423.861                       | 53.358   | 133.130                     |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen  |      | 1.737                       | –                              | 22.664   | 170.068                                    | 2.425.802                                   | 124                           | 48.146   | 1.862.048                   |
| Sonstige Verbindlichkeiten  |      | 88.280                      | 6.614                          | 21.169   | 1.137.613                                  | 1.448.191                                   | 438.310                       | 34.767   | 1.310.812                   |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b> |      | <b>32.333.996</b>           | <b>186.525</b>                 | <b>2.753.737</b>   | <b>35.543.790</b>                          | <b>43.776.061</b>                           | <b>18.658.184</b>             | <b>1.710.081</b>   | <b>6.182.549</b>            |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                             |      | <b>2.343.291.272</b>        | <b>127.389.193</b>             | <b>113.720.628</b>   | <b>2.704.438.594</b>                       | <b>1.076.381.052</b>                        | <b>516.308.152</b>            | <b>57.496.708</b>  | <b>104.565.095</b>          |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Bilanzen (Fortsetzung)

|   | Anm. | Euro Bond         | Euro Bond         | European High      | European           | Event Driven       | Global Bond        | Global Diversified | Global Equity      |
|---|------|-------------------|-------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|
|   |      | Zum               | Absolute Return   | Yield Bond         | Sustainable Equity |                    |                    | Income FMP –       | Megatrends         |
|   |      | 31. Dezember      | Zum               | Zum                | Zum                | Zum                | Zum                | Zum                | Zum                |
|   |      | 2024              | 31. Dezember      | 31. Dezember       | 31. Dezember       | 31. Dezember       | 31. Dezember       | 31. Dezember       | 31. Dezember       |
|   |      | EUR               | 2024              | 2024               | 2024               | 2024               | 2024               | 2024*              | 2024               |
|   |      |                   | EUR               | EUR                | EUR                | US\$               | US\$               | US\$               | US\$               |
| <b>Umlaufvermögen</b>   |      |                   |                   |                    |                    |                    |                    |                    |                    |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                      | 2    | 67.891.337        | 84.182.501        | 536.888.271        | 147.238.159        | 277.416.651        | 101.649.330        | –                  | 493.491.183        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 3    | 410.347           | 1.875.873         | 17.956.780         | 1.335.361          | 24.610.182         | 4.741.796          | 48.338             | 25.068.050         |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen   |      | –                 | –                 | –                  | –                  | –                  | 420                | –                  | 1.290              |
| Forderungen aus ausgegebenen Anteilen   |      | 952.497           | 1.597.580         | 323.577            | 319                | 209.238            | 2.719              | –                  | 3.521.985          |
| Forderungen gegenüber Brokern   |      | 830.152           | 649.932           | –                  | –                  | –                  | 345.486            | –                  | –                  |
| Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen   |      | 912.311           | 1.144.017         | 9.014.875          | 70.994             | 1.556.031          | 942.613            | –                  | 752.863            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   |      | <b>70.996.644</b> | <b>89.449.903</b> | <b>564.183.503</b> | <b>148.644.833</b> | <b>303.792.102</b> | <b>107.682.364</b> | <b>48.338</b>      | <b>522.835.371</b> |
| <b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>   |      |                   |                   |                    |                    |                    |                    |                    |                    |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                   | 2    | 472.428           | 481.571           | 2.086.588          | –                  | 10.635.095         | 4.754.150          | –                  | 249.051            |
| Kontenüberziehung   | 4    | –                 | 2.588             | –                  | –                  | –                  | –                  | –                  | –                  |
| Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen   |      | 51.949            | –                 | 245.648            | 71.248             | 22.062             | 1.110.265          | –                  | 3.257.185          |
| Antizipative Passiva  |      | 46.176            | 38.646            | 158.226            | 68.443             | 172.078            | 56.326             | 33.683             | 618.229            |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen  |      | –                 | 368.133           | 847.620            | –                  | 5.257.640          | –                  | –                  | 80.170             |
| Sonstige Verbindlichkeiten  |      | 25.559            | 36.791            | 91.867             | 5.109              | 3.708.536          | 19.365             | 14.655             | 6.109              |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b> |      | <b>596.112</b>    | <b>927.729</b>    | <b>3.429.949</b>   | <b>144.800</b>     | <b>19.795.411</b>  | <b>5.940.106</b>   | <b>48.338</b>      | <b>4.210.744</b>   |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                             |      | <b>70.400.532</b> | <b>88.522.174</b> | <b>560.753.554</b> | <b>148.500.033</b> | <b>283.996.691</b> | <b>101.742.258</b> | <b>–</b>           | <b>518.624.627</b> |

\* Der Global Diversified Income FMP – 2024 wurde am 28. Juni 2024 aufgelöst.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Bilanzen (Fortsetzung)

|   | Anm. | Global Flexible    | Global High Yield  | Global Investment  | Global             | Global Real Estate | Global Sustainable | Global Value      | High Yield Bond      |
|---|------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|-------------------|----------------------|
|   |      | Credit Income      | Engagement         | Grade Credit       | Opportunistic Bond | Securities         | Equity             |                   |                      |
|   |      | Zum                 Zum                  |
|   |      | 31. Dezember        31. Dezember         |
|   |      | 2024               | 2024               | 2024               | 2024               | 2024*              | 2024               | 2024              | 2024                 |
|   |      | US\$                US\$                 |
| <b>Umlaufvermögen</b>   |      |                    |                    |                    |                    |                    |                    |                   |                      |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                      | 2    | 447.943.921        | 622.570.645        | 176.028.163        | 65.520.812         | 7.820              | 139.635.830        | 46.744.199        | 1.935.380.637        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 3    | 6.639.688          | 6.987.154          | 5.007.265          | 5.289.493          | 14.636.189         | 1.162.126          | 820.266           | 11.279.907           |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen   |      | 7.836              | 769                | –                  | –                  | –                  | –                  | 196.910           | 6.140.294            |
| Forderungen aus ausgegebenen Anteilen   |      | 430.700            | 29.273             | –                  | 267.088            | –                  | 6.645              | 94.834            | 3.886.493            |
| Forderungen gegenüber Brokern   |      | 3.049.931          | 187.302            | –                  | 1.735.251          | –                  | –                  | –                 | –                    |
| Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen   |      | 6.565.399          | 10.688.878         | 2.575.020          | 1.088.237          | 29.940             | 56.045             | 56.118            | 33.031.793           |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   |      | <b>464.637.475</b> | <b>640.464.021</b> | <b>183.610.448</b> | <b>73.900.881</b>  | <b>14.673.949</b>  | <b>140.860.646</b> | <b>47.912.327</b> | <b>1.989.719.124</b> |
| <b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>   |      |                    |                    |                    |                    |                    |                    |                   |                      |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                   | 2    | 13.166.815         | 18.389.347         | 3.686.902          | 4.305.961          | 65.379             | –                  | 106.217           | 64.275.373           |
| Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen   |      | 32.072             | 6.873.976          | –                  | 1.219.109          | 14.498.645         | 362.642            | 1.086.210         | 7.725.209            |
| Antizipative Passiva  |      | 254.509            | 255.078            | 46.388             | 57.076             | 67.477             | 65.208             | 51.971            | 1.976.609            |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen  |      | 6.275.354          | 1.350.611          | –                  | –                  | 99                 | 5                  | –                 | 16.423.696           |
| Sonstige Verbindlichkeiten  |      | 48.457             | 29.028             | 6.242              | 429.913            | 42.349             | 8.096              | 22.153            | 110.299              |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b> |      | <b>19.777.207</b>  | <b>26.898.040</b>  | <b>3.739.532</b>   | <b>6.012.059</b>   | <b>14.673.949</b>  | <b>435.951</b>     | <b>1.266.551</b>  | <b>90.511.186</b>    |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                             |      | <b>444.860.268</b> | <b>613.565.981</b> | <b>179.870.916</b> | <b>67.888.822</b>  | <b>–</b>           | <b>140.424.695</b> | <b>46.645.776</b> | <b>1.899.207.938</b> |

\* Der Global Real Estate Securities wurde am 31. Dezember 2024 aufgelöst.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Bilanzen (Fortsetzung)

| Anm.  | InnovAsia                           | Japan Equity Engagement            | Macro Opportunities FX               | Next Generation Connectivity        | Next Generation Mobility            | Next Generation Space Economy       | Short Duration Emerging Market Debt | Short Duration Euro Bond           |                      |
|---|-------------------------------------|------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|------------------------------------|----------------------|
|   | Zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ | Zum<br>31. Dezember<br>2024<br>JPY | Zum<br>31. Dezember<br>2024 *<br>EUR | Zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ | Zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ | Zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ | Zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ | Zum<br>31. Dezember<br>2024<br>EUR |                      |
| <b>Umlaufvermögen</b>   |                                     |                                    |                                      |                                     |                                     |                                     |                                     |                                    |                      |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                      | 2                                   | 14.231.195                         | 24.002.292.370                       | –                                   | 1.042.613.116                       | 121.439.134                         | 55.202.739                          | 3.768.732.316                      | 1.780.693.407        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 3                                   | 477.487                            | 92.230.065                           | 35.694                              | 37.005.389                          | 2.094.616                           | 3.106.933                           | 21.417.061                         | 79.541.949           |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen   |                                     | –                                  | 113.021.299                          | –                                   | –                                   | –                                   | 86.116                              | 532.285                            | 86.052               |
| Forderungen aus ausgegebenen Anteilen   |                                     | –                                  | 1.563.851                            | –                                   | 3.856.066                           | 99.993                              | 825.763                             | 8.632.898                          | 8.112.743            |
| Forderungen gegenüber Brokern   |                                     | –                                  | –                                    | –                                   | –                                   | –                                   | –                                   | –                                  | 6.372.371            |
| Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen   |                                     | 49.145                             | 52.794.520                           | 17                                  | 213.130                             | 41.038                              | 3.419                               | 54.471.412                         | 25.351.820           |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   |                                     | <b>14.757.827</b>                  | <b>24.261.902.105</b>                | <b>35.711</b>                       | <b>1.083.687.701</b>                | <b>123.674.781</b>                  | <b>59.224.970</b>                   | <b>3.853.785.972</b>               | <b>1.900.158.342</b> |
| <b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>   |                                     |                                    |                                      |                                     |                                     |                                     |                                     |                                    |                      |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                   | 2                                   | 452.531                            | 132.669                              | –                                   | 12.934.421                          | 12.261                              | –                                   | 68.781.224                         | 4.991.252            |
| Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen   |                                     | 14.175                             | 15.208.072                           | –                                   | 2.451.716                           | 310.022                             | 937                                 | 1.504.522                          | 2.376.493            |
| Verbindlichkeiten gegenüber dem Makler  |                                     | –                                  | –                                    | –                                   | –                                   | –                                   | –                                   | 2.100.000                          | –                    |
| Antizipative Passiva  |                                     | 41.564                             | 12.595.228                           | 13.733                              | 1.476.484                           | 205.782                             | 94.654                              | 2.159.817                          | 427.581              |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen  |                                     | –                                  | –                                    | –                                   | 3.595.501                           | 339.876                             | 246.557                             | 3.361.500                          | 11.477.606           |
| Sonstige Verbindlichkeiten  |                                     | 110.519                            | 1.330.542                            | 21.978                              | 45.617                              | 13.340                              | 18.603                              | 203.623                            | 263.028              |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b> |                                     | <b>618.789</b>                     | <b>29.266.511</b>                    | <b>35.711</b>                       | <b>20.503.739</b>                   | <b>881.281</b>                      | <b>360.751</b>                      | <b>78.110.686</b>                  | <b>19.535.960</b>    |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                             |                                     | <b>14.139.038</b>                  | <b>24.232.635.594</b>                | <b>–</b>                            | <b>1.063.183.962</b>                | <b>122.793.500</b>                  | <b>58.864.219</b>                   | <b>3.775.675.286</b>               | <b>1.880.622.382</b> |

\* Der Macro Opportunities FX wurde am 8. Februar 2024 aufgelöst.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Bilanzen (Fortsetzung)

|   | Anm. | Short Duration<br>High Yield<br>Engagement | Strategic Income                    | Sustainable Asia<br>High Yield      | Sustainable<br>Emerging Market<br>Debt - Hard<br>Currency | Tactical Macro                      | Uncorrelated<br>Strategies          | US Equity                           | US Equity Premium                   |
|---|------|--|-------------------------------------|-------------------------------------|---|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
|   |      | Zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$        | Zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ | Zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ | Zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$                       | Zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ | Zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ | Zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ | Zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ |
| <b>Umlaufvermögen</b>   |      |  |                                     |                                     |   |                                     |                                     |                                     |                                     |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                      | 2    | 560.976.422                                | 4.649.819.191                       | 29.387.420                          | 590.365.810   | 33.703.237                          | 572.847.491                         | 106.724.722                         | 634.613.512                         |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 3    | 2.746.504                                  | 155.822.200                         | 2.032.201                           | 7.048.460   | 2.804.175                           | 148.249.077                         | 2.213.740                           | 44.525.390                          |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen   |      | 3.294.578                                  | 144.197.474                         | –                                   | –   | –                                   | 28.566.551                          | –                                   | 1.216.811                           |
| Forderungen aus ausgegebenen Anteilen   |      | 2.975.508                                  | 72.279.316                          | 15                                  | –   | –                                   | 636.004                             | 217.595                             | 320.149                             |
| Forderungen gegenüber Brokern   |      | –  | 6.262.842                           | 90.851                              | 6.404.490   | 164.282                             | 240.481.867                         | –                                   | –                                   |
| Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen   |      | 8.576.337                                  | 33.144.959                          | 385.473                             | 10.181.719  | 34.525                              | 1.453.257                           | 33.166                              | 6.042.030                           |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   |      | <b>578.569.349</b>                         | <b>5.061.525.982</b>                | <b>31.895.960</b>                   | <b>614.000.479</b>  | <b>36.706.219</b>                   | <b>992.234.247</b>                  | <b>109.189.223</b>                  | <b>686.717.892</b>                  |
| <b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>   |      |  |                                     |                                     |   |                                     |                                     |                                     |                                     |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                   | 2    | 22.583.571                                 | 83.459.279                          | 14.055                              | 15.112.098  | 630.576                             | 147.432.620                         | 1.588.964                           | 21.989.254                          |
| Kontenüberziehung   | 4    | –  | 463                                 | –                                   | –   | 45.930                              | –                                   | –                                   | –                                   |
| Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen   |      | 5.951.410                                  | 12.241.050                          | –                                   | 6.815   | –                                   | 513.667                             | 424.580                             | 1.535.646                           |
| Verbindlichkeiten gegenüber dem Makler  |      | –  | –                                   | –                                   | –   | –                                   | 3.308.087                           | –                                   | –                                   |
| Antizipative Passiva  |      | 425.489                                    | 3.893.907                           | 31.071                              | 255.594   | 22.420                              | 547.081                             | 102.769                             | 307.683                             |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen  |      | 4.254.997                                  | 324.842.594                         | –                                   | 45  | –                                   | 28.275.138                          | –                                   | 3.817.007                           |
| Sonstige Verbindlichkeiten  |      | 39.687                                     | 258.547                             | 6.433                               | 34.945  | 4.527                               | 5.316.229                           | 5.875                               | 24.308                              |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b> |      | <b>33.255.154</b>                          | <b>424.695.840</b>                  | <b>51.559</b>                       | <b>15.409.497</b>   | <b>703.453</b>                      | <b>185.392.822</b>                  | <b>2.122.188</b>                    | <b>27.673.898</b>                   |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                             |      | <b>545.314.195</b>                         | <b>4.636.830.142</b>                | <b>31.844.401</b>                   | <b>598.590.982</b>  | <b>36.002.766</b>                   | <b>806.841.425</b>                  | <b>107.067.035</b>                  | <b>659.043.994</b>                  |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Bilanzen (Fortsetzung)

|   | Anm. | US Large Cap Value                  | US Long Short Equity                | US Multi Cap Opportunities          | US Real Estate Securities           | US Small Cap                        | US Small Cap Intrinsic Value        | Fonds insgesamt*                    |
|---|------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
|   |      | Zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ | Zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ | Zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ | Zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ | Zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ | Zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ | Zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ |
| <b>Umlaufvermögen</b>   |      |                                     |                                     |                                     |                                     |                                     |                                     |                                     |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                      | 2    | 997.346.983                         | 199.844.322                         | 388.442.193                         | 433.810.892                         | 875.192.956                         | 395.303.562                         | 30.818.264.823                      |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 3    | 18.040.618                          | 26.581.969                          | 806.605                             | 8.961.067                           | 12.573.801                          | 6.028.304                           | 994.780.760                         |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen   |      | 7.553.194                           | 46.447                              | 3.106                               | –                                   | 713.773                             | –                                   | 200.852.687                         |
| Forderungen aus ausgegebenen Anteilen   |      | 1.444.965                           | 1.030.082                           | 1.802.326                           | 704.892                             | 4.683.332                           | 195.808                             | 128.750.627                         |
| Forderungen gegenüber Brokern   |      | –                                   | 6.455.750                           | –                                   | –                                   | –                                   | –                                   | 312.843.881                         |
| Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen   |      | 1.031.016                           | 131.971                             | 115.825                             | 1.142.816                           | 296.755                             | 165.489                             | 370.224.787                         |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   |      | <b>1.025.416.776</b>                | <b>234.090.541</b>                  | <b>391.170.055</b>                  | <b>444.619.667</b>                  | <b>893.460.617</b>                  | <b>401.693.163</b>                  | <b>32.825.717.565</b>               |
| <b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>   |      |                                     |                                     |                                     |                                     |                                     |                                     |                                     |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                   | 2    | 1.856.005                           | 6.731.578                           | 3.544.061                           | 4.322.763                           | 1.942.634                           | 547.761                             | 647.870.727                         |
| Kontenüberziehung   | 4    | –                                   | –                                   | 5.445                               | –                                   | –                                   | –                                   | 56.914                              |
| Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen   |      | 737.915                             | 118.374                             | 1.179.712                           | 2.410.774                           | 1.381.897                           | 379.467                             | 82.234.772                          |
| Verbindlichkeiten gegenüber dem Makler  |      | –                                   | –                                   | –                                   | –                                   | –                                   | –                                   | 7.258.087                           |
| Antizipative Passiva  |      | 713.169                             | 288.373                             | 525.333                             | 765.056                             | 953.193                             | 337.392                             | 23.785.977                          |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen  |      | 3.641.361                           | 388                                 | –                                   | 710.343                             | 451.755                             | 44                                  | 501.742.338                         |
| Sonstige Verbindlichkeiten  |      | 38.145                              | 439.751                             | 30.712                              | 37.214                              | 192.716                             | 15.274                              | 28.807.250                          |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b> |      | <b>6.986.595</b>                    | <b>7.578.464</b>                    | <b>5.285.263</b>                    | <b>8.246.150</b>                    | <b>4.922.195</b>                    | <b>1.279.938</b>                    | <b>1.291.756.065</b>                |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                             |      | <b>1.018.430.181</b>                | <b>226.512.077</b>                  | <b>385.884.792</b>                  | <b>436.373.517</b>                  | <b>888.538.422</b>                  | <b>400.413.225</b>                  | <b>31.533.961.500</b>               |

Direktor:  
Naomi Daly

Direktor:  
Gráinne Alexander

Datum: 16. April 2025

Datum: 16. April 2025

\* Der konsolidierte Abschluss wurde um im Namen des Fonds gehaltener Salden und um Überkreuzinvestitionen zwischen den Portfolios bereinigt. Angaben zu den Kassenbeständen des Fonds sind Anmerkung 3 der Anmerkungen zum geprüften Jahresabschluss zu entnehmen. Details zu Überkreuzinvestitionen zwischen Portfolios sind Anmerkung 10 der Anmerkungen zum geprüften Jahresabschluss zu entnehmen.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Bilanzen (Fortsetzung)

|   |      | Absolute Return<br>Multi Strategy | Asia Responsible<br>Transition Bond | China A-Share<br>Equity     | China Bond                  | China Equity                | Climate Innovation          | CLO Income                  | Commodities                 |
|---|------|-----------------------------------|-------------------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
|   | Anm. | Zum<br>31. Dezember<br>2023*      | Zum<br>31. Dezember<br>2023         | Zum<br>31. Dezember<br>2023 | Zum<br>31. Dezember<br>2023 | Zum<br>31. Dezember<br>2023 | Zum<br>31. Dezember<br>2023 | Zum<br>31. Dezember<br>2023 | Zum<br>31. Dezember<br>2023 |
|   |      | US\$                              | US\$                                | CNY                         | CNY                         | US\$                        | US\$                        | US\$                        | US\$                        |
| <b>Umlaufvermögen</b>   |      |                                   |                                     |                             |                             |                             |                             |                             |                             |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                      | 2    | 6.311                             | 60.597.643                          | 13.480.937                  | 447.117.129                 | 172.463.571                 | 2.831.398                   | 179.297.062                 | 122.546.345                 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 3    | 98.859                            | 2.708.868                           | 1.074.845                   | 9.446.611                   | 6.017.190                   | 83.875                      | 12.287.210                  | 33.206.631                  |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen   |      | 737                               | –                                   | 26.607                      | –                           | 908.831                     | 27.029                      | –                           | 306                         |
| Forderungen aus ausgegebenen Anteilen   |      | –                                 | –                                   | –                           | –                           | –                           | –                           | –                           | 589.538                     |
| Forderungen gegenüber Brokern   |      | –                                 | 128.088                             | –                           | 682.867                     | –                           | –                           | –                           | 7.330.000                   |
| Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen   |      | 1.078                             | 850.351                             | 192.783                     | 5.178.845                   | 92.331                      | 14.640                      | 3.974.020                   | 662.121                     |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   |      | 106.985                           | 64.284.950                          | 14.775.172                  | 462.425.452                 | 179.481.923                 | 2.956.942                   | 195.558.292                 | 164.334.941                 |
| <b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>   |      |                                   |                                     |                             |                             |                             |                             |                             |                             |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                   | 2    | –                                 | 263.464                             | –                           | 2.361.945                   | 423.344                     | –                           | 2.570.754                   | 210.126                     |
| Kontenüberziehung   | 4    | –                                 | –                                   | –                           | –                           | –                           | –                           | –                           | –                           |
| Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen   |      | –                                 | 14.879                              | –                           | 637.738                     | 561.527                     | –                           | –                           | 90.830                      |
| Antizipative Passiva  |      | 11.217                            | 50.885                              | 359.457                     | 422.278                     | 244.205                     | 3.183                       | 149.265                     | 135.790                     |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen  |      | –                                 | –                                   | 150.009                     | 606                         | 451                         | 27.707                      | 7.173.352                   | 10.239.576                  |
| Sonstige Verbindlichkeiten  |      | 95.768                            | 13.858                              | 51.874                      | 156.777                     | 26.109                      | 3.497                       | 18.616                      | 12.060                      |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b> |      | 106.985                           | 343.086                             | 561.340                     | 3.579.344                   | 1.255.636                   | 34.387                      | 9.911.987                   | 10.688.382                  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                             |      | –                                 | 63.941.864                          | 14.213.832                  | 458.846.108                 | 178.226.287                 | 2.922.555                   | 185.646.305                 | 153.646.559                 |

\* Der Absolute Return Multi Strategy wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Bilanzen (Fortsetzung)

| Anm.  | Corporate Hybrid Bond | Developed Market FMP – 2027 | EMD Corporate – Social and Environmental Transition | Emerging Market Debt - Hard Currency | Emerging Market Debt - Local Currency | Emerging Market Debt Blend | Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend | Emerging Markets Equity |                   |
|---|-----------------------|-----------------------------|---|--------------------------------------|---------------------------------------|----------------------------|---|-------------------------|-------------------|
|   | Zum 31.Dezember 2023  | Zum 31. Dezember 2023       | Zum 31.Dezember 2023                                | Zum 31. Dezember 2023                | Zum 31. Dezember 2023                 | Zum 31. Dezember 2023      | Zum 31. Dezember 2023                                   | Zum 31. Dezember 2023   |                   |
|   | EUR                   | US\$                        | US\$  | US\$                                 | US\$                                  | US\$                       | US\$  | US\$                    |                   |
| <b>Umlaufvermögen</b>   |                       |                             |   |                                      |                                       |                            |   |                         |                   |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                      | 2                     | 1.766.641.213               | 135.817.055   | 92.566.505                           | 2.588.612.804                         | 1.244.671.584              | 504.428.604   | 61.503.601              | 89.056.214        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 3                     | 79.423.824                  | 503.437   | 3.976.271                            | 2.306.275                             | 34.899.630                 | 15.095.815  | 2.754.078               | 3.296.182         |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen   |                       | 1.744                       | –   | –                                    | 23.722                                | 838                        | 252.512   | 20.345                  | 194               |
| Forderungen aus ausgegebenen Anteilen   |                       | 7.249.268                   | –   | 30.010                               | 8.718.437                             | 1.094.199                  | 178.023   | 1.182                   | 25.864            |
| Forderungen gegenüber Brokern   |                       | –                           | –   | 425.554                              | 22.175.962                            | 16.010.321                 | 7.902.696   | 679.691                 | –                 |
| Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen   |                       | 30.551.766                  | 1.479.818   | 1.463.373                            | 55.368.515                            | 25.831.472                 | 10.166.996  | 915.984                 | 271.103           |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   |                       | <b>1.883.867.815</b>        | <b>137.800.310</b>                                  | <b>98.461.713</b>                    | <b>2.677.205.715</b>                  | <b>1.322.508.044</b>       | <b>538.024.646</b>                                      | <b>65.874.881</b>       | <b>92.649.557</b> |
| <b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>   |                       |                             |   |                                      |                                       |                            |   |                         |                   |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                   | 2                     | 7.732.130                   | 393   | 472.118                              | 15.874.903                            | 27.976.015                 | 8.849.676   | 679.582                 | 787.152           |
| Kontenüberziehung   | 4                     | –                           | –   | –                                    | 31.716                                | –                          | –   | –                       | –                 |
| Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen   |                       | 5.064.442                   | 239.940   | 28.695                               | 8.966.177                             | 781.709                    | 500.516   | –                       | 128.823           |
| Verbindlichkeiten gegenüber dem Makler  |                       | –                           | –   | –                                    | –                                     | 2.230.000                  | 390.000   | –                       | –                 |
| Antizipative Passiva  |                       | 1.188.602                   | 100.867   | 146.162                              | 1.919.504                             | 1.023.619                  | 449.175   | 70.618                  | 142.423           |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen  |                       | –                           | 35  | –                                    | –                                     | –                          | 393   | 243                     | 409.316           |
| Sonstige Verbindlichkeiten  |                       | 66.178                      | 1.256   | 25.601                               | 594.760                               | 4.629.054                  | 1.047.079   | 56.889                  | 494.342           |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b> |                       | <b>14.051.352</b>           | <b>342.491</b>                                      | <b>672.576</b>                       | <b>27.387.060</b>                     | <b>36.640.397</b>          | <b>11.236.839</b>                                       | <b>807.332</b>          | <b>1.962.056</b>  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                             |                       | <b>1.869.816.463</b>        | <b>137.457.819</b>                                  | <b>97.789.137</b>                    | <b>2.649.818.655</b>                  | <b>1.285.867.647</b>       | <b>526.787.807</b>                                      | <b>65.067.549</b>       | <b>90.687.501</b> |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Bilanzen (Fortsetzung)

|   |      | Emerging Markets<br>Select Equity | Euro Bond                   | Euro Bond<br>Absolute Return | European High<br>Yield Bond | European<br>Sustainable Equity | Event Driven                | Global Bond                 | Global Diversified<br>Income FMP –<br>2024 |
|---|------|-----------------------------------|-----------------------------|------------------------------|-----------------------------|--------------------------------|-----------------------------|-----------------------------|--|
|   | Anm. | Zum<br>31. Dezember<br>2023*      | Zum<br>31. Dezember<br>2023 | Zum<br>31. Dezember<br>2023  | Zum<br>31. Dezember<br>2023 | Zum<br>31. Dezember<br>2023    | Zum<br>31. Dezember<br>2023 | Zum<br>31. Dezember<br>2023 | Zum<br>31. Dezember<br>2023                |
|   |      | US\$                              | EUR                         | EUR                          | EUR                         | EUR                            | US\$                        | US\$                        | US\$                                       |
| <b>Umlaufvermögen</b>   |      |                                   |                             |                              |                             |                                |                             |                             |  |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                      | 2    | –                                 | 10.219.503                  | 33.385.909                   | 387.635.250                 | 171.225.790                    | 120.057.191                 | 111.175.172                 | 144.239.599                                |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 3    | 163.972                           | 127.676                     | 460.317                      | 16.624.528                  | 1.127.268                      | 13.500.176                  | 1.162.072                   | 11.026.949                                 |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen   |      | –                                 | –                           | –                            | 10                          | 1.032.578                      | 253                         | –                           | –  |
| Forderungen aus ausgegebenen Anteilen   |      | –                                 | –                           | –                            | 102.548                     | 443                            | 441.776                     | 240                         | –  |
| Forderungen gegenüber Brokern   |      | –                                 | 217.984                     | 1.822.858                    | –                           | –                              | –                           | 802.148                     | –  |
| Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen   |      | 20.832                            | 145.715                     | 473.859                      | 6.544.828                   | 120.283                        | 10.722                      | 1.061.825                   | 1.098.172                                  |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   |      | <b>184.804</b>                    | <b>10.710.878</b>           | <b>36.142.943</b>            | <b>410.907.164</b>          | <b>173.506.362</b>             | <b>134.010.118</b>          | <b>114.201.457</b>          | <b>156.364.720</b>                         |
| <b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>   |      |                                   |                             |                              |                             |                                |                             |                             |  |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                   | 2    | –                                 | 81.140                      | 1.615.336                    | 1.281.452                   | –                              | 155.365                     | 3.890.491                   | –  |
| Kontenüberziehung   | 4    | –                                 | –                           | 412.247                      | –                           | 42                             | –                           | –                           | 13   |
| Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen   |      | –                                 | –                           | –                            | 98.287                      | 1.292.679                      | 161.583                     | 14.939                      | –  |
| Antizipative Passiva  |      | 47.821                            | 42.325                      | 47.082                       | 110.226                     | 84.070                         | 79.389                      | 80.067                      | 123.837                                    |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen  |      | –                                 | –                           | –                            | 963.852                     | 1.639                          | 5.896.768                   | 1.438.589                   | –  |
| Sonstige Verbindlichkeiten  |      | 136.983                           | 14.319                      | 41.451                       | 37.030                      | 30.381                         | 1.304.865                   | 34.571                      | 41.217                                     |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b> |      | <b>184.804</b>                    | <b>137.784</b>              | <b>2.116.116</b>             | <b>2.490.847</b>            | <b>1.408.811</b>               | <b>7.597.970</b>            | <b>5.458.657</b>            | <b>165.067</b>                             |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                             |      | <b>–</b>                          | <b>10.573.094</b>           | <b>34.026.827</b>            | <b>408.416.317</b>          | <b>172.097.551</b>             | <b>126.412.148</b>          | <b>108.742.800</b>          | <b>156.199.653</b>                         |

\* Der Emerging Markets Select Equity wurde am 7. September 2023 aufgelöst.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Bilanzen (Fortsetzung)

| Anm.  | Global Equity<br>Megatrends        | Global Flexible<br>Credit Income   | Global High Yield<br>Engagement     | Global High Yield<br>Sustainable Action | Global Investment<br>Grade Credit   | Global<br>Opportunistic<br>Bond     | Global Real Estate<br>Securities    | Global Sustainable<br>Equity        |                    |
|---|------------------------------------|------------------------------------|-------------------------------------|---|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|--------------------|
|   | Zum<br>31.Dezember<br>2023<br>US\$ | Zum<br>31.Dezember<br>2023<br>US\$ | Zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$ | Zum<br>31. Dezember<br>2023*<br>US\$    | Zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$ | Zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$ | Zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$ | Zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$ |                    |
| <b>Umlaufvermögen</b>   |                                    |                                    |                                     |   |                                     |                                     |                                     |                                     |                    |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                      | 2                                  | 141.493.045                        | 368.099.040                         | 544.440.088                             | –                                   | 83.459.890                          | 70.656.593                          | 20.510.136                          | 153.603.419        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 3                                  | 5.262.402                          | 25.482.094                          | 10.709.205                              | 52.318                              | 3.401.463                           | 1.529.454                           | 211.649                             | 781.170            |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen   |                                    | 1.620                              | –                                   | 820.711                                 | –                                   | –                                   | 110.692                             | –                                   | 618.618            |
| Forderungen aus ausgegebenen Anteilen   |                                    | 788.588                            | 435.297                             | 187.598                                 | –                                   | –                                   | 19.690                              | 12.500                              | 159.181            |
| Forderungen gegenüber Brokern   |                                    | –                                  | 3.225.584                           | –                                       | –                                   | –                                   | 1.153.721                           | –                                   | –                  |
| Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen   |                                    | 273.742                            | 5.792.332                           | 9.463.589                               | 1                                   | 1.093.184                           | 732.900                             | 102.538                             | 72.293             |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   |                                    | <b>147.819.397</b>                 | <b>403.034.347</b>                  | <b>565.621.191</b>                      | <b>52.319</b>                       | <b>87.954.537</b>                   | <b>74.203.050</b>                   | <b>20.836.823</b>                   | <b>155.234.681</b> |
| <b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>   |                                    |                                    |                                     |   |                                     |                                     |                                     |                                     |                    |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                   | 2                                  | –                                  | 8.620.881                           | 6.738.234                               | –                                   | 1.107.450                           | 7.756.007                           | 250.684                             | –                  |
| Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen   |                                    | 3.100.333                          | 1.835.312                           | 345.199                                 | –                                   | –                                   | –                                   | 54.826                              | 9.808              |
| Verbindlichkeiten gegenüber dem Makler  |                                    | –                                  | 200.000                             | –                                       | –                                   | –                                   | –                                   | –                                   | –                  |
| Antizipative Passiva  |                                    | 224.956                            | 238.837                             | 244.147                                 | 29.617                              | 46.561                              | 72.646                              | 58.316                              | 77.887             |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen  |                                    | –                                  | 1.500.862                           | 97.458                                  | –                                   | –                                   | 911.501                             | 1                                   | 540.903            |
| Sonstige Verbindlichkeiten  |                                    | 11.252                             | 25.474                              | 32.248                                  | 22.702                              | 22.701                              | 53.133                              | 12.983                              | 32.788             |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b> |                                    | <b>3.336.541</b>                   | <b>12.421.366</b>                   | <b>7.457.286</b>                        | <b>52.319</b>                       | <b>1.176.712</b>                    | <b>8.793.287</b>                    | <b>376.810</b>                      | <b>661.386</b>     |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                             |                                    | <b>144.482.856</b>                 | <b>390.612.981</b>                  | <b>558.163.905</b>                      | <b>–</b>                            | <b>86.777.825</b>                   | <b>65.409.763</b>                   | <b>20.460.013</b>                   | <b>154.573.295</b> |

\* Der Global High Yield Sustainable Action wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Bilanzen (Fortsetzung)

| Anm.  | Global Value               | High Yield Bond            | InnovAsia                   | Japan Equity Engagement     | Macro Opportunities FX      | Multi-Asset Income            | Next Generation Connectivity | Next Generation Mobility    |             |
|---|----------------------------|----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-------------------------------|------------------------------|-----------------------------|-------------|
|   | Zum<br>31.Dezember<br>2023 | Zum<br>31.Dezember<br>2023 | Zum<br>31. Dezember<br>2023 | Zum<br>31. Dezember<br>2023 | Zum<br>31. Dezember<br>2023 | Zum<br>31. Dezember<br>2023 * | Zum<br>31.Dezember<br>2023   | Zum<br>31. Dezember<br>2023 |             |
|   | US\$                       | US\$                       | US\$                        | JPY                         | EUR                         | US\$                          | US\$                         | US\$                        |             |
| <b>Umlaufvermögen</b>   |                            |                            |                             |                             |                             |                               |                              |                             |             |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                      | 2                          | 54.991.923                 | 2.133.705.667               | 22.824.022                  | 16.090.377.079              | 7.381.837                     | –                            | 996.857.530                 | 152.835.153 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 3                          | 544.936                    | 73.617.932                  | 1.128.943                   | 90.965.141                  | 126.875                       | 58.916                       | 43.643.862                  | 11.689.060  |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen   |                            | –                          | 27.132.212                  | –                           | –                           | –                             | –                            | 11.966.904                  | 415.564     |
| Forderungen aus ausgegebenen Anteilen   |                            | 20.869                     | 8.426.020                   | –                           | 9.477.834                   | 22.386                        | –                            | 871.569                     | 323.006     |
| Forderungen gegenüber Brokern   |                            | –                          | –                           | –                           | –                           | –                             | –                            | –                           | –           |
| Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen   |                            | 84.087                     | 37.739.993                  | 20.417                      | 43.887.262                  | 17.813                        | 231                          | 360.533                     | 69.192      |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   |                            | 55.641.815                 | 2.280.621.824               | 23.973.382                  | 16.234.707.316              | 7.548.911                     | 59.147                       | 1.053.700.398               | 165.331.975 |
| <b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>   |                            |                            |                             |                             |                             |                               |                              |                             |             |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                   | 2                          | 46.897                     | 15.443.334                  | 60.136                      | 42.002.252                  | 4.613.695                     | –                            | 1.033.321                   | 10.365      |
| Kontenüberziehung   | 4                          | –                          | –                           | 6.560                       | 69.286                      | –                             | –                            | 68                          | –           |
| Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen   |                            | 17.218                     | 4.565.230                   | 16.084                      | 2.684.590                   | 4.194                         | –                            | 5.027.207                   | 486.682     |
| Antizipative Passiva  |                            | 65.609                     | 2.119.832                   | 54.304                      | 11.646.832                  | 33.119                        | 39.739                       | 1.457.148                   | 276.843     |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen  | 6                          | 6                          | 6.528.399                   | 86                          | –                           | 44                            | –                            | 2.582.227                   | 179.180     |
| Sonstige Verbindlichkeiten  |                            | 46.191                     | 154.310                     | 66.092                      | 775.641                     | 16.053                        | 19.408                       | 73.484                      | 22.840      |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b> |                            | 175.921                    | 28.811.105                  | 203.262                     | 57.178.601                  | 4.667.105                     | 59.147                       | 10.173.455                  | 975.910     |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                             |                            | 55.465.894                 | 2.251.810.719               | 23.770.120                  | 16.177.528.715              | 2.881.806                     | –                            | 1.043.526.943               | 164.356.065 |

\* Der Multi-Asset Income wurde am 6. Juli 2023 aufgelöst.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Bilanzen (Fortsetzung)

|   |      | Next Generation<br>Space Economy   | Short Duration<br>Emerging Market<br>Debt | Short Duration<br>Euro Bond       | Short Duration<br>High Yield<br>Engagement | Strategic Income                    | Sustainable Asia<br>High Yield      | Sustainable<br>Emerging Market<br>Debt - Hard<br>Currency | Tactical Macro                      |
|---|------|------------------------------------|---|-----------------------------------|--|-------------------------------------|-------------------------------------|---|-------------------------------------|
|   | Anm. | Zum<br>31.Dezember<br>2023<br>US\$ | Zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$       | Zum<br>31.Dezember<br>2023<br>EUR | Zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$        | Zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$ | Zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$ | Zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$                       | Zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$ |
| <b>Umlaufvermögen</b>   |      |                                    |   |                                   |  |                                     |                                     |   |                                     |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                      | 2    | 18.674.716                         | 3.882.376.064                             | 965.478.305                       | 692.929.732                                | 2.163.075.623                       | 26.910.034                          | 432.174.496   | 23.429.706                          |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 3    | 943.288                            | 14.257.955                                | 11.222.572                        | 44.469.256                                 | 55.205.634                          | 1.163.077                           | 7.042.532   | 3.554.300                           |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen   |      | 294                                | 11.329.362                                | –                                 | 10.775.834                                 | 22.831.706                          | –                                   | –   | –                                   |
| Forderungen aus ausgegebenen Anteilen   |      | 167.685                            | 5.275.293                                 | 3.219.672                         | 336.109                                    | 91.892.501                          | –                                   | –   | –                                   |
| Forderungen gegenüber Brokern   |      | –                                  | 5.350.000                                 | 11.144.095                        | –  | 22.631.176                          | 108.311                             | 4.811.634   | 526.958                             |
| Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen   |      | 5.544                              | 51.967.946                                | 10.766.896                        | 11.302.348                                 | 16.507.617                          | 513.607                             | 7.824.139   | 6.453                               |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   |      | <b>19.791.527</b>                  | <b>3.970.556.620</b>                      | <b>1.001.831.540</b>              | <b>759.813.279</b>                         | <b>2.372.144.257</b>                | <b>28.695.029</b>                   | <b>451.852.801</b>  | <b>27.517.417</b>                   |
| <b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>   |      |                                    |   |                                   |  |                                     |                                     |   |                                     |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                   | 2    | –                                  | 9.131.675                                 | 8.016.867                         | 3.114.085                                  | 25.175.764                          | 58.767                              | 5.706.695   | 262.401                             |
| Kontenüberziehung   | 4    | –                                  | –   | –                                 | –  | 377                                 | –                                   | –   | 68.223                              |
| Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen   |      | –                                  | 2.760.383                                 | 440.357                           | 241.544                                    | 3.405.075                           | 746                                 | 16.636  | –                                   |
| Verbindlichkeiten gegenüber dem Makler  |      | –                                  | –   | –                                 | –  | 520.000                             | –                                   | –   | –                                   |
| Antizipative Passiva  |      | 35.580                             | 2.320.930                                 | 258.073                           | 510.397                                    | 1.529.024                           | 58.670                              | 215.044   | 10.585                              |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen  |      | –                                  | 1.500.740                                 | –                                 | 11.465.702                                 | 321.393.124                         | –                                   | 90  | 93                                  |
| Sonstige Verbindlichkeiten  |      | 12.017                             | 73.325                                    | 243.945                           | 47.104                                     | 517.312                             | 11.895                              | 22.066  | 13.807                              |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b> |      | <b>47.597</b>                      | <b>15.787.053</b>                         | <b>8.959.242</b>                  | <b>15.378.832</b>                          | <b>352.540.676</b>                  | <b>130.078</b>                      | <b>5.960.531</b>  | <b>355.109</b>                      |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                             |      | <b>19.743.930</b>                  | <b>3.954.769.567</b>                      | <b>992.872.298</b>                | <b>744.434.447</b>                         | <b>2.019.603.581</b>                | <b>28.564.951</b>                   | <b>445.892.270</b>  | <b>27.162.308</b>                   |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Bilanzen (Fortsetzung)

| Anm.  | Uncorrelated Strategies | Uncorrelated Trading    | US Equity             | US Equity Premium     | US Large Cap Value    | US Long Short Equity  | US Multi Cap Opportunities | US Real Estate Securities |                    |
|---|-------------------------|-------------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|----------------------------|---------------------------|--------------------|
|   | Zum 31. Dezember 2023   | Zum 31. Dezember 2023 * | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2023      | Zum 31. Dezember 2023     |                    |
|   | US\$                    | US\$                    | US\$                  | US\$                  | US\$                  | US\$                  | US\$                       | US\$                      |                    |
| <b>Umlaufvermögen</b>   |                         |                         |                       |                       |                       |                       |                            |                           |                    |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                      | 2                       | 1.476.262.171           | –                     | 47.126.139            | 675.485.941           | 1.852.695.638         | 182.183.949                | 398.826.631               | 522.351.479        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 3                       | 215.995.568             | 198.922               | 2.317.070             | 56.170.541            | 129.487.412           | 4.926.902                  | 2.020.942                 | 12.824.749         |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen   |                         | 15.185.048              | –                     | 3.038                 | 1.711.903             | 27.677.469            | 466.494                    | 2.749.439                 | 1.290.830          |
| Forderungen aus ausgegebenen Anteilen   |                         | 43.677.979              | –                     | 266.617               | 1.578.418             | 1.825.988             | 43.717                     | 937.914                   | 3.439.184          |
| Forderungen gegenüber Brokern   |                         | 456.802.391             | –                     | –                     | –                     | –                     | 18.176.471                 | –                         | –                  |
| Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen   |                         | 76.645.645              | 1.324                 | 37.095                | 1.742.599             | 2.702.827             | 559.458                    | 211.780                   | 1.534.038          |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   |                         | <b>2.284.568.802</b>    | <b>200.246</b>        | <b>49.749.959</b>     | <b>736.689.402</b>    | <b>2.014.389.334</b>  | <b>206.356.991</b>         | <b>404.746.706</b>        | <b>541.440.280</b> |
| <b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>   |                         |                         |                       |                       |                       |                       |                            |                           |                    |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                   | 2                       | 499.958.213             | –                     | 118.963               | 5.789.899             | 115.827               | 8.738.101                  | 325.170                   | 441.683            |
| Kontenüberziehung   | 4                       | 659                     | –                     | –                     | –                     | –                     | –                          | –                         | –                  |
| Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen   |                         | 4.375.209               | –                     | 349.690               | 1.255.511             | 11.729.299            | 692.205                    | 3.342.769                 | 6.007.211          |
| Antizipative Passiva  |                         | 1.133.015               | 110.069               | 74.355                | 349.539               | 1.158.780             | 280.090                    | 547.484                   | 895.622            |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen  |                         | 81.242.292              | –                     | –                     | 165.070               | 62.146.829            | 14.013                     | –                         | 941.735            |
| Sonstige Verbindlichkeiten  |                         | 71.157.993              | 90.177                | 4.802                 | 31.383                | 48.221                | 1.162.291                  | 39.248                    | 44.044             |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b> |                         | <b>657.867.381</b>      | <b>200.246</b>        | <b>547.810</b>        | <b>7.591.402</b>      | <b>75.198.956</b>     | <b>10.886.700</b>          | <b>4.254.671</b>          | <b>8.330.295</b>   |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                             |                         | <b>1.626.701.421</b>    | <b>–</b>              | <b>49.202.149</b>     | <b>729.098.000</b>    | <b>1.939.190.378</b>  | <b>195.470.291</b>         | <b>400.492.035</b>        | <b>533.109.985</b> |

\* Der Uncorrelated Trading wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Bilanzen (Fortsetzung)

|   | Anm. | US Small Cap                        | US Small Cap   | Fonds insgesamt*                    |
|---|------|-------------------------------------|--|-------------------------------------|
|   |      | Zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$ | Intrinsic Value<br>Zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$ | Zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$ |
| <b>Umlaufvermögen</b>   |      |                                     |  |                                     |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                      | 2    | 623.039.280                         | 301.736.793  | 27.392.822.906                      |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 3    | 12.744.703                          | 18.299.118   | 1.025.815.249                       |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen   |      | 369                                 | 1.402.699  | 138.871.900                         |
| Forderungen aus ausgegebenen Anteilen   |      | 2.127.779                           | 477.091  | 185.808.216                         |
| Forderungen gegenüber Brokern   |      | –                                   | –  | 582.901.730                         |
| Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen   |      | 193.802                             | 125.377  | 385.748.047                         |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   |      | <b>638.105.933</b>                  | <b>322.041.078</b>                                     | <b>29.711.968.048</b>               |
| <b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>   |      |                                     |  |                                     |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                                   | 2    | 137.144                             | 398  | 688.709.657                         |
| Kontenüberziehung   | 4    | –                                   | –  | 563.542                             |
| Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen   |      | 3.284.597                           | 40.900   | 72.180.295                          |
| Verbindlichkeiten gegenüber dem Makler  |      | –                                   | –  | 3.340.000                           |
| Antizipative Passiva  |      | 639.284                             | 275.610  | 22.069.430                          |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen  |      | 154.493                             | 140.859  | 517.779.908                         |
| Sonstige Verbindlichkeiten  |      | 38.646                              | 14.694   | 82.992.460                          |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b> |      | <b>4.254.164</b>                    | <b>472.461</b>   | <b>1.387.635.292</b>                |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen</b>                             |      | <b>633.851.769</b>                  | <b>321.568.617</b>                                     | <b>28.324.332.756</b>               |

\* Der konsolidierte Abschluss wurde um im Namen des Fonds gehaltener Salden und um Überkreuzinvestitionen zwischen den Portfolios bereinigt. Angaben zu den Kassenbeständen des Fonds sind Anmerkung 3 der Anmerkungen zum geprüften Jahresabschluss zu entnehmen. Details zu Überkreuzinvestitionen zwischen Portfolios sind Anmerkung 10 der Anmerkungen zum geprüften Jahresabschluss zu entnehmen.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Gewinn- und Verlustrechnungen

|  | Anm. | Absolute Return<br>Multi Strategy<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024*<br>US\$ | Asia Responsible<br>Transition Bond<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ | China A-Share<br>Equity<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024<br>CNY | China Bond<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024<br>CNY | China Equity<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ | Climate Innovation<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ | CLO Income<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ | Commodities<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ |
|--|------|---|--|---|--|---|---|---|--|
| <b>Erträge</b>   |      |   |  |   |  |   |   |   |  |
| Zinserträge  | 1    | 4.288   | 2.485.070  | 373   | 6.214.799  | 83.478  | 4.684   | 46.120.467  | 5.338.426  |
| Dividenderträge  | 1    | –   | –  | 395.831   | –  | 3.361.351   | 44.139  | –   | –  |
| Sonstige Erträge   |      | 3   | 655  | 20.946  | –  | –   | –   | 4.249   | –  |
| Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten | 11   | (4.291)   | 1.574.145  | 433.478   | 13.165.667   | 23.472.972  | 122.249   | 20.110.520  | 3.946.979  |
|  |      | –   | 4.059.870  | 850.628   | 19.380.466   | 26.917.801  | 171.072   | 66.235.236  | 9.285.405  |
| <b>Aufwendungen</b>  |      |   |  |   |  |   |   |   |  |
| Managementgebühr   | 6    | –   | 20.832   | 128.915   | 106.378  | 1.767.701   | 307   | 3.191.784   | 679.394  |
| Vertriebsgebühren  | 6    | –   | 2.461  | –   | –  | 162   | –   | –   | 4.020  |
| Verwaltungsgebühren  | 6    | –   | 103.331  | 248.443   | 402.938  | 107.200   | 31.360  | 228.495   | 124.630  |
| Bereitstellungsprovision   | 19   | –   | 9.373  | 2.195   | 44.352   | 24.225  | 462   | 56.851  | 22.980   |
| Depotgebühren  | 6    | –   | 10.000   | 71.628  | 121.632  | 22.430  | 9.584   | 12.147  | 10.000   |
| Gebühren der Verwahrstelle   | 6    | –   | 2.206  | 570   | 8.200  | 5.655   | 123   | 20.244  | 5.937  |
| Honorare   | 9    | –   | 82.879   | 206.706   | 474.051  | 93.961  | 66.494  | 141.094   | 35.845   |
| Honorare der Direktoren  | 7    | –   | 2.982  | 21.386  | 21.385   | 2.982   | 3.596   | 2.982   | 2.982  |
| Transaktionskosten   | 9    | –   | 15.894   | 306.373   | 50.530   | 329.459   | 8.191   | 13.992  | 26.006   |
| Prüfungshonorare   | 8    | –   | 10.358   | 70.182  | 72.473   | 10.486  | 10.972  | 10.358  | 10.101   |
| Umsatzsteuerentlastung   |      | –   | (724)  | (197)   | (3.153)  | (2.049)   | (43)  | (7.034)   | (1.869)  |
| Sonstige Aufwendungen  | 9    | –   | 8.932  | 67.000  | 144.089  | 20.030  | 21.025  | 8.837   | 10.343   |
| Kostenverzicht   | 6    | –   | (148.459)  | (976.217)   | (774.516)  | –   | (150.185)   | –   | –  |
| <b>Aufwendungen insgesamt</b>  |      | –   | 120.065  | 146.984   | 668.359  | 2.382.242   | 1.886   | 3.679.750   | 930.369  |
| <b>Finanzierungskosten</b>   |      |   |  |   |  |   |   |   |  |
| Zinsaufwendungen   |      | –   | –  | –   | 3.628  | –   | 4   | 275   | –  |
| Gezahlte Ausschüttungen  | 1    | –   | 13.987   | 105.250   | 112.003  | 164   | –   | 12.685.459  | –  |
|  |      | –   | 13.987   | 105.250   | 115.631  | 164   | 4   | 12.685.734  | –  |
| Quellensteuern   | 1    | –   | 16   | 38.752  | –  | 232.974   | 6.705   | –   | 4.692  |
| Kapitalertragsteuer  | 1    | –   | –  | –   | –  | –   | 3.556   | –   | –  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit</b>              |      | –   | 3.925.802  | 559.642   | 18.596.476   | 24.302.421  | 158.921   | 49.869.752  | 8.350.344  |

\* Der Absolute Return Multi Strategy wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

|  | Anm. | Corporate Hybrid Bond<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024<br>EUR | Developed Market FMP –<br>2027<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ | EMD Corporate –<br>Social and<br>Environmental<br>Transition<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ | Emerging Market<br>Debt - Hard<br>Currency<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ | Emerging Market<br>Debt - Local<br>Currency<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ | Emerging<br>Market Debt<br>Blend<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ | Emerging Market<br>Debt Sustainable<br>Investment Grade<br>Blend<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ | Emerging<br>Markets Equity<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ |
|--|------|---|---|---|---|--|---|---|---|
| <b>Erträge</b>   |      |   |   |   |   |  |   |   |   |
| Zinserträge  | 1    | 100.894.559   | 5.735.915   | 6.402.526   | 160.838.730   | 76.920.313   | 33.438.287  | 3.080.676   | 120.327   |
| Dividenderträge  | 1    | –   | –   | –   | –   | –  | –   | –   | 2.267.439   |
| Sonstige Erträge   |      | –   | –   | –   | –   | 224.352  | 112.362   | 5.616   | 2.532   |
| Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum<br>beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen<br>Vermögenswerten und Verbindlichkeiten | 11   | 115.019.671   | 1.656.747   | (3.012.316)   | 107.979.490   | (110.675.072)  | (30.106.079)  | (6.934.071)   | 20.051.228  |
|  |      | 215.914.230   | 7.392.662   | 3.390.210   | 268.818.220   | (33.530.407)   | 3.444.570   | (3.847.779)   | 22.441.526  |
| <b>Aufwendungen</b>  |      |   |   |   |   |  |   |   |   |
| Managementgebühr   | 6    | 13.884.340  | 777.059   | 722.901   | 19.490.728  | 7.895.743  | 3.417.008   | 256.032   | 836.141   |
| Vertriebsgebühren  | 6    | 190.512   | –   | 27.910  | 296.038   | 141.966  | 36.631  | –   | 49.893  |
| Verwaltungsgebühren  | 6    | 867.387   | 77.076  | 133.457   | 1.385.959   | 624.322  | 372.431   | 96.813  | 152.199   |
| Bereitstellungsprovision   | 19   | 301.708   | 18.103  | 16.788  | 406.545   | 183.291  | 78.858  | 9.753   | 15.727  |
| Depotgebühren  | 6    | 78.421  | 9.554   | 10.000  | 98.234  | 725.047  | 167.303   | 13.633  | 53.043  |
| Gebühren der Verwahrstelle   | 6    | 84.390  | 5.247   | 4.518   | 105.947   | 46.967   | 20.704  | 2.519   | 4.074   |
| Honorare   | 9    | 240.296   | 71.713  | 107.101   | 304.877   | 202.933  | 144.793   | 37.139  | 134.512   |
| Honorare der Direktoren  | 7    | 2.736   | 3.596   | 2.982   | 2.982   | 2.982  | 2.982   | 2.982   | 2.982   |
| Transaktionskosten   | 9    | 46.746  | 1.320   | 22.609  | 220.376   | 283.222  | 178.894   | 41.864  | 592.548   |
| Prüfungshonorare   | 8    | 10.838  | 10.791  | 11.258  | 12.415  | 12.479   | 11.708  | 9.908   | 11.129  |
| Umsatzsteuerentlastung   |      | (29.334)  | (1.831)   | (1.532)   | (36.115)  | (16.126)   | (6.939)   | (848)   | (1.406)   |
| Sonstige Aufwendungen  | 9    | 9.019   | 12.015  | 10.055  | 15.030  | 16.301   | 15.158  | 11.880  | 13.589  |
| Kostenverzicht   | 6    | –   | (3.024)   | (131.083)   | –   | (64.380)   | –   | (84.877)  | (159.445)   |
| <b>Aufwendungen insgesamt</b>  |      | 15.687.059  | 981.619   | 936.964   | 22.303.016  | 10.054.747   | 4.439.531   | 396.798   | 1.704.986   |
| <b>Finanzierungskosten</b>   |      |   |   |   |   |  |   |   |   |
| Zinsaufwendungen   |      | 455   | –   | 87  | 1.225   | 20.733   | 4.419   | 147   | 2.450   |
| Gezahlte Ausschüttungen  | 1    | 19.694.386  | 1.163.933   | 225.460   | 35.604.682  | 15.345.408   | 6.852.098   | –   | 67.046  |
|  |      | 19.694.841  | 1.163.933   | 225.547   | 35.605.907  | 15.366.141   | 6.856.517   | 147   | 69.496  |
| Quellensteuern   | 1    | –   | –   | 26  | 26.689  | 1.598.452  | 481.981   | 32.732  | 267.616   |
| Kapitalertragsteuer  | 1    | –   | –   | –   | –   | (227.878)  | (19.058)  | 1.621   | 2.633.565   |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter<br/>Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der<br/>Geschäftstätigkeit</b>            |      | 180.532.330   | 5.247.110   | 2.227.673   | 210.882.608   | (60.321.869)   | (8.314.401)   | (4.279.077)   | 17.765.863  |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

| Anm.   | Euro Bond<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024<br>EUR | Euro Bond<br>Absolute Return<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024<br>EUR | European High<br>Yield Bond<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024<br>EUR | European<br>Sustainable Equity<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024<br>EUR | Event Driven<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ | Global Bond<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ | Global Diversified<br>Income FMP –<br>2024<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024*<br>US\$ | Global Equity<br>Megatrends<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ |            |
|--|---|--|---|--|---|--|--|--|------------|
| <b>Erträge</b>   |   |  |   |  |   |  |  |  |            |
| Zinserträge  | 1   | 1.176.883  | 2.081.135   | 27.154.326   | 58.860  | 4.006.420  | 4.388.502  | 2.047.603  | 449.811    |
| Dividenerträge   | 1   | –  | –   | –  | 2.568.141   | –  | –  | –  | 3.542.312  |
| Sonstige Erträge   |   | 6.952  | 11.472  | –  | 24.247  | 755  | –  | 23.776   | –          |
| Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten | 11  | 1.340.708  | 5.123.687   | 23.906.869   | 8.609.478   | 6.630.939  | (5.270.182)  | 1.584.564  | 43.331.281 |
|  |   | 2.524.543  | 7.216.294   | 51.061.195   | 11.260.726  | 10.638.114   | (881.680)  | 3.655.943  | 47.323.404 |
| <b>Aufwendungen</b>  |   |  |   |  |   |  |  |  |            |
| Managementgebühr   | 6   | 104.126  | 58.285  | 949.871  | 429.986   | 863.178  | 20.691   | 372.992  | 2.973.473  |
| Vertriebsgebühren  | 6   | 1  | –   | 6.860  | 471   | –  | 6.403  | –  | 483.049    |
| Verwaltungsgebühren  | 6   | 66.561   | 72.147  | 264.657  | 97.083  | 106.593  | 156.501  | 42.390   | 261.697    |
| Bereitstellungsprovision   | 19  | 3.691  | 7.243   | 69.105   | 25.238  | 20.074   | 16.869   | 13.351   | 34.695     |
| Depotgebühren  | 6   | 9.151  | 9.206   | 23.055   | 18.723  | 10.000   | 9.995  | 5.000  | 10.000     |
| Gebühren der Verwahrstelle   | 6   | 1.500  | 2.309   | 21.233   | 6.453   | 7.953  | 4.338  | 2.534  | 11.589     |
| Honorare   | 9   | 19.032   | 19.911  | 94.617   | 65.403  | 62.348   | 50.172   | 38.792   | 77.600     |
| Honorare der Direktoren  | 7   | 2.736  | 2.736   | 2.736  | 2.736   | 2.982  | 2.982  | 1.291  | 2.982      |
| Erfolgsabhängige Gebühr  | 6   | –  | –   | –  | –   | 3.671.667  | –  | –  | –          |
| Transaktionskosten   | 9   | 16.458   | 21.999  | 25.860   | 196.321   | 28.695   | 89.929   | 5.197  | 326.510    |
| Prüfungshonorare   | 8   | 9.054  | 9.121   | 9.743  | 9.477   | 10.036   | 10.229   | 10.946   | 10.036     |
| Umsatzsteuerentlastung   |   | (565)  | (813)   | (7.184)  | (2.182)   | (2.414)  | (1.482)  | (761)  | (3.883)    |
| Sonstige Aufwendungen  | 9   | 7.372  | 9.581   | 10.312   | 8.536   | 10.057   | 10.245   | 6.630  | 34.570     |
| Kostenverzicht   | 6   | (58.084)   | (28.970)  | –  | –   | –  | (73.473)   | –  | –          |
| <b>Aufwendungen insgesamt</b>  |   | 181.033  | 182.755   | 1.470.865  | 858.245   | 4.791.169  | 303.399  | 498.362  | 4.222.318  |
| <b>Finanzierungskosten</b>   |   |  |   |  |   |  |  |  |            |
| Zinsaufwendungen   |   | 270  | 7.595   | 4.198  | 5   | 67   | 209  | –  | 453        |
| Gezahlte Ausschüttungen  | 1   | 244.558  | 243   | 381.602  | 730.669   | –  | 2.109  | 1.311.432  | 1.615      |
|  |   | 244.828  | 7.838   | 385.800  | 730.674   | 67   | 2.318  | 1.311.432  | 2.068      |
| Quellensteuern   | 1   | –  | –   | 38.835   | 350.984   | 2.657  | 35.225   | 7.458  | 409.406    |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit</b>              |   | 2.098.682  | 7.025.701   | 49.165.695   | 9.320.823   | 5.844.221  | (1.222.622)  | 1.838.691  | 42.689.612 |

\* Der Global Diversified Income FMP – 2024 wurde am 28. Juni 2024 aufgelöst.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

| Anm.   | Global Flexible<br>Credit Income<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ | Global High Yield<br>Engagement<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ | Global Investment<br>Grade Credit<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ | Global<br>Opportunistic<br>Bond<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ | Global Real Estate<br>Securities<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024*<br>US\$ | Global Sustainable<br>Equity<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ | Global Value<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ | High Yield Bond<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ |             |
|--|---|--|--|--|--|---|---|--|-------------|
| <b>Erträge</b>   |   |  |  |  |  |   |   |  |             |
| Zinserträge  | 1   | 27.509.255   | 38.692.104   | 4.952.274  | 3.053.704  | 37.402  | 63.300  | 25.784   | 144.111.590 |
| Dividenerträge   | 1   | 7.891  | –  | –  | 2.499  | 710.609   | 1.452.932   | 2.058.915  | 426.355     |
| Sonstige Erträge   |   | 101.955  | 218.450  | 17.111   | 34.134   | –   | 23.255  | –  | 1.500.200   |
| Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten | 11  | 4.327.391  | (2.564.774)  | (4.665.929)  | (970.855)  | (882.008)   | 11.544.274  | 6.002.626  | (2.345.746) |
|  |   | 31.946.492   | 36.345.780   | 303.456  | 2.119.482  | (133.997)   | 13.083.761  | 8.087.325  | 143.692.399 |
| <b>Aufwendungen</b>  |   |  |  |  |  |   |   |  |             |
| Managementgebühr   | 6   | 2.034.522  | 2.196.552  | 71.888   | 112.350  | 156.800   | 370.575   | 186.768  | 18.767.605  |
| Vertriebsgebühren  | 6   | 82.893   | 7.511  | –  | –  | 16.116  | 2.392   | 4.108  | 1.514.690   |
| Verwaltungsgebühren  | 6   | 245.043  | 344.492  | 120.887  | 146.701  | 67.983  | 102.038   | 90.079   | 1.378.788   |
| Bereitstellungsprovision   | 19  | 62.549   | 92.716   | 13.343   | 10.042   | 4.073   | 23.828  | 10.587   | 330.546     |
| Depotgebühren  | 6   | 10.043   | 13.539   | 10.000   | 10.000   | 10.023  | 10.000  | 10.000   | 19.805      |
| Gebühren der Verwahrstelle   | 6   | 17.241   | 24.805   | 4.319  | 2.673  | 796   | 6.160   | 2.860  | 85.995      |
| Honorare   | 9   | 85.052   | 112.455  | 37.994   | 47.648   | 94.218  | 69.409  | 49.472   | 342.958     |
| Honorare der Direktoren  | 7   | 2.982  | 2.982  | 2.982  | 2.982  | 3.049   | 2.982   | 2.981  | 2.982       |
| Transaktionskosten   | 9   | 70.635   | 84.889   | 12.414   | 46.437   | 69.011  | 49.532  | 141.377  | 150.155     |
| Prüfungshonorare   | 8   | 14.150   | 10.776   | 9.908  | 10.101   | 12.033  | 10.294  | 10.101   | 16.850      |
| Umsatzsteuerentlastung   |   | (5.802)  | (8.534)  | (1.550)  | (916)  | (289)   | (2.047)   | (1.022)  | (29.230)    |
| Sonstige Aufwendungen  | 9   | 11.069   | 11.476   | 9.222  | 7.964  | 10.497  | 8.304   | 11.930   | 15.748      |
| Kostenverzicht   | 6   | –  | (57)   | (42.879)   | (134.904)  | (177.464)   | –   | (72.900)   | –           |
| Verzicht auf Gebühren  | 6   | (154)  | –  | –  | –  | –   | –   | –  | (8.359)     |
| <b>Aufwendungen insgesamt</b>  |   | 2.630.223  | 2.893.602  | 248.528  | 261.078  | 266.846   | 653.467   | 446.341  | 22.588.533  |
| <b>Finanzierungskosten</b>   |   |  |  |  |  |   |   |  |             |
| Zinsaufwendungen   |   | 6  | 2.533  | 6  | 60   | 338   | 263   | 857  | 66.223      |
| Gezahlte Ausschüttungen  | 1   | 105.719  | 449.260  | 319  | 362.715  | 777   | –   | –  | 99.632.709  |
|  |   | 105.725  | 451.793  | 325  | 362.775  | 1.115   | 263   | 857  | 99.698.932  |
| Quellensteuern   | 1   | 119.213  | 915  | 2.653  | 10.150   | 124.229   | 379.242   | 341.237  | 208.040     |
| Kapitalertragsteuer  | 1   | –  | –  | –  | 448  | –   | –   | (1.449)  | –           |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit</b>              |   | 29.091.331   | 32.999.470   | 51.950   | 1.485.031  | (526.187)   | 12.050.789  | 7.300.339  | 21.196.894  |

\* Der Global Real Estate Securities wurde am 31. Dezember 2024 aufgelöst.

## Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

|  | Anm. | InnovAsia<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ | Japan Equity<br>Engagement<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024<br>JPY | Macro<br>Opportunities FX<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024*<br>EUR | Next Generation<br>Connectivity<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ | Next Generation<br>Mobility<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ | Next Generation<br>Space Economy<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ | Short Duration<br>Emerging Market<br>Debt<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ | Short Duration<br>Euro Bond<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024<br>EUR |
|--|------|--|--|--|--|--|---|--|---|
| <b>Erträge</b>   |      |  |  |  |  |  |   |  |   |
| Zinserträge  | 1    | 32.791   | –  | 1.924  | 1.935.016  | 188.073  | 74.818  | 187.983.722  | 38.256.019  |
| Dividenerträge   | 1    | 173.209  | 420.680.568  | –  | 7.731.232  | 1.453.447  | 332.873   | –  | –   |
| Sonstige Erträge   |      | 12.848   | –  | 92   | 26.801   | –  | –   | –  | 140.239   |
| Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten | 11   | 1.673.407  | 2.523.532.492  | 11.481   | 319.572.383  | (612.388)  | 7.230.865   | (60.545.033)   | 56.303.821  |
|  |      | 1.892.255  | 2.944.213.060  | 13.497   | 329.265.432  | 1.029.132  | 7.638.556   | 127.438.689  | 94.700.079  |
| <b>Aufwendungen</b>  |      |  |  |  |  |  |   |  |   |
| Managementgebühr   | 6    | 215.222  | 73.804.923   | 1.241  | 15.265.578   | 1.963.183  | 328.439   | 21.936.599   | 2.393.416   |
| Vertriebsgebühren  | 6    | 386  | –  | –  | 779.281  | 328.887  | 87.294  | 635.897  | 79.717  |
| Verwaltungsgebühren  | 6    | 53.802   | 17.425.632   | 15.857   | 742.119  | 137.390  | 57.434  | 1.722.947  | 556.483   |
| Bereitstellungsprovision   | 19   | 3.206  | 2.833.510  | 1.691  | 167.025  | 23.170   | 4.256   | 571.013  | 174.245   |
| Depotgebühren  | 6    | 10.057   | 1.532.517  | 1.875  | 88.922   | 13.574   | 10.000  | 143.700  | 48.413  |
| Gebühren der Verwahrstelle   | 6    | 1.037  | 733.582  | 11   | 44.019   | 5.822  | 1.832   | 153.438  | 51.664  |
| Honorare   | 9    | 88.458   | 16.111.641   | 24.787   | 213.085  | 67.473   | 67.467  | 429.960  | 122.581   |
| Honorare der Direktoren  | 7    | 2.982  | 446.449  | 914  | 2.981  | 2.981  | 2.982   | 2.982  | 2.737   |
| Transaktionskosten   | 9    | 210.039  | 30.092.078   | 14.952   | 2.067.916  | 191.638  | 55.000  | 82.952   | 77.485  |
| Prüfungshonorare   | 8    | 10.486   | 1.536.858  | 9.033  | 11.708   | 10.293   | 9.844   | 12.736   | 9.643   |
| Umsatzsteuerentlastung   |      | (248)  | (250.534)  | (9)  | (14.778)   | (1.986)  | (437)   | (52.948)   | (18.185)  |
| Sonstige Aufwendungen  | 9    | 12.365   | 1.292.055  | 6.503  | 25.451   | 12.434   | 10.458  | 8.976  | 9.219   |
| Kostenverzicht   | 6    | (186.257)  | (1.742.607)  | (73.559)   | –  | –  | (106.597)   | –  | –   |
| <b>Aufwendungen insgesamt</b>  |      | 421.535  | 143.816.104  | 3.296  | 19.393.307   | 2.754.859  | 527.972   | 25.648.252   | 3.507.418   |
| <b>Finanzierungskosten</b>   |      |  |  |  |  |  |   |  |   |
| Zinsaufwendungen   |      | 28   | 317.667  | 165  | –  | 297  | 32  | 6.855  | –   |
| Gezahlte Ausschüttungen  | 1    | –  | 222.657  | –  | –  | –  | –   | 32.127.499   | 156.662   |
|  |      | 28   | 540.324  | 165  | –  | 297  | 32  | 32.134.354   | 156.662   |
| Quellensteuern   | 1    | 25.596   | 63.102.086   | –  | 1.816.960  | 268.996  | 51.968  | –  | –   |
| Kapitalertragsteuer  | 1    | 137.396  | –  | –  | –  | –  | –   | –  | –   |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit</b>              |      | 1.307.700  | 2.736.754.546  | 10.036   | 308.055.165  | (1.995.020)  | 7.058.584   | 69.656.083   | 91.035.999  |

\* Der Macro Opportunities FX wurde am 8. Februar 2024 aufgelöst.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

|  | Anm. | Short Duration<br>High Yield<br>Engagement<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ | Strategic Income<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ | Sustainable Asia<br>High Yield<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ | Sustainable<br>Emerging Market<br>Debt - Hard<br>Currency<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ | Tactical Macro<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ | Uncorrelated<br>Strategies<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ | US Equity<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ | US Equity Premium<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ |
|--|------|---|---|---|--|---|---|--|--|
| <b>Erträge</b>   |      |   |   |   |  |   |   |  |  |
| Zinserträge  | 1    | 43.792.108  | 168.548.617   | 1.554.943   | 32.137.066   | 430.540   | 31.572.772  | 60.630   | 31.598.164   |
| Dividendenerträge  | 1    | 28.457  | 17.313  | –   | –  | –   | –   | 571.933  | –  |
| Sonstige Erträge   |      | 472.064   | 561.602   | –   | –  | –   | 219.852   | –  | –  |
| Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten | 11   | (22.389.424)  | (63.396.719)  | 2.626.253   | (10.210.845)   | 1.063.853   | 18.737.829  | 10.588.493   | 60.348.348   |
|  |      | 21.903.205  | 105.730.813   | 4.181.196   | 21.926.221   | 1.494.393   | 50.530.453  | 11.221.056   | 91.946.512   |
| <b>Aufwendungen</b>  |      |   |   |   |  |   |   |  |  |
| Managementgebühr   | 6    | 4.507.756   | 27.668.630  | 880   | 2.215.072  | 13.861  | 6.972.288   | 610.461  | 3.182.266  |
| Beratungsgebühren  | 6    | –   | –   | –   | –  | –   | 7.705.554   | –  | –  |
| Vertriebsgebühren  | 6    | 60.117  | 1.996.282   | –   | –  | –   | 61.932  | 42.854   | 15.724   |
| Verwaltungsgebühren  | 6    | 396.264   | 2.168.037   | 57.861  | 221.033  | 46.727  | 1.408.100   | 88.924   | 379.856  |
| Bereitstellungsprovision   | 19   | 107.372   | 442.801   | 4.450   | 83.122   | 4.573   | 172.827   | 10.391   | 111.650  |
| Depotgebühren  | 6    | 10.000  | 58.169  | 10.000  | 20.940   | 10.006  | 113.799   | 10.000   | 10.000   |
| Gebühren der Verwahrstelle   | 6    | 27.786  | 138.801   | 1.215   | 22.695   | 1.349   | 123.017   | 3.059  | 29.554   |
| Honorare   | 9    | 146.784   | 446.381   | 27.472  | 65.589   | 55.645  | 356.015   | 50.767   | 142.506  |
| Honorare der Direktoren  | 7    | 2.982   | 2.981   | 2.982   | 2.982  | 3.122   | 2.982   | 2.982  | 2.982  |
| Transaktionskosten   | 9    | 56.278  | 823.817   | 6.141   | 56.737   | 28.147  | 9.300.345   | 25.346   | 98.709   |
| Prüfungshonorare   | 8    | 13.668  | 11.724  | 10.101  | 9.972  | 10.103  | 11.049  | 9.972  | 10.808   |
| Umsatzsteuerentlastung   |      | (9.512)   | (46.425)  | (411)   | (7.743)  | (448)   | (13.856)  | (975)  | (9.537)  |
| Sonstige Aufwendungen  | 9    | 11.341  | 12.071  | 12.216  | 9.050  | 13.563  | 148.317   | 8.936  | 8.551  |
| Kostenverzicht   | 6    | –   | –   | (66.448)  | –  | (96.893)  | (83.923)  | (33.411)   | –  |
| Verzicht auf Gebühren  | 6    | (556)   | (337)   | –   | –  | –   | –   | –  | –  |
| <b>Aufwendungen insgesamt</b>  |      | 5.330.280   | 33.722.932  | 66.459  | 2.699.449  | 89.755  | 26.278.446  | 829.306  | 3.983.069  |
| <b>Finanzierungskosten</b>   |      |   |   |   |  |   |   |  |  |
| Zinsaufwendungen   |      | 2.443   | 5.757   | –   | 339  | 2.890   | 81.713  | 3.910  | –  |
| Gezahlte Ausschüttungen  | 1    | 15.699.279  | 117.971.816   | 333.127   | –  | –   | –   | –  | 7.391.011  |
|  |      | 15.701.722  | 117.977.573   | 333.127   | 339  | 2.890   | 81.713  | 3.910  | 7.391.011  |
| Quellensteuern   | 1    | 44.116  | 666.366   | 3.776   | 147.464  | –   | 2.070.835   | 165.914  | –  |
| Kapitalertragsteuer  | 1    | –   | 43.976  | –   | –  | –   | –   | –  | –  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit</b>              |      | 827.087   | (46.680.034)  | 3.777.834   | 19.078.969   | 1.401.748   | 22.099.459  | 10.221.926   | 80.572.432   |

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

|  | Anm. | US Large Cap<br>Value<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ | US Long Short Equity<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ | US Multi Cap<br>Opportunities<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ | US Real Estate<br>Securities<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ | US Small Cap<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ | US Small Cap<br>Intrinsic Value<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ | Fonds insgesamt*<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024<br>US\$ |
|--|------|--|---|--|---|---|--|---|
| <b>Erträge</b>   |      |  |   |  |   |   |  |   |
| Zinserträge  | 1    | 1.607.509  | 1.066.421   | 72.586   | 318.882   | 663.875   | 845.072  | 1.258.674.538   |
| Dividenderträge  | 1    | 30.820.136   | 2.131.595   | 3.751.213  | 16.513.890  | 6.309.001   | 2.626.308  | 91.954.014  |
| Sonstige Erträge   |      | 12.552   | 52.950  | –  | –   | –   | 4  | 3.828.873   |
| Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden<br>Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und<br>Verbindlichkeiten | 11   | 100.320.689  | 6.438.409   | 64.638.873   | 2.328.610   | 35.978.644  | 26.966.572   | 824.514.793   |
|  |      | 132.760.886  | 9.689.375   | 68.462.672   | 19.161.382  | 42.951.520  | 30.437.956   | 2.178.972.218   |
| <b>Aufwendungen</b>  |      |  |   |  |   |   |  |   |
| Managementgebühr   | 6    | 7.720.866  | 2.481.674   | 4.529.348  | 6.315.003   | 6.913.555   | 2.887.616  | 202.703.249   |
| Beratungsgebühren  | 6    | –  | –   | –  | –   | –   | –  | 7.705.554   |
| Vertriebsgebühren  | 6    | 153.015  | 29.300  | 324.659  | 960.394   | 254.721   | 10.080   | 8.717.194   |
| Verwaltungsgebühren  | 6    | 546.991  | 197.549   | 334.715  | 685.799   | 451.838   | 208.410  | 18.710.265  |
| Bereitstellungsprovision   | 19   | 195.366  | 29.949  | 55.064   | 72.477  | 97.983  | 51.553   | 4.339.442   |
| Depotgebühren  | 6    | 11.077   | 10.000  | 10.000   | 10.000  | 10.000  | 10.000   | 2.080.867   |
| Gebühren der Verwahrstelle   | 6    | 45.093   | 7.846   | 14.299   | 18.712  | 27.207  | 14.280   | 1.263.729   |
| Honorare   | 9    | 104.833  | 88.528  | 154.853  | 181.198   | 139.902   | 84.962   | 6.239.126   |
| Honorare der Direktoren  | 7    | 2.982  | 2.981   | 2.982  | 2.982   | 2.981   | 2.982  | 155.612   |
| Erfolgsabhängige Gebühr  | 6    | –  | 381.344   | –  | –   | –   | –  | 4.053.011   |
| Transaktionskosten   | 9    | 854.242  | 82.062  | 155.262  | 384.099   | 225.376   | 121.304  | 18.315.915  |
| Prüfungshonorare   | 8    | 11.065   | 10.615  | 11.322   | 12.158  | 11.258  | 10.101   | 578.787   |
| Umsatzsteuerentlastung   |      | (16.911)   | (2.634)   | (4.933)  | (6.639)   | (8.842)   | (4.759)  | (403.604)   |
| Sonstige Aufwendungen  | 9    | 12.725   | 7.668   | 8.859  | 11.370  | 11.604  | 24.265   | 784.524   |
| Kostenverzicht   | 6    | –  | –   | –  | –   | –   | –  | (2.245.492)   |
| Verzicht auf Gebühren  | 6    | –  | –   | –  | –   | –   | –  | (9.406)   |
| <b>Aufwendungen insgesamt</b>  |      | 9.641.344  | 3.326.882   | 5.596.430  | 8.647.553   | 8.137.583   | 3.420.794  | 272.988.773   |
| <b>Finanzierungskosten</b>   |      |  |   |  |   |   |  |   |
| Zinsaufwendungen   |      | –  | 203   | 10.240   | –   | 12  | –  | 231.402   |
| Gezahlte Ausschüttungen  | 1    | 15.934.212   | 124.923   | 10.296   | 3.986.725   | –   | –  | 390.367.957   |
|  |      | 15.934.212   | 125.126   | 20.536   | 3.986.725   | 12  | –  | 390.599.359   |
| Quellensteuern   | 1    | 8.435.773  | 605.418   | 1.086.537  | 4.379.378   | 1.803.494   | 650.140  | 27.359.985  |
| Kapitalertragsteuer  | 1    | –  | –   | –  | –   | –   | –  | 2.572.177   |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile<br/>entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit</b>                |      | 98.749.557   | 5.631.949   | 61.759.169   | 2.147.726   | 33.010.431  | 26.367.022   | 1.485.451.924   |

Alle Erträge und Aufwendungen ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit – mit Ausnahme des Absolute Return Multi Strategy, Global Diversified Income FMP – 2024, Global Real Estate Securities, Macro Opportunities FX und China Bond, die am 20. Dezember 2021, 28. Juni 2024, 31. Dezember 2024, 8. Februar 2024 bzw. 28. März 2025 aufgelöst wurden. Außer den in der konsolidierten Gewinn- und Verlustrechnung ausgewiesenen gab es keine Gewinne und Verluste im Berichtszeitraum.

\* Der konsolidierte Abschluss wurde um Überkreuzinvestitionen zwischen den Portfolios bereinigt. Details zu Überkreuzinvestitionen zwischen Portfolios sind Anmerkung 10 der Anmerkungen zum geprüften Jahresabschluss zu entnehmen.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

|  | Anm. | Absolute Return<br>Multi Strategy<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023*<br>US\$ | Asia Responsible<br>Transition Bond<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$ | China A-Share<br>Equity<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023<br>CNY | China Bond<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023<br>CNY | China Equity<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$ | Climate Innovation<br>Berichtszeitraum zum<br>31. Dezember<br>2023**<br>US\$ | CLO Income<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$ | Commodities<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$ |
|--|------|---|--|---|--|---|--|---|--|
| <b>Erträge</b>   |      |   |  |   |  |   |  |   |  |
| Zinserträge  | 1    | 4.700   | 2.331.729  | 191   | 14.012.501   | 118.367   | 2.722  | 16.251.994  | 3.172.776  |
| Dividendenerträge  | 1    | 12.860  | 600  | 330.323   | –  | 5.998.152   | 7.825  | 488.555   | –  |
| Sonstige Erträge   |      | 1.832   | 1.882  | –   | –  | 261   | –  | –   | –  |
| Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten | 11   | (19.392)  | 919.735  | (2.078.125)   | 24.887.406   | (65.385.007)  | (83.333)   | 15.296.714  | (9.444.949)  |
|  |      | –   | 3.253.946  | (1.747.611)   | 38.899.907   | (59.268.227)  | (72.786)   | 32.037.263  | (6.272.173)  |
| <b>Aufwendungen</b>  |      |   |  |   |  |   |  |   |  |
| Managementgebühr   | 6    | –   | 27.705   | 141.677   | 255.294  | 3.175.628   | 112  | 872.722   | 438.730  |
| Vertriebsgebühren  | 6    | –   | 3.810  | –   | –  | 183   | –  | –   | 2.462  |
| Verwaltungsgebühren  | 6    | –   | 95.572   | 284.983   | 564.899  | 165.356   | 12.359   | 111.751   | 99.444   |
| Bereitstellungsprovision   | 19   | –   | 6.569  | 2.284   | 49.489   | 38.821  | 93   | 20.130  | 15.833   |
| Depotgebühren  | 6    | –   | 12.068   | 85.543  | 247.855  | 61.993  | 2.503  | 12.061  | 12.000   |
| Gebühren der Verwahrstelle   | 6    | –   | 2.701  | 898   | 26.749   | 15.891  | 29   | 8.035   | 6.800  |
| Honorare   | 9    | –   | 129.559  | 373.292   | 551.080  | 137.367   | 12.320   | 77.913  | 59.473   |
| Honorare der Direktoren  | 7    | –   | 4.297  | 31.072  | 30.759   | 4.351   | 1.375  | 4.436   | 4.416  |
| Transaktionskosten   | 9    | –   | 12.406   | 182.302   | 104.430  | 473.178   | 13.023   | 38.730  | 40.645   |
| Gründungsaufwendungen  | 9    | –   | –  | –   | –  | –   | 32.730   | –   | –  |
| Prüfungshonorare   | 8    | –   | 10.696   | 74.507  | 75.617   | 10.793  | 10.779   | 10.872  | 10.688   |
| Umsatzsteuerentlastung   |      | –   | (490)  | (111)   | (4.238)  | (1.811)   | (1)  | (1.085)   | (871)  |
| Sonstige Aufwendungen  | 9    | –   | 10.364   | 63.082  | 181.289  | 18.825  | 327  | 8.112   | 12.060   |
| Kostenverzicht   | 6    | –   | (196.965)  | (1.006.693)   | (722.214)  | –   | (52.175)   | –   | (37.378)   |
| <b>Aufwendungen insgesamt</b>  |      | –   | 118.292  | 232.836   | 1.361.009  | 4.100.575   | 33.474   | 1.163.677   | 664.302  |
| <b>Finanzierungskosten</b>   |      |   |  |   |  |   |  |   |  |
| Zinsaufwendungen   |      | –   | 49   | –   | 8.419  | –   | –  | –   | –  |
| Gezahlte Ausschüttungen  | 1    | –   | 384.726  | 15.082  | 222.140  | 3.216   | –  | 9.174.149   | –  |
|  |      | –   | 384.775  | 15.082  | 230.559  | 3.216   | –  | 9.174.149   | –  |
| Quellensteuern   | 1    | –   | 51   | 32.397  | 19.376   | 413.387   | 1.185  | –   | –  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit</b>              |      | –   | 2.750.828  | (2.027.926)   | 37.288.963   | (63.785.405)  | (107.445)  | 21.699.437  | (6.936.475)  |

\* Der Absolute Return Multi Strategy wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

\*\* Der Climate Innovation wurde am 1. August 2023 aufgelegt.

## Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

|  |    | Corporate Hybrid<br>Bond<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023<br>Anm. EUR | Developed Market<br>FMP – 2027<br>Berichtszeitraum zum<br>31. Dezember<br>2023*<br>US\$ | EMD Corporate –<br>Social and<br>Environmental<br>Transition<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$ | Emerging Market<br>Debt - Hard<br>Currency<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$ | Emerging Market<br>Debt - Local<br>Currency<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$ | Emerging Market<br>Debt Blend<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$ | Emerging Market<br>Debt Sustainable<br>Investment Grade<br>Blend<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$ | Emerging Markets<br>Equity<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$ |
|--|----|---|---|---|---|--|--|---|---|
| <b>Erträge</b>   |    |   |   |   |   |  |  |   |   |
| Zinserträge  | 1  | 78.046.057  | 2.080.257   | 4.991.771   | 142.794.885   | 74.404.513   | 26.990.410   | 2.739.189   | 199.109   |
| Dividendenerträge  | 1  | –   | –   | 1.800   | –   | 113.951  | 171.675  | –   | 2.885.513   |
| Sonstige Erträge   |    | –   | –   | –   | –   | 1.161.393  | 310.983  | 7.843   | 131   |
| Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum<br>beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen<br>Vermögenswerten und Verbindlichkeiten | 11 | 76.398.634  | 3.758.602   | 4.754.214   | 211.428.520   | 98.021.149   | 36.380.307   | 1.250.394   | 9.999.988   |
|  |    | 154.444.691   | 5.838.859   | 9.747.785   | 354.223.405   | 173.701.006  | 63.853.375   | 3.997.426   | 13.084.741  |
| <b>Aufwendungen</b>  |    |   |   |   |   |  |  |   |   |
| Managementgebühr   | 6  | 11.575.142  | 276.626   | 687.958   | 18.716.353  | 8.682.808  | 3.275.391  | 288.809   | 1.251.833   |
| Vertriebsgebühren  | 6  | 188.575   | –   | 29.988  | 257.674   | 211.184  | 27.982   | –   | 38.630  |
| Verwaltungsgebühren  | 6  | 786.884   | 25.844  | 142.217   | 1.322.602   | 776.349  | 390.982  | 115.789   | 194.084   |
| Bereitstellungsprovision   | 19 | 255.784   | 4.051   | 12.902  | 359.881   | 182.049  | 70.533   | 8.546   | 23.159  |
| Depotgebühren  | 6  | 120.929   | 2.686   | 11.659  | 187.281   | 821.231  | 166.826  | 14.472  | 62.279  |
| Gebühren der Verwahrstelle   | 6  | 84.817  | 1.200   | 5.415   | 121.595   | 46.840   | 30.217   | 3.067   | 8.287   |
| Honorare   | 9  | 299.200   | 12.476  | 100.875   | 429.692   | 320.609  | 168.668  | 39.476  | 170.898   |
| Honorare der Direktoren  | 7  | 3.805   | 1.375   | 4.351   | 4.350   | 4.345  | 4.615  | 4.346   | 4.351   |
| Transaktionskosten   | 9  | 85.505  | 876   | 38.710  | 355.940   | 456.525  | 258.261  | 80.894  | 860.872   |
| Gründungs aufwendungen   | 9  | –   | 31.982  | –   | –   | –  | –  | –   | –   |
| Prüfungshonorare   | 8  | 10.993  | 10.960  | 12.055  | 12.130  | 12.363   | 12.240   | 10.239  | 10.756  |
| Umsatzsteuerentlastung   |    | (15.890)  | (62)  | (876)   | (23.123)  | (11.635)   | (4.408)  | (503)   | (1.214)   |
| Sonstige Aufwendungen  | 9  | 8.913   | 327   | 9.348   | 10.300  | 25.954   | 22.095   | 8.703   | 11.602  |
| Kostenverzicht   | 6  | –   | (151)   | (168.791)   | –   | (107.151)  | (7.876)  | (150.355)   | (246.700)   |
| <b>Aufwendungen insgesamt</b>  |    | 13.404.657  | 368.190   | 885.811   | 21.754.675  | 11.421.471   | 4.415.526  | 423.483   | 2.388.837   |
| <b>Finanzierungskosten</b>   |    |   |   |   |   |  |  |   |   |
| Zinsaufwendungen   |    | 136.189   | 225   | 1.363   | 807   | 38.492   | 9.326  | 4.222   | 1.315   |
| Gezahlte Ausschüttungen  | 1  | 15.938.833  | –   | 203.460   | 34.774.185  | 19.776.443   | 5.146.481  | –   | 211.792   |
|  |    | 16.075.022  | 225   | 204.823   | 34.774.992  | 19.814.935   | 5.155.807  | 4.222   | 213.107   |
| Quellensteuern   | 1  | –   | 13.414  | 235   | 2.125   | 561.616  | 98.515   | 25.749  | 317.037   |
| Kapitalertragsteuer  | 1  | –   | –   | –   | –   | 190.222  | 5.295  | 5.491   | 602.394   |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter<br/>Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der<br/>Geschäftstätigkeit</b>            |    | 124.965.012   | 5.457.030   | 8.656.916   | 297.691.613   | 141.712.762  | 54.178.232   | 3.538.481   | 9.563.366   |

\* Der Developed Market FMP – 2027 wurde am 31. Juli 2023 aufgelegt.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

|  | Anm. | Emerging Markets<br>Select Equity<br>Berichtszeitraum zum<br>31. Dezember<br>2023*<br>US\$ | Euro Bond<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023<br>EUR | Euro Bond<br>Absolute Return<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023<br>EUR | European High<br>Yield Bond<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023<br>EUR | European<br>Sustainable Equity<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023<br>EUR | Event Driven<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$ | Global Bond<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$ | Global Diversified<br>Income FMP –<br>2024<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$ |
|--|------|--|---|--|---|--|---|--|---|
| <b>Erträge</b>   |      |  |   |  |   |  |   |  |   |
| Zinserträge  | 1    | 168.843  | 299.445   | 1.325.303  | 6.144.081   | 46.810   | 531.326   | 4.814.163  | 6.583.236   |
| Dividenderträge  | 1    | 1.307.641  | –   | –  | –   | 2.466.485  | –   | –  | –   |
| Sonstige Erträge   |      | 4.097  | 3.353   | 9.632  | –   | –  | –   | 6.489  | –   |
| Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten | 11   | 2.658.863  | 703.906   | 1.706.179  | 17.258.206  | 29.777.265   | 9.605.231   | 2.834.548  | 3.455.573   |
|  |      | 4.139.444  | 1.006.704   | 3.041.114  | 23.402.287  | 32.290.560   | 10.136.557  | 7.655.200  | 10.038.809  |
| <b>Aufwendungen</b>  |      |  |   |  |   |  |   |  |   |
| Managementgebühr   | 6    | 506.150  | 34.123  | 41.625   | 192.591   | 518.724  | 419.803   | 10.546   | 897.634   |
| Vertriebsgebühren  | 6    | –  | –   | –  | 4.027   | 341  | –   | 5.754  | –   |
| Verwaltungsgebühren  | 6    | 62.348   | 57.348  | 74.539   | 138.341   | 108.783  | 70.949  | 173.685  | 107.262   |
| Bereitstellungsprovision   | 19   | 11.942   | 1.380   | 6.436  | 11.429  | 23.096   | 9.340   | 19.346   | 22.929  |
| Depotgebühren  | 6    | 42.088   | 11.095  | 10.943   | 10.994  | 20.847   | 10.672  | 12.232   | 12.000  |
| Gebühren der Verwahrstelle   | 6    | 3.520  | 551   | 2.475  | 5.939   | 9.116  | 2.953   | 7.665  | 9.030   |
| Honorare   | 9    | 63.180   | 30.275  | 36.460   | 81.370  | 65.478   | 93.976  | 70.705   | 80.075  |
| Honorare der Direktoren  | 7    | 3.502  | 4.346   | 4.349  | 3.759   | 3.967  | 3.597   | 4.351  | 4.378   |
| Erfolgsabhängige Gebühr  | 6    | –  | –   | –  | –   | –  | 1.269.230   | –  | –   |
| Transaktionskosten   | 9    | 408.555  | 13.533  | 31.654   | 26.386  | 151.518  | 25.962  | 94.888   | 4.942   |
| Prüfungshonorare   | 8    | 11.886   | 8.724   | 9.033  | 10.491  | 9.604  | 11.071  | 10.000   | 10.890  |
| Umsatzsteuerentlastung   |      | (472)  | (89)  | (397)  | (746)   | (1.330)  | (695)   | (1.185)  | (1.109)   |
| Sonstige Aufwendungen  | 9    | 9.105  | 9.077   | 9.077  | 11.095  | 8.742  | –   | 9.560  | 6.978   |
| Kostenverzicht   | 6    | (75.080)   | (113.220)   | (84.716)   | (49.387)  | –  | (80.167)  | (99.791)   | –   |
| <b>Aufwendungen insgesamt</b>  |      | 1.046.724  | 57.143  | 141.478  | 446.289   | 918.886  | 1.836.691   | 317.756  | 1.155.009   |
| <b>Finanzierungskosten</b>   |      |  |   |  |   |  |   |  |   |
| Zinsaufwendungen   |      | –  | 49  | 2.740  | 336   | 58   | 160   | 373  | –   |
| Gezahlte Ausschüttungen  | 1    | –  | 198.317   | 160  | 57.021  | 1.048.292  | –   | 2.390  | 3.747.714   |
|  |      | –  | 198.366   | 2.900  | 57.357  | 1.048.350  | 160   | 2.763  | 3.747.714   |
| Quellensteuern   | 1    | 176.255  | –   | –  | 24.070  | 386.738  | 4.281   | 46.961   | 738   |
| Kapitalertragsteuer  | 1    | 153.572  | –   | –  | –   | –  | –   | –  | –   |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit</b>              |      | 2.762.893  | 751.195   | 2.896.736  | 22.874.571  | 29.936.586   | 8.295.425   | 7.287.720  | 5.135.348   |

\* Der Emerging Markets Select Equity wurde am 7. September 2023 aufgelöst.

## Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

|  | Anm. | Global Equity<br>Megatrends<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$ | Global Flexible<br>Credit Income<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$ | Global High Yield<br>Engagement<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$ | Global High Yield<br>Sustainable Action<br>Berichtszeitraum zum<br>31. Dezember<br>2023*<br>US\$ | Global Investment<br>Grade Credit<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$ | Global<br>Opportunistic<br>Bond<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$ | Global Real Estate<br>Securities<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$ | Global Sustainable<br>Equity<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$ |
|--|------|--|---|--|--|--|--|---|---|
| <b>Erträge</b>   |      |  |   |  |  |  |  |   |   |
| Zinserträge  | 1    | 66.717   | 21.820.785  | 30.627.441   | 381.879  | 3.526.734  | 2.880.171  | 39.396  | 58.764  |
| Dividenderträge  | 1    | 1.360.692  | 21.240  | –  | –  | –  | 6.726  | 1.264.200   | 1.296.585   |
| Sonstige Erträge   |      | 6.969  | 84.242  | 38.129   | –  | –  | 46.306   | –   | –   |
| Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten | 11   | 20.285.551   | 35.644.061  | 26.225.288   | 301.287  | 4.608.966  | 1.814.974  | 305.309   | 30.786.664  |
|  |      | 21.719.929   | 57.570.328  | 56.890.858   | 683.166  | 8.135.700  | 4.748.177  | 1.608.905   | 32.142.013  |
| <b>Aufwendungen</b>  |      |  |   |  |  |  |  |   |   |
| Managementgebühr   | 6    | 1.330.600  | 1.581.714   | 1.820.214  | 36.223   | 45.379   | 107.580  | 223.249   | 385.849   |
| Vertriebsgebühren  | 6    | 259.499  | 48.797  | 7.284  | –  | –  | –  | 18.013  | 3.636   |
| Verwaltungsgebühren  | 6    | 121.770  | 203.139   | 338.869  | 70.047   | 105.600  | 160.902  | 81.792  | 110.846   |
| Bereitstellungsprovision   | 19   | 14.348   | 50.956  | 69.680   | 1.194  | 13.918   | 9.516  | 4.522   | 18.864  |
| Depotgebühren  | 6    | 12.097   | 12.177  | 16.554   | 6.000  | 11.989   | 12.081   | 12.000  | 12.000  |
| Gebühren der Verwahrstelle   | 6    | 5.585  | 20.039  | 26.984   | 462  | 6.727  | 3.502  | 1.742   | 7.898   |
| Honorare   | 9    | 66.380   | 81.067  | 133.872  | 38.938   | 4.017  | 57.834   | 71.086  | 70.149  |
| Honorare der Direktoren  | 7    | 4.359  | 4.358   | 4.347  | 2.387  | 4.075  | 4.352  | 4.545   | 4.378   |
| Transaktionskosten   | 9    | 64.743   | 73.004  | 133.254  | 2.818  | 5.693  | 81.558   | 90.308  | 42.340  |
| Prüfungshonorare   | 8    | 10.442   | 17.347  | 11.736   | 10.617   | 10.304   | 10.636   | 10.663  | 10.686  |
| Umsatzsteuerentlastung   |      | (768)  | (2.430)   | (4.135)  | (44)   | (625)  | (641)  | (313)   | (1.027)   |
| Sonstige Aufwendungen  | 9    | 21.064   | 10.197  | 10.004   | 5.115  | 8.276  | 9.387  | 9.598   | 12.831  |
| Kostenverzicht   | 6    | (2)  | –   | (159.267)  | (122.957)  | (43.306)   | (181.897)  | (134.867)   | –   |
| Verzicht auf Gebühren  | 6    | –  | (1.719)   | –  | –  | –  | (544)  | –   | –   |
| <b>Aufwendungen insgesamt</b>  |      | 1.910.117  | 2.098.646   | 2.409.396  | 50.800   | 172.047  | 274.266  | 392.338   | 678.450   |
| <b>Finanzierungskosten</b>   |      |  |   |  |  |  |  |   |   |
| Zinsaufwendungen   |      | 1.660  | 471   | 6  | 29   | 101  | 346  | 182   | 909   |
| Gezahlte Ausschüttungen  | 1    | –  | 18.040  | 364.914  | 289.047  | –  | 309.334  | 290.893   | –   |
|  |      | 1.660  | 18.511  | 364.920  | 289.076  | 101  | 309.680  | 291.075   | 909   |
| Quellensteuern   | 1    | 207.790  | 72.578  | –  | –  | 7.061  | 5.267  | 253.104   | 335.347   |
| Kapitalertragsteuer  | 1    | –  | –   | –  | –  | –  | –  | –   | –   |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit</b>              |      | 19.600.362   | 55.380.593  | 54.116.542   | 343.290  | 7.956.491  | 4.158.964  | 672.388   | 31.127.307  |

\* Der Global High Yield Sustainable Action wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

| Anm.   | Global Value<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$ | High Yield Bond<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$ | InnovAsia<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$ | Japan Equity<br>Engagement<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023<br>JPY | Macro<br>Opportunities FX<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023<br>EUR | Multi-Asset Income<br>Berichtszeitraum zum<br>31. Dezember<br>2023*<br>US\$ | Next Generation<br>Connectivity<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$ | Next Generation<br>Mobility<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$ |            |
|--|---|--|--|--|---|---|--|--|------------|
| <b>Erträge</b>   |   |  |  |  |   |   |  |  |            |
| Zinserträge  | 1   | 13.338   | 149.097.884  | 35.914   | –   | 143.684   | 152.535  | 1.613.265  | 532.771    |
| Dividendenerträge  | 1   | 1.502.022  | 1.147.749  | 254.715  | 476.921.443   | –   | 78.340   | 5.844.061  | 1.435.123  |
| Sonstige Erträge   |   | 4.516  | 528.115  | –  | –   | –   | 185  | –  | –          |
| Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten | 11  | 6.863.427  | 108.102.355  | 5.319.099  | 4.688.235.837   | (734.342)   | 122.062  | 342.688.178  | 41.427.145 |
|  |   | 8.383.303  | 258.876.103  | 5.609.728  | 5.165.157.280   | (590.658)   | 353.122  | 350.145.504  | 43.395.039 |
| <b>Aufwendungen</b>  |   |  |  |  |   |   |  |  |            |
| Managementgebühr   | 6   | 120.957  | 19.351.744   | 204.049  | 76.940.068  | 119.567   | 67.102   | 14.117.852   | 2.204.012  |
| Vertriebsgebühren  | 6   | 4.224  | 1.677.140  | 348  | –   | –   | 16.289   | 647.325  | 365.864    |
| Verwaltungsgebühren  | 6   | 79.855   | 1.505.292  | 74.353   | 15.508.873  | 69.483  | 87.657   | 591.471  | 140.494    |
| Bereitstellungsprovision   | 19  | 5.675  | 316.037  | 2.736  | 3.341.855   | 3.874   | 765  | 187.549  | 23.493     |
| Depotgebühren  | 6   | 11.965   | 30.472   | 12.000   | 2.954.075   | 11.374  | 6.762  | 132.274  | 11.000     |
| Gebühren der Verwahrstelle   | 6   | 2.558  | 126.175  | 1.470  | 1.182.736   | 1.348   | 373  | 60.619   | 7.948      |
| Honorare   | 9   | 64.011   | 520.499  | 39.126   | 9.102.401   | 39.056  | 56.605   | 239.594  | 91.573     |
| Honorare der Direktoren  | 7   | 4.546  | 4.642  | 3.386  | 618.801   | 4.126   | 2.529  | 4.813  | 4.345      |
| Transaktionskosten   | 9   | 116.303  | 238.123  | 147.113  | 33.260.732  | 52.959  | 49.317   | 2.027.737  | 44.253     |
| Prüfungshonorare   | 8   | 10.598   | 19.031   | 10.959   | 1.473.796   | 9.246   | 11.336   | 12.024   | 11.031     |
| Umsatzsteuerentlastung   |   | (429)  | (16.779)   | (146)  | (185.968)   | (203)   | (70)   | (6.953)  | (1.398)    |
| Sonstige Aufwendungen  | 9   | 9.043  | 10.674   | 5.469  | 1.632.029   | 8.734   | 9.625  | 29.234   | 11.418     |
| Kostenverzicht   | 6   | (84.092)   | –  | (165.298)  | –   | (147.827)   | (209.946)  | –  | –          |
| Verzicht auf Gebühren  | 6   | –  | (92.880)   | –  | –   | –   | –  | –  | –          |
| <b>Aufwendungen insgesamt</b>  |   | 345.214  | 23.690.170   | 335.565  | 145.829.398   | 171.737   | 98.344   | 18.043.539   | 2.914.033  |
| <b>Finanzierungskosten</b>   |   |  |  |  |   |   |  |  |            |
| Zinsaufwendungen   |   | 211  | 602  | 79   | 26.240  | 683   | 4.261  | 641  | –          |
| Gezahlte Ausschüttungen  | 1   | –  | 90.271.905   | –  | 111.381.658   | 5   | 6.037  | –  | –          |
|  |   | 211  | 90.272.507   | 79   | 111.407.898   | 688   | 10.298   | 641  | –          |
| Quellensteuern   | 1   | 300.594  | 436.171  | 39.727   | 71.821.634  | –   | 7.307  | 1.253.704  | 277.297    |
| Kapitalertragsteuer  | 1   | 1.449  | –  | (6.993)  | –   | –   | 709  | –  | –          |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit</b>              |   | 7.735.835  | 144.477.255  | 5.241.350  | 4.836.098.350   | (763.083)   | 236.464  | 330.847.620  | 40.203.709 |

\* Der Multi-Asset Income wurde am 6. Juli 2023 aufgelöst.

## Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

|  | Anm. | Next Generation<br>Space Economy<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$ | Short Duration<br>Emerging Market<br>Debt<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$ | Short Duration<br>Euro Bond<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023<br>EUR | Short Duration<br>High Yield<br>Engagement<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$ | Strategic Income<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$ | Sustainable Asia<br>High Yield<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$ | Sustainable<br>Emerging Market<br>Debt - Hard<br>Currency<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$ | Tactical Macro<br>Berichtszeitraum zum<br>31. Dezember<br>2023*<br>US\$ |
|--|------|---|--|---|---|---|---|--|---|
| <b>Erträge</b>   |      |   |  |   |   |   |   |  |   |
| Zinserträge  | 1    | 28.764  | 191.792.317  | 22.390.554  | 42.661.844  | 65.553.584  | 1.607.195   | 17.467.146   | 166.723   |
| Dividendenerträge  | 1    | 147.664   | –  | –   | 76.604  | 46.343  | –   | –  | –   |
| Sonstige Erträge   |      | –   | –  | 120.772   | 113.328   | 112.776   | –   | –  | 9   |
| Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten | 11   | 3.285.903   | 165.739.545  | 37.931.029  | 10.878.844  | 61.142.662  | (630.224)   | 25.660.200   | 608.249   |
|  |      | 3.462.331   | 357.531.862  | 60.442.355  | 53.730.620  | 126.855.365   | 976.971   | 43.127.346   | 774.981   |
| <b>Aufwendungen</b>  |      |   |  |   |   |   |   |  |   |
| Managementgebühr   | 6    | 117.126   | 25.136.609   | 1.387.733   | 4.340.741   | 11.003.160  | 5.539   | 1.328.504  | 128   |
| Vertriebsgebühren  | 6    | 21.123  | 709.836  | 4.291   | 93.159  | 1.010.946   | –   | –  | –   |
| Verwaltungsgebühren  | 6    | 27.041  | 1.974.927  | 415.569   | 451.107   | 1.035.461   | 62.317  | 165.181  | 10.991  |
| Bereitstellungsprovision   | 19   | 1.848   | 665.780  | 122.389   | 93.653  | 214.865   | 4.798   | 44.239   | 901   |
| Depotgebühren  | 6    | 12.000  | 332.711  | 65.319  | 11.823  | 41.717  | 12.000  | 25.904   | 3.056   |
| Gebühren der Verwahrstelle   | 6    | 335   | 212.190  | 47.746  | 37.315  | 85.112  | 2.538   | 19.363   | 317   |
| Honorare   | 9    | 30.501  | 675.369  | 146.359   | 223.122   | 313.343   | 68.178  | 29.187   | 28.467  |
| Honorare der Direktoren  | 7    | 4.416   | 4.793  | 3.874   | 4.351   | 4.334   | 4.416   | 4.416  | 1.849   |
| Transaktionskosten   | 9    | 23.035  | 164.417  | 79.640  | 78.566  | 406.719   | 7.339   | 68.273   | 10.264  |
| Gründungsaufwendungen  | 9    | –   | –  | –   | –   | –   | –   | –  | 31.982  |
| Prüfungshonorare   | 8    | 10.191  | 13.674   | 9.691   | 13.597  | –   | 10.286  | 10.487   | 9.698   |
| Umsatzsteuerentlastung   |      | (103)   | (41.069)   | (8.025)   | (5.980)   | (13.815)  | (207)   | (3.062)  | (13)  |
| Sonstige Aufwendungen  | 9    | 13.171  | 11.556   | 8.586   | 8.457   | 7.962   | 13.150  | 8.515  | 2.527   |
| Kostenverzicht   | 6    | (91.899)  | –  | –   | –   | –   | (138.167)   | (3.326)  | (42.137)  |
| Verzicht auf Gebühren  | 6    | –   | –  | –   | (6.199)   | (3.750)   | –   | –  | –   |
| <b>Aufwendungen insgesamt</b>  |      | 168.785   | 29.860.793   | 2.283.172   | 5.343.712   | 14.106.054  | 52.187  | 1.697.681  | 58.030  |
| <b>Finanzierungskosten</b>   |      |   |  |   |   |   |   |  |   |
| Zinsaufwendungen   |      | –   | 1.763  | –   | –   | 2.784   | –   | 206  | 532   |
| Gezahlte Ausschüttungen  | 1    | –   | 51.357.229   | 70.519  | 10.256.963  | 24.092.142  | 375.442   | –  | –   |
|  |      | –   | 51.358.992   | 70.519  | 10.256.963  | 24.094.926  | 375.442   | 206  | 532   |
| Quellensteuern   | 1    | 23.993  | –  | –   | 39.788  | 432.402   | 7.915   | 253.923  | –   |
| Kapitalertragsteuer  | 1    | –   | –  | –   | –   | (1.377)   | –   | –  | –   |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit</b>              |      | 3.269.553   | 276.312.077  | 58.088.664  | 38.090.157  | 88.223.360  | 541.427   | 41.175.536   | 716.419   |

\* Der Tactical Macro wurde am 30. Juni 2023 aufgelegt.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

|  | Anm. | Uncorrelated Strategies<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$ | Uncorrelated Trading<br>Berichtszeitraum zum<br>31. Dezember<br>2023*<br>US\$ | US Equity<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$ | US Equity Premium<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$ | US Large Cap Value<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$ | US Long Short<br>Equity<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$ | US Multi Cap<br>Opportunities<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$ | US Real Estate<br>Securities<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$ |
|--|------|--|---|--|--|---|--|--|---|
| <b>Erträge</b>   |      |  |   |  |  |   |  |  |   |
| Zinserträge  | 1    | 39.173.095   | 3.569.936   | 66.021   | 7.387.106  | 3.516.594   | 2.214.827  | 76.721   | 787.359   |
| Dividenderträge  | 1    | –  | –   | 367.740  | –  | 51.415.915  | 2.138.898  | 4.926.517  | 21.216.873  |
| Sonstige Erträge   |      | –  | 8.248   | 91   | –  | –   | –  | 24.292   | –   |
| Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum<br>beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen<br>Vermögenswerten und Verbindlichkeiten | 11   | (120.381.469)  | (12.687.726)  | 9.122.314  | 107.636.527  | (71.805.012)  | 27.101.438   | 70.024.943   | 40.971.227  |
|  |      | (81.208.374)   | (9.109.542)   | 9.556.166  | 115.023.633  | (16.872.503)  | 31.455.163   | 75.052.473   | 62.975.459  |
| <b>Aufwendungen</b>  |      |  |   |  |  |   |  |  |   |
| Managementgebühr   | 6    | 15.768.031   | 2.845.723   | 274.888  | 2.839.436  | 10.553.183  | 2.806.305  | 4.999.948  | 7.539.332   |
| Beratungsgebühren  | 6    | 17.684.684   | –   | –  | –  | –   | –  | –  | –   |
| Vertriebsgebühren  | 6    | 147.327  | –   | 15.793   | 11.469   | 271.013   | 33.182   | 427.679  | 1.168.862   |
| Verwaltungsgebühren  | 6    | 2.988.157  | 347.786   | 62.733   | 358.913  | 881.818   | 183.718  | 371.095  | 597.879   |
| Bereitstellungsprovision   | 19   | 360.886  | 54.101  | 5.066  | 91.827   | 284.218   | 36.599   | 58.199   | 79.342  |
| Depotgebühren  | 6    | 269.480  | 62.274  | 11.931   | 12.023   | 28.415  | 12.001   | 11.999   | 11.435  |
| Gebühren der Verwahrstelle   | 6    | 245.133  | 45.183  | 1.972  | 32.487   | 110.626   | 8.475  | 23.513   | 27.347  |
| Honorare   | 9    | 1.004.200  | 68.646  | 43.779   | 180.390  | 326.808   | 111.907  | 188.172  | 219.239   |
| Honorare der Direktoren  | 7    | 4.626  | 2.397   | 4.544  | 4.012  | 4.416   | 4.550  | 4.779  | 4.352   |
| Erfolgsabhängige Gebühr  | 6    | –  | –   | –  | –  | –   | 284.324  | –  | –   |
| Transaktionskosten   | 9    | 15.052.935   | 1.040.744   | 14.565   | 116.951  | 981.117   | 114.629  | 204.132  | 406.687   |
| Prüfungshonorare   | 8    | 10.345   | 9.096   | 9.938  | 11.147   | 11.012  | 11.208   | 12.169   | 12.731  |
| Umsatzsteuerentlastung   |      | (17.461)   | (1.707)   | (347)  | (6.201)  | (15.584)  | (1.977)  | (3.717)  | (5.129)   |
| Sonstige Aufwendungen  | 9    | 5.336.209  | 287.263   | 8.895  | 8.582  | 19.767  | 11.593   | 9.681  | 10.176  |
| Kostenverzicht   | 6    | (30.083)   | (155.312)   | (72.815)   | –  | –   | –  | –  | –   |
| <b>Aufwendungen insgesamt</b>  |      | 58.824.469   | 4.606.194   | 380.942  | 3.661.036  | 13.456.809  | 3.616.514  | 6.307.649  | 10.072.253  |
| <b>Finanzierungskosten</b>   |      |  |   |  |  |   |  |  |   |
| Zinsaufwendungen   |      | 170.739  | 82.590  | 1.581  | –  | –   | 3.963  | 1.130  | –   |
| Gezahlte Ausschüttungen  | 1    | –  | –   | –  | 1.591.989  | 10.005.741  | 206.378  | 12.800   | 4.675.054   |
|  |      | 170.739  | 82.590  | 1.581  | 1.591.989  | 10.005.741  | 210.341  | 13.930   | 4.675.054   |
| Quellensteuern   | 1    | 8.614.771  | 367.188   | 107.017  | –  | 14.056.234  | 628.112  | 1.411.773  | 5.817.425   |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter<br/>Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der<br/>Geschäftstätigkeit</b>            |      | (148.818.353)  | (14.165.514)  | 9.066.626  | 109.770.608  | (54.391.287)  | 27.000.196   | 67.319.121   | 42.410.727  |

\* Der Uncorrelated Trading wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

## Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

| Anm.   | US Small Cap                                      | US Small Cap   | Fonds insgesamt*                                  |               |
|--|---|--|---|---------------|
|  | Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$ | Intrinsic Value<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$ | Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023<br>US\$ |               |
| <b>Erträge</b>   |   |  |   |               |
| Zinserträge  | 1   | 507.554  | 977.188   | 995.771.322   |
| Dividendenerträge  | 1   | 6.044.808  | 1.760.459   | 119.445.636   |
| Sonstige Erträge   |   | 43.524   | –   | 2.650.276     |
| Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten | 11  | 86.161.892   | 34.297.130  | 1.584.823.295 |
|  |   | 92.757.778   | 37.034.777  | 2.702.690.529 |
| <b>Aufwendungen</b>  |   |  |   |               |
| Managementgebühr   | 6   | 5.957.709  | 2.190.026   | 194.432.180   |
| Beratungsgebühren  | 6   | –  | –   | 17.684.684    |
| Vertriebsgebühren  | 6   | 191.973  | 4.501   | 7.946.225     |
| Verwaltungsgebühren  | 6   | 406.184  | 180.153   | 19.659.563    |
| Bereitstellungsprovision   | 19  | 90.926   | 36.673  | 4.139.264     |
| Depotgebühren  | 6   | 11.971   | 11.950  | 2.966.123     |
| Gebühren der Verwahrstelle   | 6   | 27.463   | 14.201  | 1.615.560     |
| Honorare   | 9   | 215.352  | 96.440  | 8.275.274     |
| Honorare der Direktoren  | 7   | 4.351  | 4.416   | 234.165       |
| Erfolgsabhängige Gebühr  | 6   | –  | –   | 1.553.554     |
| Transaktionskosten   | 9   | 239.541  | 99.564  | 26.064.424    |
| Gründungsaufwendungen  | 9   | –  | –   | 96.694        |
| Prüfungshonorare   | 8   | 11.044   | 10.448  | 627.861       |
| Umsatzsteuerentlastung   |   | (5.515)  | (2.289)   | (240.259)     |
| Sonstige Aufwendungen  | 9   | 12.865   | 20.882  | 6.232.386     |
| Kostenverzicht   | 6   | –  | –   | (3.529.280)   |
| Verzicht auf Gebühren  | 6   | –  | –   | (105.092)     |
| <b>Aufwendungen insgesamt</b>  |   | 7.163.864  | 2.666.965   | 287.653.326   |
| <b>Finanzierungskosten</b>   |   |  |   |               |
| Zinsaufwendungen   |   | 1.960  | –   | 485.899       |
| Gezahlte Ausschüttungen  | 1   | –  | –   | 287.094.911   |
|  |   | 1.960  | –   | 287.580.810   |
| Quellensteuern   | 1   | 1.757.033  | 458.379   | 39.795.504    |
| Kapitalertragsteuer  | 1   | –  | –   | 950.762       |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit</b>              |   | 83.834.921   | 33.909.433  | 2.086.710.127 |

Alle Erträge und Aufwendungen ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit – mit Ausnahme des Absolute Return Multi Strategy, Emerging Markets Select Equity, Global High Yield Sustainable Action, Multi-Asset Income, Uncorrelated Trading und Macro Opportunities FX, die am 20. Dezember 2021, 7. September 2023, 16. Juni 2023, 6. Juli 2023, 24. Mai 2023 bzw. 8. Februar 2024 aufgelöst wurden. Außer den in der konsolidierten Gewinn- und Verlustrechnung ausgewiesenen gab es keine Gewinne und Verluste im Geschäftsjahr.

\* Der konsolidierte Abschluss wurde um Überkreuzinvestitionen zwischen den Portfolios bereinigt. Details zu Überkreuzinvestitionen zwischen Portfolios sind Anmerkung 10 der Anmerkungen zum geprüften Jahresabschluss zu entnehmen.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

# Aufstellungen über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens

|   | Absolute Return Multi Strategy       | Asia Responsible Transition Bond    | China A-Share Equity                | China Bond                          | China Equity                        | Climate Innovation                  | CLO Income                          | Commodities                         |
|---|--------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
|   | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024* | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024 |
| Anm.  | US\$                                 | US\$                                | CNY                                 | CNY                                 | US\$                                | US\$                                | US\$                                | US\$                                |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b> | –                                    | 63.941.864                          | 14.213.832                          | 458.846.108                         | 178.226.287                         | 2.922.555                           | 185.646.305                         | 153.646.559                         |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit        | –                                    | 3.925.802                           | 559.642                             | 18.596.476                          | 24.302.421                          | 158.921                             | 49.869.752                          | 8.350.344                           |
| Zeichnungen   | 5                                    | 9.491.467                           | –                                   | 1.625.611                           | 435.983                             | –                                   | 950.520.681                         | 105.633.155                         |
| Rücknahmen  | 5                                    | (48.822.472)                        | (110.773)                           | (353.334.331)                       | (65.149.943)                        | –                                   | (114.899.233)                       | (112.521.468)                       |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>   | –                                    | 28.536.661                          | 14.662.701                          | 125.733.864                         | 137.814.748                         | 3.081.476                           | 1.071.137.505                       | 155.108.590                         |

|   | Corporate Hybrid Bond               | Developed Market FMP – 2027         | EMD Corporate – Social and Environmental Transition | Emerging Market Debt - Hard Currency | Emerging Market Debt - Local Currency | Emerging Market Debt Blend          | Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend | Emerging Markets Equity             |
|---|-------------------------------------|-------------------------------------|---|--------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|---|-------------------------------------|
|   | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024                 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024  | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024   | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024                     | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024 |
| Anm.  | EUR                                 | US\$                                | US\$  | US\$                                 | US\$                                  | US\$                                | US\$  | US\$                                |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b> | 1.869.816.463                       | 137.457.819                         | 97.789.137  | 2.649.818.655                        | 1.285.867.647                         | 526.787.807                         | 65.067.549  | 90.687.501                          |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit        | 180.532.330                         | 5.247.110                           | 2.227.673   | 210.882.608                          | (60.321.869)                          | (8.314.401)                         | (4.279.077)   | 17.765.863                          |
| Zeichnungen   | 5                                   | 986.224.146                         | –   | 33.020.224                           | 954.626.647                           | 164.324.305                         | 80.063.236  | 48.067.906                          |
| Rücknahmen  | 5                                   | (693.281.667)                       | (15.315.736)  | (19.316.406)                         | (1.110.889.316)                       | (313.489.031)                       | (82.228.490)  | (51.956.175)                        |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>   | 2.343.291.272                       | 127.389.193                         | 113.720.628   | 2.704.438.594                        | 1.076.381.052                         | 516.308.152                         | 57.496.708  | 104.565.095                         |

\* Der Absolute Return Multi Strategy wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

## Aufstellungen über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens (Fortsetzung)

|   |      | Euro Bond<br>Absolute Return              | European High<br>Yield Bond               | European<br>Sustainable Equity            | Event Driven                              | Global Bond                               | Global Diversified<br>Income FMP – 2024    | Global Equity<br>Megatrends               |              |
|---|------|---|---|---|---|---|--|---|--------------|
|   | Anm. | Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024 | Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024 | Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024 | Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024 | Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024 | Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024* | Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024 |              |
|   |      | EUR                                       | EUR                                       | EUR                                       | EUR                                       | US\$                                      | US\$                                       | US\$                                      |              |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter<br/>Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des<br/>Geschäftsjahres</b> |      | 10.573.094                                | 34.026.827                                | 408.416.317                               | 172.097.551                               | 126.412.148                               | 108.742.800                                | 156.199.653                               | 144.482.856  |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile<br>entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit             |      | 2.098.682                                 | 7.025.701                                 | 49.165.695                                | 9.320.823                                 | 5.844.221                                 | (1.222.622)                                | 1.838.691                                 | 42.689.612   |
| Zeichnungen   | 5    | 62.173.295                                | 48.266.760                                | 296.748.899                               | 4.311.698                                 | 219.482.497                               | 12.937.629                                 | 14.729                                    | 401.542.114  |
| Rücknahmen  | 5    | (4.444.539)                               | (797.114)                                 | (193.577.357)                             | (37.230.039)                              | (67.742.175)                              | (18.715.549)                               | (158.053.073)                             | (70.089.955) |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter<br/>Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des<br/>Geschäftsjahres</b>   |      | 70.400.532                                | 88.522.174                                | 560.753.554                               | 148.500.033                               | 283.996.691                               | 101.742.258                                | –   | 518.624.627  |

|   |      | Global Flexible<br>Credit Income          | Global High Yield<br>Engagement           | Global Investment<br>Grade Credit         | Global<br>Opportunistic Bond              | Global Real Estate<br>Securities            | Global Sustainable<br>Equity              | Global Value                              | High Yield Bond                           |
|---|------|---|---|---|---|---|---|---|---|
|   | Anm. | Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024 | Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024 | Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024 | Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024 | Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024** | Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024 | Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024 | Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2024 |
|   |      | US\$                                      | US\$                                      | US\$                                      | US\$                                      | US\$  | US\$                                      | US\$                                      | US\$                                      |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter<br/>Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des<br/>Geschäftsjahres</b> |      | 390.612.981                               | 558.163.905                               | 86.777.825                                | 65.409.763                                | 20.460.013                                  | 154.573.295                               | 55.465.894                                | 2.251.810.719                             |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile<br>entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit             |      | 29.091.331                                | 32.999.470                                | 51.950                                    | 1.485.031                                 | (526.187)                                   | 12.050.789                                | 7.300.339                                 | 21.196.894                                |
| Zeichnungen   | 5    | 77.323.125                                | 158.480.178                               | 107.691.581                               | 23.873.742                                | 5.625.919                                   | 40.749.320                                | 33.884.074                                | 449.011.246                               |
| Rücknahmen  | 5    | (52.167.169)                              | (136.077.572)                             | (14.650.440)                              | (22.879.714)                              | (25.559.745)                                | (66.948.709)                              | (50.004.531)                              | (822.810.921)                             |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter<br/>Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des<br/>Geschäftsjahres</b>   |      | 444.860.268                               | 613.565.981                               | 179.870.916                               | 67.888.822                                | –   | 140.424.695                               | 46.645.776                                | 1.899.207.938                             |

\* Der Global Diversified Income FMP – 2024 wurde am 28. Juni 2024 aufgelöst.

\* Der Global Real Estate Securities wurde am 31. Dezember 2024 aufgelöst.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Aufstellungen über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens (Fortsetzung)

|   | InnovAsia                           | Japan Equity Engagement             | Macro Opportunities FX               | Next Generation Connectivity        | Next Generation Mobility            | Next Generation Space Economy       | Short Duration Emerging Market Debt | Short Duration Euro Bond            |
|---|-------------------------------------|-------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| Anm.  | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024* | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024 |
|   | US\$                                | JPY                                 | EUR                                  | US\$                                | US\$                                | US\$                                | US\$                                | EUR                                 |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b> | 23.770.120                          | 16.177.528.715                      | 2.881.806                            | 1.043.526.943                       | 164.356.065                         | 19.743.930                          | 3.954.769.567                       | 992.872.298                         |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit        | 1.307.700                           | 2.736.754.546                       | 10.036                               | 308.055.165                         | (1.995.020)                         | 7.058.584                           | 69.656.083                          | 91.035.999                          |
| Zeichnungen   | 5 757.941                           | 11.288.981.155                      | 40.978                               | 433.764.717                         | 32.162.640                          | 38.226.094                          | 1.028.258.493                       | 1.144.400.764                       |
| Rücknahmen  | 5 (11.696.723)                      | (5.970.628.822)                     | (2.932.820)                          | (722.162.863)                       | (71.730.185)                        | (6.164.389)                         | (1.277.008.857)                     | (347.686.679)                       |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>   | 14.139.038                          | 24.232.635.594                      | –                                    | 1.063.183.962                       | 122.793.500                         | 58.864.219                          | 3.775.675.286                       | 1.880.622.382                       |

|   | Short Duration High Yield Engagement | Strategic Income                    | Sustainable Asia High Yield         | Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency | Tactical Macro                      | Uncorrelated Strategies             | US Equity                           | US Equity Premium                   |
|---|--------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|--|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| Anm.  | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024  | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024              | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024 |
|   | US\$                                 | US\$                                | US\$                                | US\$   | US\$                                | US\$                                | US\$                                | US\$                                |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b> | 744.434.447                          | 2.019.603.581                       | 28.564.951                          | 445.892.270                                      | 27.162.308                          | 1.626.701.421                       | 49.202.149                          | 729.098.000                         |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit        | 827.087                              | (46.680.034)                        | 3.777.834                           | 19.078.969                                       | 1.401.748                           | 22.099.459                          | 10.221.926                          | 80.572.432                          |
| Zeichnungen   | 5 179.294.664                        | 3.889.519.910                       | 23.428.811                          | 169.644.201                                      | 7.933.126                           | 193.938.922                         | 103.469.539                         | 372.310.590                         |
| Rücknahmen  | 5 (379.242.003)                      | (1.225.613.315)                     | (23.927.195)                        | (36.024.458)                                     | (494.416)                           | (1.035.898.377)                     | (55.826.579)                        | (522.937.028)                       |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>   | 545.314.195                          | 4.636.830.142                       | 31.844.401                          | 598.590.982                                      | 36.002.766                          | 806.841.425                         | 107.067.035                         | 659.043.994                         |

\* Der Macro Opportunities FX wurde am 8. Februar 2024 aufgelöst.

## Aufstellungen über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens (Fortsetzung)

|   | US Large Cap Value | US Long Short Equity | US Multi Cap Opportunities | US Real Estate Securities | US Small Cap      | US Small Cap Intrinsic Value | Fonds insgesamt*  |
|---|--------------------|----------------------|----------------------------|---------------------------|-------------------|------------------------------|-------------------|
|   | Geschäftsjahr zum  | Geschäftsjahr zum    | Geschäftsjahr zum          | Geschäftsjahr zum         | Geschäftsjahr zum | Geschäftsjahr zum            | Geschäftsjahr zum |
| Anm.  | 31. Dezember       | 31. Dezember         | 31. Dezember               | 31. Dezember              | 31. Dezember      | 31. Dezember                 | 31. Dezember      |
|   | 2024               | 2024                 | 2024                       | 2024                      | 2024              | 2024                         | 2024              |
|   | US\$               | US\$                 | US\$                       | US\$                      | US\$              | US\$                         | US\$              |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b> | 1.939.190.378      | 195.470.291          | 400.492.035                | 533.109.985               | 633.851.769       | 321.568.617                  | 28.324.332.756    |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit        | 98.749.557         | 5.631.949            | 61.759.169                 | 2.147.726                 | 33.010.431        | 26.367.022                   | 1.485.451.924     |
| Wechselkursbewegung   | 15                 | –                    | –                          | –                         | –                 | –                            | (329.834.723)     |
| Zeichnungen   | 5                  | 339.412.736          | 90.103.928                 | 158.816.418               | 163.852.076       | 131.698.405                  | 14.588.482.729    |
| Rücknahmen  | 5                  | (1.358.922.490)      | (64.694.091)               | (235.182.830)             | (262.736.270)     | (79.220.819)                 | (12.534.471.186)  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>   | 1.018.430.181      | 226.512.077          | 385.884.792                | 436.373.517               | 888.538.422       | 400.413.225                  | 31.533.961.500    |

\* Der konsolidierte Abschluss wurde um Überkreuzinvestitionen zwischen den Portfolios bereinigt. Details zu Überkreuzinvestitionen zwischen Portfolios sind Anmerkung 10 der Anmerkungen zum geprüften Jahresabschluss zu entnehmen.

## Aufstellungen über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens (Fortsetzung)

|   | Absolute Return<br>Multi Strategy          | Asia Responsible<br>Transition Bond       | China A-Share<br>Equity                   | China Bond                                | China Equity                              | Climate Innovation<br>Berichtszeitraum<br>zum<br>31. Dezember<br>2023** | CLO Income                                | Commodities                               |
|---|--|---|---|---|---|---|---|---|
| Anm.  | Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023* | Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023 | Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023 | Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023 | Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023 | Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023**                             | Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023 | Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023 |
|   | US\$                                       | US\$                                      | CNY                                       | CNY                                       | US\$                                      | US\$  | US\$                                      | US\$                                      |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b> | –  | 21.626.209                                | 16.241.758                                | 453.043.579                               | 317.413.676                               | –   | 138.037.464                               | 85.997.429                                |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit        | –  | 2.750.828                                 | (2.027.926)                               | 37.288.963                                | (63.785.405)                              | (107.445)   | 21.699.437                                | (6.936.475)                               |
| Zeichnungen   | 5  | 50.126.106                                | –   | 802.851                                   | 13.990.560                                | 3.030.000   | 85.952.524                                | 94.882.598                                |
| Rücknahmen  | 5  | (10.561.279)                              | –   | (32.289.285)                              | (89.392.544)                              | –   | (60.043.120)                              | (20.296.993)                              |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>   | –  | 63.941.864                                | 14.213.832                                | 458.846.108                               | 178.226.287                               | 2.922.555   | 185.646.305                               | 153.646.559                               |

|   | Corporate<br>Hybrid Bond                  | Developed Market<br>FMP – 2027<br>Berichtszeitraum<br>zum<br>31. Dezember<br>2023*** | EMD Corporate –<br>Social and<br>Environmental<br>Transition | Emerging Market<br>Debt - Hard<br>Currency | Emerging Market<br>Debt - Local<br>Currency | Emerging Market<br>Debt Blend             | Emerging Market<br>Debt Sustainable<br>Investment Grade<br>Blend | Emerging Markets<br>Equity                |
|---|---|--|--|--|---|---|--|---|
| Anm.  | Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023 | Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023***   | Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023                    | Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023  | Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023   | Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023 | Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023                        | Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023 |
|   | EUR                                       | US\$   | US\$   | US\$                                       | US\$  | US\$                                      | US\$   | US\$                                      |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b> | 1.782.154.808                             | –  | 98.244.308   | 2.491.704.928                              | 1.386.264.443                               | 470.181.480                               | 54.274.381   | 191.807.755                               |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit        | 124.965.012                               | 5.457.030  | 8.656.916  | 297.691.613                                | 141.712.762                                 | 54.178.232                                | 3.538.481  | 9.563.366                                 |
| Zeichnungen   | 5   | 657.882.054  | 138.602.529  | 5.980.010                                  | 1.047.274.763                               | 231.862.147                               | 53.127.987   | 87.850.549                                |
| Rücknahmen  | 5   | (695.185.411)  | (6.601.740)  | (15.092.097)                               | (1.186.852.649)                             | (122.477.608)                             | (45.873.300)   | (198.534.169)                             |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>   | 1.869.816.463                             | 137.457.819  | 97.789.137   | 2.649.818.655                              | 1.285.867.647                               | 526.787.807                               | 65.067.549   | 90.687.501                                |

\* Der Absolute Return Multi Strategy wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

\*\* Der Climate Innovation wurde am 1. August 2023 aufgelegt.

\*\*\* Der Neuberger Berman Developed Market FMP – 2027 wurde am 31. Juli 2023 aufgelegt.

## Aufstellungen über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens (Fortsetzung)

|   | Emerging Markets<br>Select Equity<br>Berichtszeitraum<br>zum<br>31. Dezember<br>2023* | Euro<br>Bond<br>zum<br>31. Dezember<br>2023 | Euro Bond<br>Absolute Return<br>zum<br>31. Dezember<br>2023 | European High<br>Yield Bond<br>zum<br>31. Dezember<br>2023 | European<br>Sustainable Equity<br>zum<br>31. Dezember<br>2023 | Event Driven<br>zum<br>31. Dezember<br>2023 | Global Bond<br>zum<br>31. Dezember<br>2023 | Global Diversified<br>Income FMP – 2024<br>zum<br>31. Dezember<br>2023 |
|---|---|---|---|--|---|---|--|--|
| Anm.  | US\$  | EUR   | EUR   | EUR  | EUR   | US\$  | US\$                                       | US\$   |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b> | 93.762.122  | 9.294.742                                   | 48.527.876  | 32.454.528   | 175.854.230   | 41.446.672                                  | 134.811.296                                | 160.396.086  |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit        | 2.762.893   | 751.195                                     | 2.896.736   | 22.874.571   | 29.936.586  | 8.295.425                                   | 7.287.720                                  | 5.135.348  |
| Zeichnungen   | 5 901.671   | 527.157                                     | 691.146   | 373.361.838  | 27.413.412  | 105.767.010                                 | 12.172.804                                 | 36.761   |
| Rücknahmen  | 5 (97.426.686)  | –   | (18.088.931)  | (20.274.620)   | (61.106.677)  | (29.096.959)                                | (45.529.020)                               | (9.368.542)  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>   | –   | 10.573.094                                  | 34.026.827  | 408.416.317  | 172.097.551   | 126.412.148                                 | 108.742.800                                | 156.199.653  |

|   | Global Equity<br>Megatrends<br>zum<br>31. Dezember<br>2023 | Global Flexible<br>Credit Income<br>zum<br>31. Dezember<br>2023 | Global High Yield<br>Engagement<br>zum<br>31. Dezember<br>2023 | Global High Yield<br>Sustainable Action<br>Berichtszeitraum<br>zum<br>31. Dezember<br>2023** | Global Investment<br>Grade Credit<br>zum<br>31. Dezember<br>2023 | Global<br>Opportunistic Bond<br>zum<br>31. Dezember<br>2023 | Global<br>Real Estate<br>Securities<br>zum<br>31. Dezember<br>2023 | Global Sustainable<br>Equity<br>zum<br>31. Dezember<br>2023 |
|---|--|---|--|--|--|---|--|---|
| Anm.  | US\$   | US\$  | US\$   | US\$   | US\$   | US\$  | US\$   | US\$  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b> | 79.344.365   | 394.526.329   | 336.953.378  | 15.047.068   | 85.908.642   | 76.105.443  | 39.022.420   | 131.578.199   |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit        | 19.600.362   | 55.380.593  | 54.116.542   | 343.290  | 7.956.491  | 4.158.964   | 672.388  | 31.127.307  |
| Zeichnungen   | 5 73.983.326   | 52.117.731  | 246.709.213  | –  | 484.692  | 4.389.912   | 2.913.943  | 18.111.427  |
| Rücknahmen  | 5 (28.445.197)   | (111.411.672)   | (79.615.228)   | (15.390.358)   | (7.572.000)  | (19.244.556)  | (22.148.738)   | (26.243.638)  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>   | 144.482.856  | 390.612.981   | 558.163.905  | –  | 86.777.825   | 65.409.763  | 20.460.013   | 154.573.295   |

\* Der Emerging Markets Select Equity wurde am 7. September 2023 aufgelöst.

\*\* Der Global High Yield Sustainable Action wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Aufstellungen über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens (Fortsetzung)

|   | Global Value                        | High Yield Bond                     | InnovAsia                           | Japan Equity Engagement             | Macro Opportunities FX              | Multi-Asset Income Berichtszeitraum | Next Generation Connectivity        | Next Generation Mobility            |
|---|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
|   | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 | zum 31. Dezember 2023*              | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 |
| Anm.  | US\$                                | US\$                                | US\$                                | JPY                                 | EUR                                 | US\$                                | US\$                                | US\$                                |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b> | 48.024.441                          | 2.298.751.712                       | 14.748.993                          | 20.542.667.585                      | 31.510.156                          | 11.366.115                          | 993.010.193                         | 148.004.677                         |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit        | 7.735.835                           | 144.477.255                         | 5.241.350                           | 4.836.098.350                       | (763.083)                           | 236.464                             | 330.847.620                         | 40.203.709                          |
| Zeichnungen   | 5 14.627.475                        | 561.207.918                         | 6.477.592                           | 7.483.761.065                       | 8.167.159                           | 24.302                              | 94.038.379                          | 24.503.776                          |
| Rücknahmen  | 5 (14.921.857)                      | (752.626.166)                       | (2.697.815)                         | (16.684.998.285)                    | (36.032.426)                        | (11.626.881)                        | (374.369.249)                       | (48.356.097)                        |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>   | 55.465.894                          | 2.251.810.719                       | 23.770.120                          | 16.177.528.715                      | 2.881.806                           | –                                   | 1.043.526.943                       | 164.356.065                         |

|   | Next Generation Space Economy       | Short Duration Emerging Market Debt | Short Duration Euro Bond            | Short Duration High Yield Engagement | Strategic Income                    | Sustainable Asia High Yield         | Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency | Tactical Macro Berichtszeitraum |
|---|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|--|---------------------------------|
|   | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023  | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 | Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023              | zum 31. Dezember 2023**         |
| Anm.  | US\$                                | US\$                                | EUR                                 | US\$                                 | US\$                                | US\$                                | US\$   | US\$                            |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b> | 8.490.862                           | 5.124.661.750                       | 821.390.067                         | 556.373.679                          | 1.322.805.855                       | 31.922.271                          | 158.420.594                                      | –                               |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit        | 3.269.553                           | 276.312.077                         | 58.088.664                          | 38.090.157                           | 88.223.360                          | 541.427                             | 41.175.536                                       | 716.419                         |
| Zeichnungen   | 5 8.813.182                         | 913.802.369                         | 466.117.965                         | 477.921.105                          | 1.129.764.227                       | 21.287                              | 350.525.367                                      | 26.445.889                      |
| Rücknahmen  | 5 (829.667)                         | (2.360.006.629)                     | (352.724.398)                       | (327.950.494)                        | (521.189.861)                       | (3.920.034)                         | (104.229.227)                                    | –                               |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>   | 19.743.930                          | 3.954.769.567                       | 992.872.298                         | 744.434.447                          | 2.019.603.581                       | 28.564.951                          | 445.892.270                                      | 27.162.308                      |

\* Der Multi-Asset Income wurde am 6. Juli 2023 aufgelöst.

\*\* Der Tactical Macro wurde am 30. Juni 2023 aufgelegt.

## Aufstellungen über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens (Fortsetzung)

|   | Uncorrelated<br>Strategies | Uncorrelated<br>Trading<br>Berichtszeitraum<br>zum<br>31. Dezember<br>2023 * | US Equity<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023 | US Equity Premium<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023 | US Large Cap Value<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023 | US Long Short<br>Equity<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023 | US Multi Cap<br>Opportunities<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023 | US Real Estate<br>Securities<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023 |
|---|----------------------------|--|--|--|---|--|--|---|
| Anm.  | US\$                       | US\$   | US\$   | US\$   | US\$  | US\$   | US\$   | US\$  |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b> | 3.130.486.982              | 711.942.710  | 31.464.829   | 680.456.738  | 1.767.954.359   | 221.529.901  | 441.315.950  | 648.025.795   |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit        | (148.818.353)              | (14.165.514)   | 9.066.626  | 109.770.608  | (54.391.287)  | 27.000.196   | 67.319.121   | 42.410.727  |
| Zeichnungen   | 5 901.511.546              | 11.358.695   | 10.264.274   | 214.235.309  | 791.197.422   | 53.782.532   | 97.292.578   | 93.896.935  |
| Rücknahmen  | 5 (2.256.478.754)          | (709.135.891)  | (1.593.580)  | (275.364.655)  | (565.570.116)   | (106.842.338)  | (205.435.614)  | (251.223.472)   |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>   | 1.626.701.421              | –  | 49.202.149   | 729.098.000  | 1.939.190.378   | 195.470.291  | 400.492.035  | 533.109.985   |

|   | US Small Cap<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023 | US Small Cap<br>Intrinsic Value<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023 | Fonds insgesamt**<br>Geschäftsjahr zum<br>31. Dezember<br>2023 |
|---|---|--|--|
| Anm.  | US\$  | US\$   | US\$   |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b> | 592.378.667   | 194.041.040  | 29.114.382.221   |
| Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit        | 83.834.921  | 33.909.433   | 2.086.710.127  |
| Wechselkursbewegung   | 15 –  | –  | 111.001.114  |
| Zeichnungen   | 5 148.231.776   | 127.106.174  | 10.224.468.692   |
| Rücknahmen  | 5 (190.593.595)   | (33.488.030)   | (13.212.229.398)   |
| <b>Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>   | 633.851.769   | 321.568.617  | 28.324.332.756   |

\* Der Uncorrelated Trading wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

\*\* Der konsolidierte Jahresabschluss wurde um Überkreuzinvestitionen zwischen den Portfolios bereinigt. Details zu Überkreuzinvestitionen zwischen Portfolios sind Anmerkung 10 der Anmerkungen zum geprüften Jahresabschluss zu entnehmen.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

## Aufstellungen der wesentlichen Käufe und Verkäufe (ungeprüft)

In Einklang mit den EG-Richtlinien über Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren („European Communities (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations, 2011“) (in ihrer geltenden Fassung) wird eine Aufstellung über die Entwicklung der Zusammensetzung des Wertpapierbestands im Berichtszeitraum vorgelegt, um sicherzustellen, dass die Anteilhaber Veränderungen in den vom Portfolio gehaltenen Anlagen identifizieren können. Die folgenden Aufstellungen geben die gesamten Käufe und Verkäufe von Wertpapieren, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe und Verkäufe im Berichtszeitraum übersteigen, wieder. Es werden mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe aufgeführt, falls zutreffend.

### Asia Responsible Transition Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung  | Kosten US\$ |
|---------|--|-------------|
| 840.000 | Pakistan Government International Bond, 6.00%, 08/04/2026            | 771.120     |
| 700.000 | China Cinda 2020 I Management Ltd, 5.50%, 23/01/2030                 | 697.950     |
| 650.000 | CFAMC III Co Ltd, 4.25%, 07/11/2027                                  | 592.703     |
| 500.000 | Philippine Government International Bond, 5.18%, 05/09/2049          | 500.000     |
| 500.000 | Shriram Finance Ltd, 6.63%, 22/04/2027                               | 499.805     |
| 500.000 | Cathaylife Singapore Pte Ltd, 5.95%, 05/07/2034                      | 498.585     |
| 457.000 | AIA Group Ltd, 5.38%, 05/04/2034                                     | 452.823     |
| 450.000 | FWD Group Holdings Ltd, 7.64%, 02/07/2031                            | 450.000     |
| 400.000 | Vedanta Resources Finance II Plc, 10.88%, 17/09/2029                 | 404.480     |
| 400.000 | Development Bank of Mongolia LLC, 11.00%, 07/03/2026                 | 401.400     |
| 400.000 | HDFC Bank Ltd, 5.18%, 15/02/2029                                     | 400.000     |
| 400.000 | Woori Bank, 6.38%, 31/12/2149  | 400.000     |
| 400.000 | Hyundai Capital Services Inc, 5.13%, 05/02/2027                      | 398.912     |
| 400.000 | Korea Gas Corp, 5.00%, 08/07/2029                                    | 398.776     |
| 400.000 | Metropolitan Bank & Trust Co, 5.50%, 06/03/2034                      | 398.080     |
| 400.000 | State Bank of India, 5.00%, 17/01/2029                               | 398.044     |
| 400.000 | Hyundai Card Co Ltd, 5.75%, 24/04/2029                               | 395.228     |
| 400.000 | Bank of East Asia Ltd, 5.83%, 31/12/2149                             | 392.360     |
| 400.000 | Fortune Star BVI Ltd, 5.95%, 19/10/2025                              | 382.000     |
| 400.000 | Fortune Star BVI Ltd, 5.00%, 18/05/2026                              | 374.180     |
| 500.000 | NWD Finance BVI Ltd, 5.25%, 31/12/2149                               | 374.000     |
| 375.000 | Bank of East Asia Ltd, 6.75%, 27/06/2034                             | 373.560     |
| 400.000 | GLP Pte Ltd, 3.88%, 04/06/2025                                       | 368.180     |
| 400.000 | GLP China Holdings Ltd, 2.95%, 29/03/2026                            | 349.800     |
| 400.000 | China Overseas Grand Oceans Finance IV Cayman Ltd, 2.45%, 09/02/2026 | 346.398     |
| 640.000 | Sri Lanka Government International Bond, 6.75%, 18/04/2028           | 338.080     |
| 500.000 | Vanke Real Estate Hong Kong Co Ltd, 3.98%, 09/11/2027                | 321.375     |
| 313.000 | IRB Infrastructure Developers Ltd, 7.11%, 11/03/2032                 | 312.740     |
| 400.000 | Franshion Brilliant Ltd, 4.25%, 23/07/2029                           | 308.500     |
| 300.000 | FWD Group Holdings Ltd, 8.40%, 05/04/2029                            | 306.225     |
| 300.000 | LG Electronics Inc, 5.63%, 24/04/2027                                | 298.800     |
| 300.000 | SK Hynix Inc, 5.50%, 16/01/2029                                      | 298.644     |
| 300.000 | Zhongsheng Group Holdings Ltd, 5.98%, 30/01/2028                     | 297.405     |
| 300.000 | CAS Capital No 1 Ltd, 4.00%, 31/12/2149                              | 284.850     |
| 400.000 | Longfor Group Holdings Ltd, 3.95%, 16/09/2029                        | 280.400     |
| 250.000 | Korea National Oil Corp, 4.88%, 03/04/2029                           | 248.185     |

## Asia Responsible Transition Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen: (Fortsetzung)

| Anteile | Wertpapierbezeichnung  | Kosten US\$ |
|---------|--|-------------|
| 250.000 | FWD Group Holdings Ltd, 6.38%, 31/12/2149                      | 239.875     |
| 200.000 | Singapore Telecommunications Ltd, 7.38%, 01/12/2031            | 232.834     |
| 200.000 | City of Ulaanbaatar Mongolia, 7.75%, 21/08/2027                | 204.750     |
| 200.000 | Kyobo Life Insurance Co Ltd, 5.90%, 15/06/2052                 | 201.250     |
| 200.000 | FWD Group Holdings Ltd, 8.05%, 31/12/2149                      | 200.730     |
| 200.000 | SMIC SG Holdings Pte Ltd, 5.38%, 24/07/2029                    | 200.298     |
| 200.000 | Continuum Green Energy India Pvt/Co-Issuers, 4.83%, 23/01/2029 | 200.000     |
| 200.000 | Sats Treasury Pte Ltd, 5.52%, 21/05/2034                       | 200.000     |
| 200.000 | Oversea-Chinese Banking Corp Ltd, 7.50%, 26/06/2033            | 200.000     |
| 200.000 | Muthoot Finance Ltd, 7.13%, 14/02/2028                         | 199.900     |
| 200.000 | China Cinda 2020 I Management Ltd, 5.75%, 28/05/2029           | 199.888     |
| 200.000 | Far East Horizon Ltd, 6.63%, 16/04/2027                        | 199.598     |
| 200.000 | Nanshan Life Pte Ltd, 5.45%, 11/09/2034                        | 199.346     |
| 200.000 | Meituan, 4.63%, 02/10/2029                                     | 198.934     |
| 200.000 | AIA Group Ltd, 5.40%, 30/09/2054                               | 198.912     |
| 200.000 | CK Hutchison International 24 Ltd, 5.50%, 26/04/2034           | 198.696     |
| 200.000 | Biocon Biologics Global Plc, 6.67%, 09/10/2029                 | 198.082     |

## Asia Responsible Transition Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung   | Erlöse US\$ |
|-----------|---|-------------|
| 1.100.000 | Pertamina Persero PT, 6.50%, 27/05/2041   | 1.224.223   |
| 600.000   | Indonesia Government International Bond, 8.50%, 12/10/2035                        | 778.200     |
| 750.000   | Indonesia Government International Bond, 4.85%, 11/01/2033                        | 766.883     |
| 650.000   | Mongolia Government International Bond, 8.65%, 19/01/2028                         | 694.050     |
| 650.000   | CFAMC II Co Ltd, 5.50%, 16/01/2025  | 642.525     |
| 600.000   | Bank of China Ltd, 5.00%, 13/11/2024  | 599.622     |
| 640.000   | Pakistan Government International Bond, 6.00%, 08/04/2026                         | 597.964     |
| 600.000   | Fortune Star BVI Ltd, 5.95%, 19/10/2025   | 585.100     |
| 600.000   | ENN Clean Energy International Investment Ltd, 3.38%, 12/05/2026                  | 583.800     |
| 1.000.000 | Sri Lanka Government International Bond, 6.83%, 18/07/2026                        | 580.737     |
| 600.000   | Indonesia Government International Bond, 1.40%, 30/10/2031                        | 570.968     |
| 500.000   | Philippine Government International Bond, 6.38%, 23/10/2034                       | 565.340     |
| 600.000   | ReNew Wind Energy AP2/ReNew Power Pvt Ltd other 9 Subsidiaries, 4.50%, 14/07/2028 | 562.400     |
| 500.000   | Philippine Government International Bond, 5.18%, 05/09/2049                       | 500.000     |
| 500.000   | Periama Holdings LLC, 5.95%, 19/04/2026   | 498.990     |
| 500.000   | Medco Bell Pte Ltd, 6.38%, 30/01/2027   | 498.280     |
| 600.000   | Franshion Brilliant Ltd, 4.25%, 23/07/2029  | 487.050     |
| 500.000   | Power Finance Corp Ltd, 3.95%, 23/04/2030   | 480.600     |
| 500.000   | TSMC Arizona Corp, 1.75%, 25/10/2026  | 474.546     |
| 500.000   | CFAMC IV Co Ltd, 4.50%, 29/05/2029  | 469.125     |

## China A-Share Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung                                   | Kosten CNY |
|---------|---|------------|
| 6.900   | Zhongji Innolight Co Ltd Class A                        | 847.488    |
| 12.600  | Gree Electric Appliances Inc of Zhuhai Class A          | 592.453    |
| 21.000  | Haier Smart Home Co Ltd Class A                         | 569.409    |
| 6.900   | Jiangsu Yanghe Distillery Co Ltd Class A                | 521.203    |
| 59.000  | Bank of Jiangsu Co Ltd Class A                          | 508.280    |
| 18.200  | China Yangtze Power Co Ltd Class A                      | 490.089    |
| 22.300  | Zhejiang Sanhua Intelligent Controls Co Ltd Class A     | 486.754    |
| 79.600  | Industrial & Commercial Bank of China Ltd Class A       | 481.594    |
| 17.900  | Tongwei Co Ltd Class A                                  | 479.214    |
| 13.100  | Luxshare Precision Industry Co Ltd Class A              | 475.478    |
| 1.200   | Tencent Holdings Ltd                                    | 472.879    |
| 26.700  | Industrial Bank Co Ltd Class A                          | 472.668    |
| 3.500   | Xiamen Faratronic Co Ltd Class A                        | 457.917    |
| 52.600  | Bank of Changsha Co Ltd Class A                         | 454.606    |
| 29.500  | Zhongjin Gold Corp Ltd                                  | 453.640    |
| 23.100  | Shandong Sinocera Functional Material Co Ltd Class A    | 448.311    |
| 3.100   | Wuliangye Yibin Co Ltd Class A                          | 447.531    |
| 28.900  | Yunnan Aluminium Co Ltd Class A                         | 441.583    |
| 58.800  | CMOC Group Ltd Class A                                  | 440.026    |
| 32.500  | Bank of Hangzhou Co Ltd Class A                         | 431.899    |
| 89.000  | Agricultural Bank of China Ltd                          | 417.410    |
| 87.900  | Bank of China Ltd Class A                               | 408.789    |
| 21.000  | Chifeng Jilong Gold Mining Co Ltd Class A               | 405.367    |
| 17.600  | Foxconn Industrial Internet Co Ltd Class A              | 400.581    |
| 53.900  | Bank of Suzhou Co Ltd Class A                           | 390.603    |
| 70.500  | Bank of Beijing Co Ltd Class A                          | 378.403    |
| 5.240   | Sungrow Power Supply Co Ltd Class A                     | 373.216    |
| 13.800  | Henan Shuanghui Investment & Development Co Ltd Class A | 353.185    |

## China A-Share Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung                                   | Erlöse CNY |
|---------|---|------------|
| 615     | Kweichow Moutai Co Ltd Class A                          | 910.028    |
| 30.600  | China Yangtze Power Co Ltd Class A                      | 890.442    |
| 16.000  | Fuyao Glass Industry Group Co Ltd Class A               | 786.324    |
| 5.075   | Wuliangye Yibin Co Ltd Class A                          | 690.413    |
| 12.600  | Gree Electric Appliances Inc of Zhuhai Class A          | 548.229    |
| 1.900   | Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co Ltd Class A | 511.250    |
| 67.600  | China Construction Bank Corp Class A                    | 505.541    |
| 26.700  | Industrial Bank Co Ltd Class A                          | 489.491    |
| 79.600  | Industrial & Commercial Bank of China Ltd Class A       | 486.302    |
| 6.200   | Wanhua Chemical Group Co Ltd Class A                    | 485.625    |
| 3.600   | Zhongji Innolight Co Ltd Class A                        | 454.604    |
| 7.300   | Midea Group Co Ltd Class A                              | 444.955    |
| 87.900  | Bank of China Ltd Class A                               | 444.794    |
| 53.900  | Bank of Suzhou Co Ltd Class A                           | 441.118    |
| 2.900   | Luzhou Laojiao Co Ltd Class A                           | 437.800    |
| 9.920   | Jiangsu Hengrui Pharmaceuticals Co Ltd Class A          | 422.488    |
| 89.000  | Agricultural Bank of China Ltd Class A                  | 421.233    |
| 7.600   | Shenzhen Inovance Technology Co Ltd Class A             | 410.998    |
| 12.600  | Luxshare Precision Industry Co Ltd Class A              | 407.107    |
| 21.000  | Chifeng Jilong Gold Mining Co Ltd Class A               | 393.246    |
| 29.500  | Zhongjin Gold Corp Ltd Class A                          | 393.084    |
| 70.500  | Bank of Beijing Co Ltd Class A                          | 391.866    |
| 17.600  | Foxconn Industrial Internet Co Ltd Class A              | 389.821    |
| 17.900  | Tongwei Co Ltd Class A                                  | 380.145    |
| 15.100  | Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd Class A     | 379.084    |
| 15.300  | Shenzhen Sunlord Electronics Co Ltd Class A             | 373.607    |
| 8.700   | Ping An Insurance Group Co of China Ltd Class A         | 359.853    |
| 5.100   | Shenzhou International Group Holdings Ltd               | 344.385    |
| 3.700   | SG Micro Corp Class A                                   | 344.057    |
| 8.500   | Yealink Network Technology Corp Ltd Class A             | 337.470    |
| 16.400  | Yizumi Holdings Co Ltd Class A                          | 333.562    |

## China Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

| Anteile    | Wertpapierbezeichnung  | Kosten CNY |
|------------|--|------------|
| 35.500.000 | China Government Bond, 2.39%, 15/11/2026                     | 35.677.897 |
| 35.000.000 | China Government Bond, 2.04%, 25/02/2027                     | 34.951.315 |
| 20.000.000 | China Government Bond, 2.33%, 15/12/2025                     | 20.091.020 |
| 20.000.000 | China Development Bank, 2.34%, 05/01/2027                    | 20.074.100 |
| 20.000.000 | Industrial & Commercial Bank of China Ltd, 0.00%, 09/01/2025 | 19.523.580 |
| 13.000.000 | Agricultural Development Bank of China, 2.50%, 24/08/2027    | 13.237.549 |
| 10.000.000 | China Development Bank, 2.69%, 16/06/2027                    | 10.098.040 |
| 10.000.000 | Agricultural Bank of China Ltd, 3.10%, 06/05/2030            | 10.089.570 |
| 10.000.000 | Export-Import Bank of China, 2.01%, 12/04/2027               | 10.057.660 |
| 10.000.000 | China Government Bond, 2.05%, 15/04/2029                     | 10.055.871 |
| 1.000.000  | Lenovo Group Ltd, 5.83%, 27/01/2028                          | 7.277.770  |
| 5.000.000  | China Government Bond, 2.37%, 20/01/2027                     | 5.036.335  |
| 4.000.000  | China Government Bond, 3.19%, 15/04/2053                     | 4.619.620  |
| 4.000.000  | Agricultural Development Bank of China, 2.74%, 23/02/2027    | 4.066.268  |
| 4.000.000  | Agricultural Development Bank of China, 1.76%, 26/02/2025    | 3.999.676  |
| 500.000    | Meituan, 0.00%, 27/04/2028                                   | 3.249.877  |
| 3.000.000  | China Government Bond, 1.99%, 15/03/2026                     | 3.002.559  |
| 300.000    | Melco Resorts Finance Ltd, 5.25%, 26/04/2026                 | 2.111.295  |
| 250.000    | Sunny Optical Technology Group Co Ltd, 5.95%, 17/07/2026     | 1.836.196  |
| 250.000    | Central Plaza Development Ltd, 4.65%, 19/01/2026             | 1.722.212  |

## China Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile    | Wertpapierbezeichnung   | Erlöse CNY |
|------------|---|------------|
| 45.000.000 | China Government Bond, 2.39%, 15/11/2026                            | 45.451.300 |
| 43.000.000 | China Government Bond, 2.67%, 25/05/2033                            | 44.023.403 |
| 30.000.000 | China Government Bond, 2.18%, 15/08/2026                            | 30.065.790 |
| 25.000.000 | China Government Bond, 2.04%, 25/02/2027                            | 25.322.440 |
| 20.000.000 | China Southern Power Grid Co Ltd, 2.84%, 24/11/2025                 | 20.162.150 |
| 20.000.000 | China Resources Inc, 2.90%, 22/04/2025                              | 20.127.780 |
| 20.000.000 | Guangzhou Yuexiu Financial Holdings Group Co Ltd, 3.00%, 21/04/2025 | 20.127.250 |
| 20.000.000 | China Government Bond, 2.33%, 15/12/2025                            | 20.125.480 |
| 20.000.000 | Bright Food Group Co Ltd, 3.25%, 12/07/2024                         | 20.057.200 |
| 20.000.000 | Bank of Communications Co Ltd, 2.40%, 05/06/2023                    | 19.763.480 |
| 20.000.000 | Industrial & Commercial Bank of China Ltd, 0.00%, 09/01/2025        | 19.549.600 |
| 20.000.000 | Bank of Communications Co Ltd, 2.33%, 13/06/2024                    | 19.536.520 |
| 20.000.000 | China Citic Bank Corp, 2.49%, 22/05/2024                            | 19.515.460 |
| 20.000.000 | Agricultural Bank of China Ltd, 2.63%, 23/04/2024                   | 19.497.640 |
| 2.000.000  | BOC Aviation USA Corp, 1.63%, 29/04/2024                            | 14.378.988 |
| 1.500.000  | ENN Clean Energy International Investment Ltd, 3.38%, 12/05/2026    | 10.316.309 |
| 1.500.000  | Guangzhou Metro Investment Finance BVI Ltd, 1.51%, 17/09/2025       | 10.249.502 |
| 10.000.000 | China Government Bond, 2.69%, 12/08/2026                            | 10.141.960 |
| 10.000.000 | China Development Bank, 2.69%, 16/06/2027                           | 10.138.520 |
| 10.000.000 | China Development Bank, 2.34%, 05/01/2027                           | 10.092.872 |
| 10.000.000 | China Minmetals Corp, 2.54%, 04/11/2025                             | 10.047.711 |
| 10.000.000 | China Three Gorges Renewables Group Co Ltd, 2.65%, 21/02/2025       | 10.031.150 |
| 10.000.000 | China Post Group Co Ltd, 2.84%, 20/01/2025                          | 10.030.000 |
| 10.000.000 | Central Huijin Investment Ltd, 2.44%, 11/11/2025                    | 10.023.230 |
| 10.000.000 | Agricultural Bank of China Ltd, 4.30%, 11/04/2029                   | 10.014.650 |
| 1.300.000  | Sinochem Offshore Capital Co Ltd, 1.00%, 23/09/2024                 | 9.207.696  |
| 1.000.000  | China Hongqiao Group Ltd, 6.25%, 08/06/2024                         | 7.235.778  |
| 1.000.000  | China Mengniu Dairy Co Ltd, 3.00%, 18/07/2024                       | 7.190.115  |
| 1.000.000  | Blossom Joy Ltd, 3.10%, 31/12/2149                                  | 7.005.289  |
| 1.000.000  | Tencent Holdings Ltd, 3.98%, 11/04/2029                             | 6.932.668  |
| 800.000    | Lenovo Group Ltd, 5.83%, 27/01/2028                                 | 5.881.456  |

## China Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile    | Wertpapierbezeichnung  | Kosten US\$ |
|------------|--|-------------|
| 795.000    | Alibaba Group Holding Ltd                                      | 8.348.654   |
| 10.000.000 | China Construction Bank Corp - H Shares                        | 7.539.090   |
| 736.800    | Shenzhou International Group Holdings Ltd                      | 6.284.406   |
| 199.940    | Contemporary Amperex Technology Co Ltd Class A                 | 5.690.982   |
| 1.552.400  | Beijing New Building Materials Plc Class A                     | 5.611.983   |
| 386.600    | Meituan Class B  | 5.143.203   |
| 102.500    | Tencent Holdings Ltd   | 4.942.365   |
| 5.500.000  | Zoomlion Heavy Industry Science & Technology Co Ltd - H Shares | 3.765.499   |
| 213.803    | Changzhou Xingyu Automotive Lighting Systems Co Ltd Class A    | 3.751.198   |
| 945.922    | Zhejiang Shuanghuan Driveline Co Ltd Class A                   | 3.153.921   |
| 900.000    | Neway Valve Suzhou Co Ltd Class A                              | 2.865.271   |
| 779.700    | Zhuzhou CRRC Times Electric Co Ltd - H Shares                  | 2.843.187   |
| 725.000    | Luxshare Precision Industry Co Ltd Class A                     | 2.799.176   |
| 508.400    | Chaozhou Three-Circle Group Co Ltd Class A                     | 2.643.329   |
| 6.376.000  | CGN Power Co Ltd - H Shares                                    | 2.438.411   |
| 500.000    | China Merchants Bank Co Ltd - H Shares                         | 2.388.465   |
| 58.000     | Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co Ltd Class A        | 2.381.678   |
| 99.384     | ZTO Express Cayman Inc ADR                                     | 2.318.752   |
| 382.000    | Akeso Inc  | 1.977.164   |
| 25.213     | New Oriental Education & Technology Group Inc ADR              | 1.593.230   |
| 2.014.000  | CSPC Pharmaceutical Group Ltd                                  | 1.553.296   |
| 526.000    | Cowell e Holdings Inc  | 1.493.770   |
| 350.000    | Xiaomi Corp Class B  | 1.416.308   |
| 130.000    | Sieyuan Electric Co Ltd Class A                                | 1.284.270   |
| 100.000    | Midea Group Co Ltd Class A                                     | 1.029.336   |
| 284.989    | Shenzhen Sunlord Electronics Co Ltd Class A                    | 970.097     |

## China Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                                       | Erlöse US\$ |
|-----------|---|-------------|
| 304.618   | Trip.com Group Ltd ADR                                      | 15.360.999  |
| 945.000   | Alibaba Group Holding Ltd                                   | 9.444.476   |
| 2.850.000 | Haier Smart Home Co Ltd - H Shares                          | 9.014.170   |
| 611.600   | Meituan Class B   | 8.559.060   |
| 1.724.900 | Luxshare Precision Industry Co Ltd Class A                  | 8.501.595   |
| 6.806.103 | Zoomlion Heavy Industry Science & Technology Co Ltd Class A | 6.754.460   |
| 9.014.000 | CSPC Pharmaceutical Group Ltd                               | 6.585.405   |
| 700.000   | Midea Group Co Ltd Class A                                  | 6.440.292   |
| 135.000   | Tencent Holdings Ltd  | 6.088.852   |
| 294.918   | ZTO Express Cayman Inc ADR                                  | 5.779.165   |
| 2.237.100 | Satellite Chemical Co Ltd Class A                           | 5.344.402   |
| 1.300.072 | Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd Class A         | 5.062.288   |
| 425.000   | Wanhua Chemical Group Co Ltd Class A                        | 4.838.634   |
| 1.210.772 | China Resources Beer Holdings Co Ltd                        | 4.627.073   |
| 2.315.200 | China Pacific Insurance Group Co Ltd - H Shares             | 4.551.996   |
| 1.370.000 | China Resources Land Ltd                                    | 4.100.443   |
| 561.000   | Akeso Inc   | 3.999.654   |
| 913.900   | Beijing New Building Materials Plc Class A                  | 3.862.126   |
| 700.094   | Yunnan Energy New Material Co Ltd Class A                   | 3.269.552   |
| 750.000   | China Merchants Bank Co Ltd - H Shares                      | 3.152.757   |
| 370.127   | Shenzhen Inovance Technology Co Ltd Class A                 | 3.124.551   |
| 729.058   | Shandong Hualu Hengsheng Chemical Co Ltd Class A            | 2.606.914   |
| 145.400   | Suzhou Maxwell Technologies Co Ltd Class A                  | 2.541.126   |
| 296.000   | Jiangsu Hengli Hydraulic Co Ltd Class A                     | 2.363.297   |
| 58.000    | Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co Ltd Class A     | 2.050.423   |
| 530.000   | Shenzhen Sunlord Electronics Co Ltd Class A                 | 2.033.623   |

## Climate Innovation – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung                          | Kosten US\$ |
|---------|--|-------------|
| 592     | First Solar Inc                                | 114.012     |
| 954     | Heidelberg Materials AG                        | 100.924     |
| 370     | NXP Semiconductors NV                          | 95.826      |
| 2.570   | Infineon Technologies AG                       | 95.008      |
| 353     | Samsung SDI Co Ltd                             | 90.476      |
| 698     | L&F Co Ltd                                     | 90.028      |
| 257     | Zebra Technologies Corp                        | 89.936      |
| 972     | Prysmian SpA                                   | 66.329      |
| 1.131   | InterGlobe Aviation Ltd                        | 64.142      |
| 191     | GE Vernova Inc                                 | 63.493      |
| 824     | Kia Corp                                       | 61.950      |
| 1.308   | NEXTracker Inc Class A                         | 60.360      |
| 331     | Dixon Technologies India Ltd                   | 49.922      |
| 3.000   | Silergy Corp                                   | 49.896      |
| 981     | Bentley Systems Inc Class B                    | 49.300      |
| 655     | ON Semiconductor Corp                          | 47.938      |
| 375     | FTAI Aviation Ltd                              | 47.389      |
| 53      | ASML Holding NV                                | 45.998      |
| 629     | Hanmi Semiconductor Co Ltd                     | 45.888      |
| 245     | PTC Inc  | 45.799      |
| 2.000   | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd      | 43.103      |
| 1.300   | Contemporary Amperex Technology Co Ltd Class A | 41.219      |
| 106     | Cadence Design Systems Inc                     | 34.541      |
| 465     | Kaynes Technology India Ltd                    | 33.281      |
| 53      | Synopsys Inc                                   | 32.742      |
| 152     | Onto Innovation Inc                            | 32.480      |
| 220     | Albemarle Corp                                 | 31.300      |
| 3.500   | Shenzhen Inovance Technology Co Ltd Class A    | 30.357      |
| 285     | DSM-Firmenich AG                               | 30.295      |
| 184     | HD Hyundai Heavy Industries Co Ltd             | 26.812      |
| 3.355   | Samsung Heavy Industries Co Ltd                | 25.477      |
| 80      | Rockwell Automation Inc                        | 21.135      |
| 500     | BYD Co Ltd - H Shares                          | 18.301      |

## Climate Innovation – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung                       | Erlöse US\$ |
|---------|---|-------------|
| 2.457   | Howmet Aerospace Inc                        | 176.145     |
| 2.328   | Procore Technologies Inc                    | 140.997     |
| 1.256   | Ingersoll Rand Inc                          | 112.791     |
| 1.324   | CRH Plc                                     | 112.119     |
| 4.762   | Stellantis NV                               | 81.330      |
| 886     | L&F Co Ltd                                  | 79.121      |
| 3.130   | Green Plains Inc                            | 68.066      |
| 954     | Kia Corp                                    | 65.577      |
| 972     | Prysmian SpA                                | 64.788      |
| 322     | Clean Harbors Inc                           | 60.683      |
| 650     | Arkema SA                                   | 59.653      |
| 232     | NXP Semiconductors NV                       | 55.293      |
| 843     | Danone SA                                   | 53.924      |
| 221     | Union Pacific Corp                          | 51.299      |
| 163     | Quanta Services Inc                         | 48.254      |
| 790     | Copart Inc                                  | 43.112      |
| 204     | Samsung SDI Co Ltd                          | 42.560      |
| 53      | ASML Holding NV                             | 36.805      |
| 65      | Adobe Inc                                   | 36.272      |
| 116     | LG Chem Ltd                                 | 34.965      |
| 440     | nVent Electric Plc                          | 34.615      |
| 106     | Trane Technologies Plc                      | 34.418      |
| 299     | Emerson Electric Co                         | 33.229      |
| 324     | Autoliv Inc                                 | 30.907      |
| 157     | Dixon Technologies India Ltd                | 28.876      |
| 96      | Cadence Design Systems Inc                  | 26.110      |
| 186     | ITT Inc                                     | 25.216      |
| 513     | InterGlobe Aviation Ltd                     | 24.469      |
| 3.500   | Shenzhen Inovance Technology Co Ltd Class A | 24.462      |
| 44      | Synopsys Inc                                | 22.316      |
| 80      | Rockwell Automation Inc                     | 21.726      |
| 271     | Veralto Corp                                | 20.837      |
| 1.300   | Li Auto Inc Class A                         | 19.647      |

## CLO Income – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

| Anteile    | Wertpapierbezeichnung   | Kosten US\$ |
|------------|---|-------------|
| 80.225.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 21/01/2025                                  | 80.018.329  |
| 40.100.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 19/11/2024                                  | 40.001.048  |
| 38.000.000 | United States Treasury Note/Bond, 0.38%, 15/09/2024                             | 37.914.034  |
| 20.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 07/11/2024                                  | 19.970.953  |
| 20.000.000 | United States Treasury Note/Bond, 0.25%, 15/06/2024                             | 19.962.567  |
| 9.500.000  | Arbour CLO XIII DAC Series 13X Class E, 9.56%, 15/08/2038                       | 10.224.725  |
| 7.500.000  | AGL CLO 37 Ltd Series 2024-37X Class E, 9.29%, 22/04/2038                       | 7.500.000   |
| 6.000.000  | Trinitas Euro CLO VII DAC Series 7X Class E, 10.20%, 25/07/2037                 | 6.405.314   |
| 6.000.000  | Aqueduct European CLO 10 DAC Series 2024-10X Class E, 8.46%, 18/01/2039         | 6.355.200   |
| 6.000.000  | Waterstown Park CLO DAC Series 2024-1X Class E, 8.41%, 25/01/2038               | 6.284.400   |
| 5.715.000  | OCP Euro CLO 2022-5 DAC Series 2022-5X Class E, 9.69%, 20/04/2035               | 6.206.876   |
| 6.150.000  | Bain Capital Credit CLO 2024-4 Ltd Series 2024-4X Class E, 7.97%, 23/10/2037    | 6.180.750   |
| 5.782.000  | Avoca Capital CLO X Ltd Series 10X Class ERR Class ERR, 8.88%, 15/04/2035       | 6.180.429   |
| 5.485.739  | Fair Oaks Loan Funding III DAC Series 3X Class ER, 8.90%, 15/10/2034            | 6.057.377   |
| 6.000.000  | Trestles CLO VII Ltd Series 2024-7X Class E, 10.42%, 25/10/2037                 | 6.015.000   |
| 5.500.000  | Harvest CLO XXIV DAC Series 24X Class ER, 8.91%, 15/07/2034                     | 6.007.437   |
| 6.000.000  | Benefit Street Partners CLO XVI Ltd Series 2018-16X Class ER, 9.22%, 17/01/2038 | 6.000.000   |
| 6.000.000  | OCP CLO 2024-38 Ltd Series 2024-38X Class E, 9.50%, 21/01/2038                  | 6.000.000   |
| 6.000.000  | Oaktree CLO 2024-28 Ltd Series 2024-28X Class E, 9.68%, 15/01/2038              | 6.000.000   |
| 6.000.000  | Sixth Street CLO 27 Ltd Series 2024-27X Class E, 9.61%, 17/01/2038              | 6.000.000   |

## CLO Income – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung   | Erlöse US\$ |
|-----------|---|-------------|
| 131.071   | iShares USD High Yield Corp Bond UCITS ETF  | 12.319.363  |
| 4.000.000 | Trestles CLO II Ltd Series 2018-2X Class D, 11.39%, 25/07/2031                            | 4.000.000   |
| 4.000.000 | Cific Funding 2018-I Ltd Series 2018-1X Class E, 10.59%, 18/04/2031                       | 3.995.200   |
| 3.800.000 | AGL CLO 22 Ltd Series 2022-22X Class E, 13.95%, 20/10/2035                                | 3.813.300   |
| 3.300.000 | Magnetite CLO Ltd Series 2015-14RX Class E, 11.16%, 18/10/2031                            | 3.300.000   |
| 3.000.000 | Apidos CLO XXXIV Series 2020-34X Class ER, 12.09%, 20/01/2035                             | 3.010.530   |
| 2.650.000 | Magnetite VIII Ltd Series 2014-8X Class FR2, 13.02%, 15/04/2031                           | 2.650.000   |
| 2.250.000 | CVC Cordatus Loan Fund XXVI DAC Series 26X Class E, 12.36%, 15/01/2037                    | 2.512.048   |
| 2.490.000 | Magnetite XVIII Ltd Series 2016-18X Class FR, 13.24%, 15/11/2028                          | 2.490.000   |
| 2.000.000 | Palmer Square European Loan Funding 2023-1 DAC Series 2023-1X Class E, 10.53%, 15/11/2032 | 2.164.500   |
| 2.000.000 | GoldenTree Loan Management EUR CLO 2 DAC Series 2X Class F, 11.35%, 20/01/2032            | 2.163.200   |
| 2.100.000 | Apidos CLO XXIV Series 2016-24X Class DR, 11.39%, 20/10/2030                              | 2.109.114   |
| 2.000.000 | Ocean Trails CLO XV Ltd Series 2024-15X Class D1, 10.00%, 15/01/2037                      | 2.050.000   |
| 2.000.000 | Park Blue CLO 2022-II Ltd Series 2022-2X Class ER, 11.04%, 20/07/2037                     | 2.007.380   |
| 2.000.000 | Ocean Trails CLO XII Ltd Series 2022-12X Class D1R, 7.79%, 20/07/2035                     | 2.007.000   |
| 2.000.000 | Apidos CLO XX Series 2015-20X Class DR, 11.25%, 16/07/2031                                | 2.004.480   |
| 2.000.000 | Signal Peak CLO 5 Ltd Series 2018-5X Class E, 11.29%, 25/04/2031                          | 2.000.000   |
| 2.000.000 | Post CLO 2018-1 Ltd Series 2018-1X Class E, 11.42%, 16/04/2031                            | 2.000.000   |
| 2.000.000 | Symphony CLO 40 Ltd Series 2023-40X Class E, 13.09%, 14/01/2034                           | 2.000.000   |
| 2.000.000 | Ocean Trails CLO XII Ltd Series 2022-12X Class ER, 11.79%, 20/07/2035                     | 1.998.400   |
| 2.000.000 | PPM CLO 3 Ltd Series 2019-3X Class E, 12.19%, 17/04/2034                                  | 1.890.000   |
| 2.000.000 | Trinitas CLO VII Ltd Series 2017-7X Class ER, 12.69%, 25/01/2035                          | 1.881.600   |
| 1.700.000 | CVC Cordatus Loan Fund XXIII DAC Series 23X Class E, 11.14%, 25/04/2036                   | 1.881.050   |
| 1.702.500 | Madison Park Funding XXX Ltd Series 2018-30X Class E, 10.51%, 15/04/2029                  | 1.702.500   |
| 1.650.000 | Magnetite VII Ltd Series 2012-7X Class ER2, 12.08%, 15/01/2028                            | 1.650.000   |
| 1.500.000 | GoldenTree Loan Management EUR CLO 3 DAC Series 3X Class E, 9.81%, 20/01/2032             | 1.578.075   |
| 1.500.000 | Avoca Static CLO I DAC Series 1X Class E, 10.57%, 15/10/2030                              | 1.578.075   |
| 1.675.000 | Trinitas CLO X Ltd Series 2019-10X Class ER, 12.68%, 15/01/2035                           | 1.547.281   |
| 1.588.000 | GoldenTree Loan Management US CLO 4 Ltd Series 2019-4X Class F, 11.98%, 24/04/2031        | 1.541.392   |
| 1.400.000 | Aqueduct European CLO 7-2022 DAC Series 2022-7X Class E, 10.91%, 15/03/2036               | 1.538.740   |
| 1.500.000 | OCP CLO 2023-26 Ltd Series 2023-26X Class E, 13.57%, 17/04/2036                           | 1.534.950   |
| 1.500.000 | United States Treasury Note/Bond, 0.38%, 15/09/2024                                       | 1.498.999   |
| 1.000.000 | Bain Capital Euro CLO 2022-1 DAC Series 2022-1X Class E, 10.89%, 19/10/2034               | 1.113.000   |
| 1.000.000 | Margay CLO I DAC Series 1X Class E, 12.04%, 15/07/2036                                    | 1.037.900   |
| 1.000.000 | Invesco US CLO 2023-1 Ltd Series 2023-1X Class E, 10.94%, 20/04/2031                      | 1.000.000   |
| 1.000.000 | Benefit Street Partners CLO Ltd Series 2018-14X Class E, 13.77%, 22/04/2035               | 1.000.000   |
| 1.000.000 | Trinitas CLO Ltd Series 2021-18X Class E, 12.64%, 20/01/2035                              | 950.800     |
| 1.000.000 | Trinitas CLO XVII Ltd Series 2021-17X Class E, 12.62%, 20/10/2034                         | 942.800     |

## Commodities – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

| Anteile    | Wertpapierbezeichnung                                  | Kosten US\$ |
|------------|--|-------------|
| 33.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 18/03/2025         | 32.661.402  |
| 30.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 05/09/2024         | 29.591.139  |
| 21.945.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 09/05/2024         | 21.724.557  |
| 20.915.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 18/07/2024         | 20.658.767  |
| 20.500.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 19/12/2024         | 20.276.212  |
| 20.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 18/04/2024         | 19.735.117  |
| 15.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 27/02/2025         | 14.835.544  |
| 3.890.000  | JPMorgan Chase & Co, 6.29%, 24/02/2026                 | 3.906.035   |
| 3.870.000  | Wells Fargo Bank NA, 5.49%, 11/12/2026                 | 3.897.054   |
| 3.675.000  | JPMorgan Chase & Co, 5.49%, 22/04/2027                 | 3.692.060   |
| 3.685.000  | Goldman Sachs Bank USA, 5.22%, 21/05/2027              | 3.685.000   |
| 3.675.000  | Morgan Stanley, 5.43%, 18/02/2026                      | 3.680.615   |
| 3.280.000  | Bank of New York Mellon Corp, 2.10%, 24/10/2024        | 3.207.381   |
| 3.070.000  | Caterpillar Financial Services Corp, 5.01%, 14/05/2027 | 3.070.587   |
| 2.980.000  | American Express Co, 5.19%, 04/11/2026                 | 2.986.496   |
| 3.055.000  | Thermo Fisher Scientific Inc, 1.22%, 18/10/2024        | 2.975.326   |
| 2.895.000  | Simon Property Group LP, 3.50%, 01/09/2025             | 2.874.361   |
| 2.820.000  | John Deere Capital Corp, 4.89%, 06/03/2026             | 2.822.905   |
| 2.820.000  | Citibank NA, 5.19%, 19/11/2027                         | 2.820.000   |
| 2.790.000  | Florida Power & Light Co, 3.25%, 01/06/2024            | 2.771.447   |

## Commodities – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

| Anteile    | Wertpapierbezeichnung                                      | Erlöse US\$ |
|------------|--|-------------|
| 17.500.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 05/09/2024             | 17.423.767  |
| 7.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 18/07/2024             | 6.999.011   |
| 4.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 19/12/2024             | 3.984.931   |
| 3.938.000  | JPMorgan Chase & Co, 6.01%, 23/06/2025                     | 3.940.075   |
| 3.890.000  | JPMorgan Chase & Co, 6.29%, 24/02/2026                     | 3.903.398   |
| 3.830.000  | Citigroup Inc, 6.90%, 17/03/2026                           | 3.846.047   |
| 3.675.000  | JPMorgan Chase & Co, 5.49%, 22/04/2027                     | 3.691.985   |
| 3.555.000  | John Deere Capital Corp, 5.55%, 11/10/2024                 | 3.555.102   |
| 3.082.000  | Goldman Sachs Group Inc, 5.70%, 01/11/2024                 | 3.081.569   |
| 3.000.000  | American Express Co, 6.30%, 04/03/2025                     | 3.010.208   |
| 2.792.000  | Caterpillar Financial Services Corp, 5.69%, 13/09/2024     | 2.792.991   |
| 2.569.000  | Volkswagen Group of America Finance LLC, 6.20%, 20/03/2026 | 2.570.906   |
| 2.000.000  | Volkswagen Group of America Finance LLC, 6.37%, 07/06/2024 | 2.001.796   |
| 1.590.000  | Goldman Sachs Bank USA, 5.22%, 21/05/2027                  | 1.588.108   |
| 1.540.000  | PepsiCo Inc, 4.89%, 13/02/2026                             | 1.542.587   |
| 1.340.000  | Volkswagen Group of America Finance LLC, 6.28%, 12/09/2025 | 1.347.678   |
| 1.105.000  | Wells Fargo Bank NA, 5.49%, 11/12/2026                     | 1.114.989   |
| 1.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 16/01/2024             | 998.242     |
| 1.000.000  | Capital One Financial Corp, 3.20%, 05/02/2025              | 990.220     |
| 860.000    | Morgan Stanley, 5.43%, 18/02/2026                          | 861.608     |

## Corporate Hybrid Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile    | Wertpapierbezeichnung                                  | Kosten EUR |
|------------|--|------------|
| 70.000.000 | Proximus SADP, 4.75%, 31/12/2149                       | 70.000.000 |
| 55.700.000 | Centrica Plc, 6.50%, 21/05/2055                        | 64.776.653 |
| 53.500.000 | EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG, 5.25%, 23/01/2084  | 53.590.000 |
| 43.500.000 | Engie SA, 5.13%, 31/12/2149                            | 44.007.500 |
| 42.300.000 | Iberdrola Finanzas SA, 4.87%, 31/12/2149               | 42.468.900 |
| 39.000.000 | TotalEnergies SE, 2.63%, 31/12/2149                    | 38.227.767 |
| 36.900.000 | Arkema SA, 4.80%, 31/12/2149                           | 37.115.000 |
| 37.000.000 | TenneT Holding BV, 4.63%, 31/12/2149                   | 36.880.860 |
| 36.100.000 | Heimstaden Bostad AB, 6.25%, 31/12/2149                | 35.916.612 |
| 35.000.000 | Enel SpA, 4.75%, 31/12/2149                            | 34.570.000 |
| 32.000.000 | Orsted AS, 5.13%, 14/03/3024                           | 31.889.390 |
| 29.000.000 | TenneT Holding BV, 4.88%, 31/12/2149                   | 29.058.620 |
| 22.700.000 | Electricite de France SA, 7.38%, 31/12/2149            | 26.897.789 |
| 29.000.000 | Transcanada Trust, 5.88%, 15/08/2076                   | 26.131.255 |
| 25.000.000 | British Telecommunications Plc, 5.13%, 03/10/2054      | 24.864.600 |
| 27.300.000 | Fastighets AB Balder, 2.87%, 02/06/2081                | 24.652.750 |
| 25.000.000 | Sempra, 6.40%, 01/10/2054                              | 22.540.799 |
| 22.400.000 | TotalEnergies SE, 4.12%, 31/12/2149                    | 22.398.208 |
| 20.000.000 | Repsol International Finance BV, 3.75%, 31/12/2149     | 19.625.000 |
| 20.000.000 | Volkswagen International Finance NV, 3.88%, 31/12/2149 | 19.445.000 |
| 20.000.000 | CVS Health Corp, 7.00%, 10/03/2055                     | 19.136.746 |
| 20.000.000 | Enbridge Inc, 7.38%, 15/01/2083                        | 18.651.144 |
| 16.500.000 | A2A SpA, 5.00%, 31/12/2149                             | 16.410.900 |
| 16.000.000 | EDP SA, 4.63%, 16/09/2054                              | 15.894.560 |
| 17.500.000 | Enbridge Inc, 5.50%, 15/07/2077                        | 15.533.395 |
| 18.000.000 | Heimstaden Bostad AB, 3.63%, 31/12/2149                | 15.434.000 |
| 15.000.000 | Elia Group SA, 5.85%, 31/12/2149                       | 15.297.500 |
| 15.000.000 | Telefonica Europe BV, 5.75%, 31/12/2149                | 15.225.000 |
| 15.000.000 | Abertis Infraestructuras Finance BV, 4.87%, 31/12/2149 | 14.999.850 |
| 15.000.000 | Koninklijke FrieslandCampina NV, 4.85%, 31/12/2149     | 14.986.200 |
| 14.000.000 | Unibail-Rodamco-Westfield SE, 7.25%, 31/12/2149        | 14.761.500 |
| 15.000.000 | Naturgy Finance Iberia SA, 2.37%, 31/12/2149           | 14.008.750 |
| 14.000.000 | Roquette Freres SA, 5.49%, 31/12/2149                  | 14.000.000 |
| 15.000.000 | Sempra, 6.88%, 01/10/2054                              | 13.726.012 |
| 13.300.000 | Koninklijke KPN NV, 4.88%, 31/12/2149                  | 13.257.706 |

## Corporate Hybrid Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile    | Wertpapierbezeichnung                                    | Erlöse EUR |
|------------|--|------------|
| 81.487.000 | Vodafone Group Plc, 6.25%, 03/10/2078                    | 75.375.927 |
| 51.045.000 | TotalEnergies SE, 2.63%, 31/12/2149                      | 50.662.230 |
| 42.000.000 | NGG Finance Plc, 5.63%, 18/06/2073                       | 48.601.205 |
| 40.400.000 | Bayer AG, 6.63%, 25/09/2083                              | 39.888.160 |
| 40.000.000 | ELM BV for Firmenich International SA, 3.75%, 31/12/2149 | 39.875.000 |
| 37.300.000 | Bayer AG, 7.00%, 25/09/2083                              | 37.642.400 |
| 30.944.000 | TotalEnergies SE, 1.63%, 31/12/2049                      | 28.901.696 |
| 23.597.000 | SSE Plc, 3.74%, 31/12/2049                               | 27.265.438 |
| 30.000.000 | British Telecommunications Plc, 4.25%, 23/11/2081        | 25.992.963 |
| 26.500.000 | Veolia Environnement SA, 2.00%, 31/12/2149               | 23.611.500 |
| 20.000.000 | Enel SpA, 4.75%, 31/12/2149                              | 20.282.500 |
| 20.000.000 | Iberdrola International BV, 1.45%, 31/12/2149            | 18.325.000 |
| 20.600.000 | EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG, 1.38%, 31/08/2081    | 17.499.700 |
| 20.000.000 | Enbridge Inc, 5.50%, 15/07/2077                          | 17.381.657 |
| 16.500.000 | A2A SpA, 5.00%, 31/12/2149                               | 16.694.262 |
| 17.700.000 | EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG, 1.88%, 29/06/2080    | 16.536.225 |
| 15.000.000 | Koninklijke FrieslandCampina NV, 31/12/2149              | 15.007.900 |
| 15.000.000 | Veolia Environnement SA, 2.25%, 31/12/2049               | 14.688.750 |
| 15.000.000 | Naturgy Finance Iberia SA, 2.37%, 31/12/2149             | 14.560.000 |
| 15.000.000 | Sempre, 6.88%, 01/10/2054                                | 13.806.523 |
| 13.000.000 | Koninklijke KPN NV, 4.88%, 31/12/2149                    | 13.385.000 |
| 12.000.000 | Accor SA, 4.88%, 31/12/2149                              | 12.051.600 |
| 10.000.000 | Volkswagen International Finance NV, 7.50%, 31/12/2149   | 10.762.500 |
| 10.000.000 | Telefonica Europe BV, 6.75%, 31/12/2149                  | 10.712.500 |
| 10.000.000 | Telefonica Europe BV, 5.75%, 31/12/2149                  | 10.027.500 |
| 10.000.000 | Duke Energy Corp, 6.45%, 01/09/2054                      | 9.647.508  |
| 10.000.000 | NextEra Energy Capital Holdings Inc, 15/06/2054          | 9.448.797  |
| 10.000.000 | BP Capital Markets Plc, 6.13%, 31/12/2149                | 9.405.027  |
| 10.200.000 | Enel SpA, 1.38%, 31/12/2149                              | 9.168.050  |
| 9.854.000  | Orsted AS, 1.75%, 09/12/3019                             | 8.903.089  |
| 9.085.000  | Telia Co AB, 1.38%, 11/05/2081                           | 8.624.950  |
| 8.900.000  | Iberdrola International BV, 1.87%, 31/12/2149            | 8.438.500  |
| 8.300.000  | Alliander NV, 4.50%, 31/12/2149                          | 8.320.750  |

## Developed Market FMP – 2027 – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Käufe insgesamt:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung   | Kosten US\$ |
|-----------|---|-------------|
| 1.355.000 | William Carter Co, 5.63%, 15/03/2027                                | 1.353.306   |
| 1.330.000 | SCIL IV LLC/SCIL USA Holdings LLC, 5.38%, 01/11/2026                | 1.326.675   |
| 1.330.000 | Six Flags Entertainment Corp, 5.50%, 15/04/2027                     | 1.323.350   |
| 420.000   | Berry Global Inc, 5.63%, 15/07/2027                                 | 420.000     |
| 332.500   | American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd, 5.50%, 20/04/2026 | 332.084     |

Verkäufe insgesamt:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                       | Erlöse US\$ |
|-----------|---|-------------|
| 1.700.000 | Carrier Global Corp, 2.49%, 15/02/2027      | 1.614.650   |
| 1.475.000 | Broadcom Inc, 3.46%, 15/09/2026             | 1.443.420   |
| 951.000   | New Fortress Energy Inc, 6.75%, 15/09/2025  | 927.225     |
| 100.000   | Ford Motor Credit Co LLC, 6.95%, 10/06/2026 | 102.309     |

## EMD Corporate – Social and Environmental Transition – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung  | Kosten US\$ |
|-----------|--|-------------|
| 1.825.000 | Ivory Coast Government International Bond, 4.88%, 30/01/2032 | 1.809.587   |
| 1.651.000 | YPF SA, 9.50%, 17/01/2031                                    | 1.665.000   |
| 1.450.000 | Petroleos Mexicanos, 6.70%, 16/02/2032                       | 1.301.873   |
| 1.200.000 | Ambipar Lux Sarl, 9.88%, 06/02/2031                          | 1.207.850   |
| 1.208.000 | Colombia Government International Bond, 7.75%, 07/11/2036    | 1.198.099   |
| 1.134.000 | First Quantum Minerals Ltd, 8.63%, 01/06/2031                | 1.114.200   |
| 1.028.000 | Banco do Brasil SA, 6.00%, 18/03/2031                        | 1.010.760   |
| 1.100.000 | Prosus NV, 3.68%, 21/01/2030                                 | 965.571     |
| 900.000   | National Bank of Ras Al-Khaimah PSC, 5.38%, 25/07/2029       | 899.988     |
| 851.000   | Dominican Republic International Bond, 7.05%, 03/02/2031     | 874.558     |
| 800.000   | Trident Energy Finance Plc, 12.50%, 30/11/2029               | 817.573     |
| 802.000   | Consolidated Energy Finance SA, 12.00%, 15/02/2031           | 801.000     |
| 798.000   | Vista Energy Argentina SAU, 7.63%, 10/12/2035                | 798.000     |
| 800.000   | Turkiye Government International Bond, 6.50%, 03/01/2035     | 785.480     |
| 782.000   | FS Luxembourg Sarl, 8.88%, 12/02/2031                        | 778.771     |
| 800.000   | Bancolombia SA, 4.63%, 18/12/2029                            | 765.200     |
| 750.000   | Yinson Boronia Production BV, 8.95%, 31/07/2042              | 759.300     |
| 744.000   | Telecom Argentina SA, 9.50%, 18/07/2031                      | 737.371     |
| 790.004   | Samarco Mineracao SA, 9.00%, 30/06/2031                      | 728.044     |
| 727.000   | Republic of Poland Government Bond, 5.13%, 18/09/2034        | 722.749     |

## EMD Corporate – Social and Environmental Transition – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung  | Erlöse US\$ |
|-----------|--|-------------|
| 1.775.000 | Romanian Government International Bond, 3.62%, 26/05/2030    | 1.799.486   |
| 1.425.000 | Ivory Coast Government International Bond, 5.25%, 22/03/2030 | 1.522.780   |
| 1.195.000 | Bancolombia SA, 4.63%, 18/12/2029                            | 1.178.505   |
| 1.028.000 | Banco do Brasil SA, 6.00%, 18/03/2031                        | 1.008.386   |
| 900.000   | Ecopetrol SA, 8.88%, 13/01/2033                              | 944.550     |
| 908.000   | Colombia Government International Bond, 7.75%, 07/11/2036    | 895.692     |
| 800.000   | Turkiye Government International Bond, 6.50%, 03/01/2035     | 777.303     |
| 727.000   | Republic of Poland Government Bond, 5.13%, 18/09/2034        | 727.822     |
| 723.000   | Turkiye Government International Bond, 7.63%, 15/05/2034     | 718.983     |
| 717.000   | YPF SA, 6.95%, 21/07/2027                                    | 702.124     |
| 696.000   | Israel Government International Bond, 5.50%, 12/03/2034      | 691.878     |
| 700.000   | Compania de Minas Buenaventura SAA, 5.50%, 23/07/2026        | 685.577     |
| 640.000   | Adib Sukuk Co II Ltd, 5.70%, 15/11/2028                      | 657.100     |
| 600.000   | Banco del Estado de Chile, 7.95%, 31/12/2149                 | 634.742     |
| 576.000   | Turkiye Government International Bond, 5.88%, 21/05/2030     | 627.293     |
| 600.000   | Medco Bell Pte Ltd, 6.38%, 30/01/2027                        | 595.582     |
| 655.000   | CT Trust, 5.13%, 03/02/2032                                  | 579.545     |
| 568.000   | Singapore Airlines Ltd, 5.25%, 21/03/2034                    | 568.567     |
| 575.000   | CFAMC II Co Ltd, 5.50%, 16/01/2025                           | 568.388     |
| 556.000   | Inversiones CMPC SA, 6.13%, 26/02/2034                       | 566.092     |

## Emerging Market Debt - Hard Currency – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile    | Wertpapierbezeichnung   | Kosten US\$ |
|------------|---|-------------|
| 46.150.000 | Petroleos Mexicanos, 7.69%, 23/01/2050                                    | 35.911.407  |
| 30.203.000 | Mexico Government International Bond, 6.00%, 07/05/2036                   | 29.761.818  |
| 35.028.984 | Republic of Ghana Government Bonds, 5.00%, 03/07/2035                     | 24.838.702  |
| 26.259.236 | Republic of Ghana Government Bonds, 5.00%, 03/07/2029                     | 23.213.243  |
| 27.362.578 | Sri Lanka Government International Bond, 3.35%, 15/03/2033                | 19.180.346  |
| 35.356.000 | Argentine Republic Government International Bond, 3.50%, 09/07/2041       | 17.453.395  |
| 25.656.372 | Sri Lanka Government International Bond, 3.60%, 15/02/2038                | 17.367.311  |
| 17.116.285 | Sri Lanka Government International Bond, 4.00%, 15/04/2028                | 16.063.634  |
| 15.420.000 | Turkiye Government International Bond, 6.50%, 03/01/2035                  | 15.092.009  |
| 12.901.000 | Chile Government International Bond, 3.88%, 09/07/2031                    | 13.832.908  |
| 18.476.035 | Sri Lanka Government International Bond, 3.60%, 15/06/2035                | 13.354.478  |
| 37.010.000 | Argentine Republic Government International Bond, 4.13%, 09/07/2046       | 12.817.760  |
| 12.477.000 | Republic of South Africa Government International Bond, 7.10%, 19/11/2036 | 12.494.708  |
| 12.238.000 | Republic of Poland Government International Bond, 5.13%, 18/09/2034       | 12.175.533  |
| 11.251.000 | Turkiye Government International Bond, 5.88%, 21/05/2030                  | 12.092.675  |
| 11.920.000 | Brazilian Government International Bond, 6.13%, 22/01/2032                | 12.045.160  |
| 12.203.000 | Turkiye Government International Bond, 7.63%, 15/05/2034                  | 11.993.352  |
| 14.550.000 | Senegal Government International Bond, 5.38%, 08/06/2037                  | 11.620.337  |
| 12.000.000 | Avenir Issuer III Ireland DAC, 6.00%, 22/03/2027                          | 11.460.000  |
| 11.846.000 | Israel Government International Bond, 5.75%, 12/03/2054                   | 11.367.895  |
| 12.898.000 | Nigeria Government International Bond, 7.70%, 23/02/2038                  | 10.807.965  |
| 11.910.000 | Dominican Republic International Bond, 4.88%, 23/09/2032                  | 10.685.443  |
| 13.949.944 | Sri Lanka Government International Bond, 3.10%, 15/01/2030                | 10.630.973  |
| 10.691.000 | Israel Government International Bond, 5.50%, 12/03/2034                   | 10.607.610  |
| 9.834.000  | Saudi Arabian Oil Co, 5.88%, 17/07/2064                                   | 9.601.819   |
| 14.203.000 | Panama Government International Bond, 4.50%, 01/04/2056                   | 9.468.467   |
| 8.463.000  | Romanian Government International Bond, 5.63%, 22/02/2036                 | 9.023.450   |
| 12.067.000 | Panama Government International Bond, 2.25%, 29/09/2032                   | 8.953.916   |
| 12.822.796 | Sri Lanka Government International Bond, 3.60%, 15/05/2036                | 8.818.493   |
| 8.673.000  | Colombia Government International Bond, 7.75%, 07/11/2036                 | 8.639.609   |

## Emerging Market Debt - Hard Currency – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung   | Erlöse US\$ |
|-------------|---|-------------|
| 109.720.000 | Argentine Republic Government International Bond, 4.13%, 09/07/2035 | 43.909.832  |
| 33.379.000  | Serbia International Bond, 1.50%, 26/06/2029                        | 31.012.924  |
| 30.203.000  | Mexico Government International Bond, 6.00%, 07/05/2036             | 30.353.776  |
| 30.320.000  | Dominican Republic International Bond, 6.85%, 27/01/2045            | 30.332.339  |
| 49.996.880  | Argentine Republic Government International Bond, 0.75%, 09/07/2030 | 28.797.076  |
| 40.882.000  | Sri Lanka Government International Bond, 7.85%, 14/03/2029          | 26.070.888  |
| 28.187.000  | Romanian Government International Bond, 3.38%, 28/01/2050           | 20.652.275  |
| 21.800.000  | Angolan Government International Bond, 9.38%, 08/05/2048            | 18.467.792  |
| 150.000     | Neuberger Berman Short Duration Euro Bond Fund                      | 17.785.500  |
| 30.412.000  | Republic of Ghana Government Bonds, 10.75%, 14/10/2030              | 15.531.512  |
| 21.410.000  | Colombia Government International Bond, 5.20%, 15/05/2049           | 15.265.479  |
| 17.850.000  | Mexico Government International Bond, 5.75%, 12/10/2110             | 14.944.269  |
| 14.739.000  | Republic of Poland Government International Bond, 5.50%, 04/04/2053 | 14.761.173  |
| 28.546.000  | Ecuador Government International Bond, 5.50%, 31/07/2035            | 14.414.142  |
| 21.753.000  | Sri Lanka Government International Bond, 6.75%, 18/04/2028          | 14.237.196  |
| 21.535.000  | Sri Lanka Government International Bond, 6.20%, 11/05/2027          | 13.579.956  |
| 13.889.000  | Indonesia Government International Bond, 1.10%, 12/03/2033          | 11.853.049  |
| 18.631.000  | Sri Lanka Government International Bond, 7.55%, 28/03/2030          | 11.503.513  |
| 10.489.000  | Petrobras Global Finance BV, 6.50%, 03/07/2033                      | 10.761.714  |
| 15.107.000  | Sri Lanka Government International Bond, 6.85%, 03/11/2025          | 10.083.976  |
| 15.260.000  | Panama Government International Bond, 4.50%, 01/04/2056             | 9.802.773   |
| 10.300.000  | Angolan Government International Bond, 8.75%, 14/04/2032            | 9.218.500   |
| 9.848.000   | Panama Government International Bond, 6.85%, 28/03/2054             | 9.202.785   |
| 9.831.000   | Tunisian Republic, 6.38%, 15/07/2026                                | 9.192.086   |
| 14.406.000  | Sri Lanka Government International Bond, 6.85%, 14/03/2024          | 9.186.915   |

## Emerging Market Debt - Local Currency – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile         | Wertpapierbezeichnung  | Kosten US\$ |
|-----------------|--|-------------|
| 1.834.200.000   | India Government Bond, 7.18%, 14/08/2033                               | 22.180.019  |
| 643.585.601     | Turkiye Government Bond, 26.20%, 05/10/2033                            | 18.721.189  |
| 1.430.840.000   | India Government Bond, 7.30%, 19/06/2053                               | 17.639.440  |
| 800.000.000     | Egypt Government Bond, 25.32%, 13/08/2027                              | 16.613.697  |
| 69.640.000      | Romania Government Bond, 8.25%, 29/09/2032                             | 16.300.068  |
| 524.719.000     | Thailand Government Bond, 3.45%, 17/06/2043                            | 15.710.941  |
| 235.648.000.000 | Indonesia Treasury Bond, 6.88%, 15/04/2029                             | 15.313.170  |
| 1.250.000.000   | India Government Bond, 7.02%, 18/06/2031                               | 15.045.790  |
| 62.004.000      | Republic of Poland Government Bond, 4.75%, 25/07/2029                  | 14.846.556  |
| 517.922.000     | Thailand Government Bond, 2.40%, 17/03/2029                            | 14.569.478  |
| 52.895.000      | Peru Government Bond, 5.94%, 12/02/2029                                | 14.288.350  |
| 1.124.800.000   | International Bank for Reconstruction & Development, 6.75%, 13/07/2029 | 13.487.922  |
| 381.217.895     | Turkiye Government Bond, 31.08%, 08/11/2028                            | 12.076.568  |
| 192.636.000.000 | Indonesia Treasury Bond, 6.63%, 15/02/2034                             | 11.824.870  |
| 83.610.000      | China Government Bond, 2.05%, 15/04/2029                               | 11.546.788  |
| 287.780.000     | Czech Republic Government Bond, 1.20%, 13/03/2031                      | 10.713.450  |
| 37.670.000      | Peruvian Government International Bond, 6.95%, 12/08/2031              | 10.401.755  |
| 546.650.000     | Dominican Republic International Bond, 10.75%, 01/06/2036              | 9.688.919   |
| 41.205.000      | Romania Government Bond, 8.00%, 29/04/2030                             | 9.499.717   |
| 202.599.239     | Republic of South Africa Government Bond, 8.75%, 31/01/2044            | 8.814.931   |
| 707.630.000     | India Government Bond, 7.18%, 24/07/2037                               | 8.632.873   |
| 55.630.000      | China Government Bond, 3.00%, 15/10/2053                               | 8.515.730   |
| 57.000.000      | China Government Bond, 2.12%, 25/06/2031                               | 7.968.472   |
| 2.903.530.000   | Hungary Government Bond, 4.50%, 23/03/2028                             | 7.940.088   |
| 453.310.000     | Philippine Government Bond, 6.25%, 25/01/2034                          | 7.820.599   |
| 282.834.484     | Uruguay Government International Bond, 9.75%, 20/07/2033               | 7.622.295   |
| 54.600.000      | China Government Bond, 2.11%, 25/08/2034                               | 7.611.903   |
| 137.535.943     | Republic of South Africa Government Bond, 10.88%, 31/03/2038           | 7.594.374   |
| 2.447.000.000   | Hungary Government Bond, 6.75%, 22/10/2028                             | 7.394.556   |
| 50.000.000      | China Development Bank, 2.73%, 11/01/2028                              | 7.294.367   |
| 2.393.350.000   | Hungary Government Bond, 7.00%, 24/10/2035                             | 7.186.210   |
| 135.763.500     | Mexican Bonos, 8.50%, 31/05/2029                                       | 7.144.428   |
| 50.000.000      | China Development Bank, 2.52%, 25/05/2028                              | 7.088.138   |
| 50.000.000      | China Development Bank, 2.69%, 16/06/2027                              | 7.079.252   |
| 578.400.000     | India Government Bond, 7.10%, 08/04/2034                               | 7.039.757   |
| 385.360.000     | Philippine Government Bond, 6.50%, 19/05/2029                          | 6.955.381   |
| 26.445.000      | Republic of Poland Government Bond, 6.00%, 25/10/2033                  | 6.917.428   |
| 50.000.000      | Central Huijin Investment Ltd, 2.07%, 30/07/2029                       | 6.863.125   |
| 100.713.000.000 | Indonesia Treasury Bond, 6.75%, 15/07/2035                             | 6.652.449   |
| 962.000.000     | Republic of Kenya Infrastructure Bond, 18.46%, 09/08/2032              | 6.467.838   |
| 201.350.928     | Republic of South Africa Government Bond, 6.50%, 28/02/2041            | 6.428.091   |

## Emerging Market Debt - Local Currency – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile         | Wertpapierbezeichnung   | Erlöse US\$ |
|-----------------|---|-------------|
| 86.365.000      | Republic of Poland Government Bond, 2.50%, 25/07/2026               | 20.984.416  |
| 317.335.000.000 | Indonesia Treasury Bond, 6.63%, 15/02/2034                          | 19.944.253  |
| 17.716.200      | United States Treasury Bill, 0.00%, 30/01/2024                      | 17.651.407  |
| 398.083.419     | Republic of South Africa Government Bond, 7.00%, 28/02/2031         | 17.233.200  |
| 69.370.000      | Romania Government Bond, 8.25%, 29/09/2032                          | 16.917.245  |
| 86.013.000      | Republic of Poland Government Bond, 1.75%, 25/04/2032               | 16.775.237  |
| 368.120.000     | Czech Republic Government Bond, 1.00%, 26/06/2026                   | 15.354.801  |
| 68.148.200.000  | Colombian TES, 5.75%, 03/11/2027                                    | 15.286.977  |
| 302.880.000     | Mexican Bonos, 7.50%, 26/05/2033                                    | 15.121.010  |
| 52.895.000      | Peru Government Bond, 5.94%, 12/02/2029                             | 14.483.748  |
| 232.689.000.000 | Indonesia Treasury Bond, 6.88%, 15/04/2029                          | 14.284.551  |
| 62.747.000      | Republic of Poland Government Bond, 2.75%, 25/10/2029               | 14.133.367  |
| 58.229.500.000  | Colombian TES, 6.00%, 28/04/2028                                    | 13.107.094  |
| 466.807.393     | Turkiye Government Bond, 1.50%, 18/06/2025                          | 13.092.876  |
| 1.224.324       | Neuberger Berman China Bond Fund                                    | 12.572.314  |
| 493.856.000     | Uruguay Government International Bond, 8.50%, 15/03/2028            | 12.357.304  |
| 4.526.340.000   | Hungary Government Bond, 4.50%, 23/03/2028                          | 11.550.711  |
| 40.655.000      | Republic of Poland Government Bond, 7.50%, 25/07/2028               | 11.248.253  |
| 20.062.847      | Argentine Republic Government International Bond, 0.75%, 09/07/2030 | 10.878.477  |
| 198.727.464     | Republic of South Africa Government Bond, 10.50%, 21/12/2026        | 10.859.487  |
| 241.071.597     | Republic of South Africa Government Bond, 8.75%, 31/01/2044         | 10.727.788  |
| 203.912.711     | Republic of South Africa Government Bond, 8.88%, 28/02/2035         | 9.992.760   |
| 169.210.000     | Mexican Bonos, 7.50%, 03/06/2027                                    | 9.144.509   |
| 58.630.000      | China Government Bond, 3.00%, 15/10/2053                            | 9.049.066   |
| 42.065.000      | Malaysia Government Bond, 3.90%, 16/11/2027                         | 9.016.667   |
| 8.308.000       | United States Treasury Bill, 0.00%, 16/05/2024                      | 8.233.032   |
| 326.932.200     | Uruguay Government International Bond, 9.75%, 20/07/2033            | 8.108.247   |
| 962.000.000     | Republic of Kenya Infrastructure Bond, 18.46%, 09/08/2032           | 7.666.487   |
| 33.026.000      | Malaysia Government Bond, 4.70%, 15/10/2042                         | 7.502.946   |
| 180.529.026     | Republic of South Africa Government Bond, 8.75%, 28/02/2048         | 7.448.828   |
| 137.440.000     | Mexican Bonos, 5.50%, 04/03/2027                                    | 7.414.381   |
| 259.670.000     | Bank of Thailand Bill, 0.00%, 09/05/2024                            | 7.355.810   |

## Emerging Market Debt Blend – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

| Anteile         | Wertpapierbezeichnung                                 | Kosten US\$ |
|-----------------|---|-------------|
| 7.929.800       | United States Treasury Bill, 0.00%, 10/10/2024        | 7.744.433   |
| 117.877.000.000 | Indonesia Treasury Bond, 6.88%, 15/04/2029            | 7.638.300   |
| 570.370.000     | India Government Bond, 7.18%, 14/08/2033              | 6.895.602   |
| 450.000.000     | India Government Bond, 7.02%, 18/06/2031              | 5.417.705   |
| 20.105.000      | Romania Government Bond, 8.25%, 29/09/2032            | 4.703.807   |
| 146.361.000     | Thailand Government Bond, 3.45%, 17/06/2043           | 4.419.381   |
| 151.515.770     | Turkiye Government Bond, 26.20%, 05/10/2033           | 4.396.297   |
| 28.960.000      | China Government Bond, 1.87%, 15/09/2031              | 3.988.866   |
| 139.877.000     | Thailand Government Bond, 2.40%, 17/03/2029           | 3.940.464   |
| 289.450.000     | India Government Bond, 7.30%, 19/06/2053              | 3.587.234   |
| 57.194.000.000  | Indonesia Treasury Bond, 6.63%, 15/02/2034            | 3.546.200   |
| 215.000.000     | Egypt Treasury Bills, 0.00%, 18/03/2025               | 3.475.444   |
| 22.480.000      | China Government Bond, 3.00%, 15/10/2053              | 3.441.207   |
| 162.000.000     | Egypt Government Bond, 25.32%, 13/08/2027             | 3.364.059   |
| 89.790.000      | Czech Republic Government Bond, 1.20%, 13/03/2031     | 3.302.521   |
| 66.590.000      | Mexican Bonos, 7.75%, 29/05/2031                      | 3.113.170   |
| 58.700.000      | Mexican Bonos, 5.50%, 04/03/2027                      | 3.100.380   |
| 14.902.000      | Republic of Poland Government Bond, 1.75%, 25/04/2032 | 2.999.902   |
| 12.606.000      | Republic of Poland Government Bond, 4.75%, 25/07/2029 | 2.993.079   |
| 92.486.997      | Turkiye Government Bond, 31.08%, 08/11/2028           | 2.929.755   |

## Emerging Market Debt Blend – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

| Anteile        | Wertpapierbezeichnung                                       | Erlöse US\$ |
|----------------|---|-------------|
| 1.042.841      | Neuberger Berman China Bond Fund                            | 10.733.484  |
| 7.929.800      | United States Treasury Bill, 0.00%, 10/10/2024              | 7.782.877   |
| 128.130.000    | Mexican Bonos, 5.50%, 04/03/2027                            | 6.296.325   |
| 113.551.464    | Republic of South Africa Government Bond, 7.00%, 28/02/2031 | 4.965.754   |
| 79.100.000.000 | Indonesia Treasury Bond, 6.63%, 15/02/2034                  | 4.948.983   |
| 77.586.000.000 | Indonesia Treasury Bond, 6.88%, 15/04/2029                  | 4.766.727   |
| 21.328.300.000 | Colombian TES, 6.00%, 28/04/2028                            | 4.624.775   |
| 18.217.000     | Republic of Poland Government Bond, 2.50%, 25/07/2026       | 4.414.257   |
| 156.877.000    | Thailand Government Bond, 2.40%, 17/03/2029                 | 4.329.096   |
| 17.540.000     | Romania Government Bond, 8.25%, 29/09/2032                  | 4.267.658   |
| 15.153.000     | Republic of Poland Government Bond, 7.50%, 25/07/2028       | 4.208.549   |
| 150.162.000    | Thailand Government Bond, 1.45%, 17/12/2024                 | 4.189.870   |
| 215.000.000    | Egypt Treasury Bills, 0.00%, 18/03/2025                     | 3.795.935   |
| 17.286.000     | Republic of Poland Government Bond, 1.75%, 25/04/2032       | 3.368.177   |
| 14.558.000     | Malaysia Government Bond, 4.70%, 15/10/2042                 | 3.295.412   |
| 59.520.900     | Mexican Bonos, 8.50%, 31/05/2029                            | 3.288.922   |
| 75.850.000     | Czech Republic Government Bond, 1.00%, 26/06/2026           | 3.201.257   |
| 107.850.944    | Turkiye Government Bond, 1.50%, 18/06/2025                  | 3.028.851   |
| 57.073.186     | Republic of South Africa Government Bond, 8.88%, 28/02/2035 | 2.903.639   |
| 44.700.000.000 | Indonesia Treasury Bond, 6.38%, 15/08/2028                  | 2.706.373   |

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile        | Wertpapierbezeichnung   | Kosten US\$ |
|----------------|---|-------------|
| 1.140.000      | Uruguay Government International Bond, 7.88%, 15/01/2033            | 1.392.050   |
| 660.000        | Peruvian Government International Bond, 8.75%, 21/11/2033           | 813.596     |
| 780.000        | Mexico Government International Bond, 6.00%, 07/05/2036             | 777.741     |
| 710.000        | Corp Nacional del Cobre de Chile, 5.95%, 08/01/2034                 | 705.925     |
| 10.580.000.000 | Indonesia Treasury Bond, 6.88%, 15/04/2029                          | 685.068     |
| 650.000        | Hungary Government International Bond, 5.50%, 16/06/2034            | 631.800     |
| 600.000        | Metropolitan Bank & Trust Co, 5.50%, 06/03/2034                     | 598.680     |
| 50.200.000     | Asian Infrastructure Investment Bank, 6.65%, 30/06/2033             | 584.604     |
| 500.000        | Bank Gospodarstwa Krajowego, 4.00%, 13/03/2032                      | 545.255     |
| 600.000        | Indian Railway Finance Corp Ltd, 3.57%, 21/01/2032                  | 533.200     |
| 510.000        | Bank Gospodarstwa Krajowego, 5.75%, 09/07/2034                      | 517.725     |
| 42.600.000     | India Government Bond, 7.02%, 18/06/2031                            | 514.014     |
| 7.374.000.000  | Indonesia Treasury Bond, 6.63%, 15/02/2034                          | 461.102     |
| 470.000        | Abu Dhabi Developmental Holding Co PJSC, 5.25%, 02/10/2054          | 455.074     |
| 15.972.000     | Thailand Government Bond, 2.40%, 17/03/2029                         | 453.198     |
| 8.360.000      | Mexican Bonos, 8.00%, 24/05/2035                                    | 450.909     |
| 500.000        | Romanian Government International Bond, 2.12%, 16/07/2031           | 442.472     |
| 400.000        | DP World Ltd, 6.85%, 02/07/2037                                     | 438.792     |
| 34.730.000     | India Government Bond, 7.30%, 19/06/2053                            | 428.395     |
| 421.000        | Republic of Poland Government International Bond, 5.13%, 18/09/2034 | 416.914     |
| 13.641.000     | Thailand Government Bond, 3.45%, 17/06/2043                         | 408.365     |
| 290.000        | Indonesia Government International Bond, 8.50%, 12/10/2035          | 368.065     |
| 400.000        | Chile Government International Bond, 3.50%, 31/01/2034              | 350.800     |
| 300.000        | Hungary Government International Bond, 7.63%, 29/03/2041            | 350.187     |
| 360.000        | Israel Government International Bond, 5.75%, 12/03/2054             | 345.470     |
| 340.000        | Abu Dhabi Government International Bond, 5.50%, 30/04/2054          | 334.312     |
| 7.790.000      | Czech Republic Government Bond, 2.75%, 23/07/2029                   | 327.244     |
| 325.000        | First Abu Dhabi Bank PJSC, 5.00%, 28/02/2029                        | 322.592     |
| 291.000        | Chile Government International Bond, 3.88%, 09/07/2031              | 316.719     |
| 1.313.000      | Republic of Poland Government Bond, 4.75%, 25/07/2029               | 315.314     |
| 1.398.000      | Republic of Poland Government Bond, 2.75%, 25/10/2029               | 315.189     |
| 400.000        | Panama Government International Bond, 2.25%, 29/09/2032             | 298.400     |
| 1.200.000      | Romania Government Bond, 8.25%, 29/09/2032                          | 280.888     |

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile       | Wertpapierbezeichnung   | Erlöse US\$ |
|---------------|---|-------------|
| 1.371.000     | Panama Government International Bond, 6.70%, 26/01/2036               | 1.308.286   |
| 975.000       | Indonesia Government International Bond, 8.50%, 12/10/2035            | 1.246.515   |
| 1.000.000     | Kazakhstan Government International Bond, 1.50%, 30/09/2034           | 944.034     |
| 1.000.000     | Philippine Government International Bond, 0.70%, 03/02/2029           | 942.598     |
| 785.200       | United States Treasury Bill, 0.00%, 18/01/2024                        | 784.283     |
| 640.000       | Kazakhstan Government International Bond, 2.38%, 09/11/2028           | 693.915     |
| 753.000       | Hungary Government International Bond, 1.63%, 28/04/2032              | 671.889     |
| 22.000.000    | Thailand Government Bond, 0.75%, 17/09/2024                           | 622.411     |
| 600.000       | Uruguay Government International Bond, 4.38%, 23/01/2031              | 596.920     |
| 633.000       | Romanian Government International Bond, 3.88%, 29/10/2035             | 555.561     |
| 600.000       | Romanian Government International Bond, 3.75%, 07/02/2034             | 542.655     |
| 8.491.000.000 | Indonesia Treasury Bond, 6.88%, 15/04/2029                            | 520.993     |
| 16.772.000    | Thailand Government Bond, 2.40%, 17/03/2029                           | 467.429     |
| 480.000       | UAE International Government Bond, 4.95%, 07/07/2052                  | 464.694     |
| 8.000.000     | Mexican Bonos, 7.50%, 03/06/2027                                      | 416.297     |
| 1.683.000     | Republic of Poland Government Bond, 2.75%, 25/10/2029                 | 379.483     |
| 7.770.000     | Mexican Bonos, 7.75%, 29/05/2031                                      | 369.631     |
| 400.000       | Panama Government International Bond, 6.40%, 14/02/2035               | 367.240     |
| 300.000       | Peruvian Government International Bond, 8.75%, 21/11/2033             | 364.705     |
| 5.300.000.000 | Indonesia Treasury Bond, 7.00%, 15/02/2033                            | 347.997     |
| 400.000       | Indonesia Government International Bond, 1.10%, 12/03/2033            | 344.104     |
| 359.000       | Korea Mine Rehabilitation & Mineral Resources Corp, 1.75%, 15/04/2026 | 341.148     |
| 300.000       | Chile Government International Bond, 4.13%, 05/07/2034                | 335.522     |
| 1.550.000     | Malaysia Government Bond, 3.90%, 16/11/2027                           | 335.485     |
| 400.000       | Romanian Government International Bond, 3.38%, 08/02/2038             | 333.445     |
| 6.504.600     | Mexican Bonos, 8.50%, 31/05/2029                                      | 322.999     |
| 5.108.000.000 | Indonesia Treasury Bond, 6.63%, 15/02/2034                            | 320.065     |
| 260.000       | Philippine Government International Bond, 9.50%, 02/02/2030           | 315.016     |

## Emerging Markets Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                          | Kosten US\$ |
|-----------|--|-------------|
| 408.704   | Tbo Tek Ltd                                    | 4.502.075   |
| 485.595   | Premier Energies Ltd                           | 2.604.968   |
| 16.741    | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd      | 2.467.453   |
| 198.400   | Alibaba Group Holding Ltd                      | 2.103.567   |
| 28.113    | Kia Corp                                       | 1.982.834   |
| 286.000   | Hon Hai Precision Industry Co Ltd              | 1.869.264   |
| 594.600   | Foxconn Industrial Internet Co Ltd Class A     | 1.820.334   |
| 149.400   | Meituan Class B                                | 1.778.465   |
| 335.000   | ASE Technology Holding Co Ltd                  | 1.693.894   |
| 24.000    | Wiwynn Corp                                    | 1.657.253   |
| 35.600    | Tencent Holdings Ltd                           | 1.580.169   |
| 277.500   | China Merchants Bank Co Ltd - H Shares         | 1.515.312   |
| 177.000   | Sieyuan Electric Co Ltd Class A                | 1.406.157   |
| 129.178   | Standard Bank Group Ltd                        | 1.403.250   |
| 77.346    | WAAREE Energies Ltd                            | 1.388.794   |
| 122.000   | Delta Electronics Inc                          | 1.336.463   |
| 93.921    | XPRO India Ltd                                 | 1.242.761   |
| 265.100   | Ningbo Sanxing Medical Electric Co Ltd Class A | 1.239.954   |
| 3.322.000 | Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT           | 1.227.431   |
| 152.800   | AIA Group Ltd                                  | 1.223.726   |
| 20.402    | Samsung Electronics Co Ltd                     | 1.213.479   |
| 751       | MercadoLibre Inc                               | 1.200.010   |
| 34.227    | Mahindra & Mahindra Ltd                        | 1.146.943   |
| 636.105   | Alpha Services & Holdings SA                   | 1.130.105   |
| 36.000    | BYD Co Ltd - H Shares                          | 1.122.326   |
| 14.811    | DB Insurance Co Ltd                            | 1.115.163   |
| 1.768.500 | Agricultural Bank of China Ltd Class A         | 1.102.762   |
| 1.534.000 | China Construction Bank Corp - H Shares        | 1.086.075   |
| 230.500   | China Resources Beer Holdings Co Ltd           | 1.061.424   |
| 115.349   | Unimech Aerospace                              | 1.059.481   |
| 1.432.660 | SpiceJet Ltd                                   | 1.056.292   |
| 61.100    | Proya Cosmetics Co Ltd Class A                 | 1.048.344   |

## Emerging Markets Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                      | Erlöse US\$ |
|-----------|--|-------------|
| 336.519   | Tbo Tek Ltd                                | 6.811.508   |
| 31.038    | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd  | 5.506.567   |
| 360.473   | Premier Energies Ltd                       | 4.935.833   |
| 71.446    | Samsung Electronics Co Ltd                 | 3.497.367   |
| 797.900   | Foxconn Industrial Internet Co Ltd Class A | 2.722.148   |
| 18.281    | SK Hynix Inc                               | 2.606.257   |
| 9.830     | NVIDIA Corp                                | 2.000.392   |
| 41.100    | Tencent Holdings Ltd                       | 1.928.486   |
| 190.400   | Alibaba Group Holding Ltd                  | 1.782.899   |
| 2.394.000 | China Construction Bank Corp - H Shares    | 1.781.628   |
| 24.000    | Wiwynn Corp                                | 1.670.149   |
| 67.000    | Asia Vital Components Co Ltd               | 1.413.392   |
| 197.200   | AIA Group Ltd                              | 1.316.673   |
| 38.600    | WAAREE Energies Ltd                        | 1.233.162   |
| 1.768.500 | Agricultural Bank of China Ltd Class A     | 1.198.610   |
| 195.896   | Banco do Brasil SA                         | 1.111.829   |
| 148.923   | Saudi Arabian Oil Co                       | 1.090.036   |
| 31.000    | MediaTek Inc                               | 1.074.654   |
| 448.000   | Uni-President Enterprises Corp             | 1.061.678   |
| 40.403    | Antofagasta Plc                            | 1.060.147   |

## Euro Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                                      | Kosten EUR |
|-----------|--|------------|
| 3.453.346 | European Union, 3.25%, 04/07/2034                          | 3.541.145  |
| 3.163.984 | European Stability Mechanism, 2.63%, 18/09/2029            | 3.205.004  |
| 3.112.698 | European Union, 3.13%, 04/12/2030                          | 3.168.898  |
| 2.890.000 | European Financial Stability Facility, 3.50%, 11/04/2029   | 2.982.519  |
| 2.700.000 | Caisse de Refinancement de l'Habitat SA, 3.13%, 23/02/2033 | 2.746.095  |
| 1.800.000 | SFIL SA, 3.13%, 17/09/2029                                 | 1.803.512  |
| 2.420.312 | French Republic Government Bond OAT, 1.50%, 25/05/2050     | 1.659.728  |
| 1.697.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 1.25%, 30/06/2027         | 1.622.289  |
| 1.560.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 2.88%, 28/12/2029         | 1.585.751  |
| 1.350.000 | French Republic Government Bond OAT, 2.75%, 25/02/2029     | 1.355.967  |
| 1.180.241 | European Union, 1.63%, 04/12/2029                          | 1.123.683  |
| 1.156.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.50%, 01/12/2032       | 1.101.310  |
| 1.000.000 | Cie de Financement Foncier SA, 3.00%, 10/03/2033           | 998.669    |
| 1.000.000 | Bpifrance SACA, 2.88%, 25/11/2029                          | 992.077    |
| 928.242   | Slovakia Government Bond, 3.75%, 06/03/2034                | 949.071    |
| 935.000   | Toronto-Dominion Bank, 2.86%, 15/04/2031                   | 935.485    |
| 865.000   | Spain Government Bond, 1.25%, 31/10/2030                   | 789.708    |
| 700.000   | BPCE SA, 4.13%, 08/03/2033                                 | 708.466    |
| 700.000   | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.88%, 12/07/2031       | 704.336    |
| 667.000   | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.45%, 15/07/2027       | 678.377    |

## Euro Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung   | Erlöse EUR |
|-----------|---|------------|
| 2.973.000 | European Financial Stability Facility, 3.50%, 11/04/2029            | 3.117.514  |
| 1.555.000 | European Union, 3.25%, 04/07/2034                                   | 1.595.676  |
| 1.350.000 | French Republic Government Bond OAT, 2.75%, 25/02/2029              | 1.363.217  |
| 1.275.241 | European Union, 1.63%, 04/12/2029                                   | 1.217.296  |
| 900.000   | Caisse de Refinancement de l'Habitat SA, 3.13%, 23/02/2033          | 907.380    |
| 688.992   | Netherlands Government Bond, 4.00%, 15/01/2037                      | 791.652    |
| 565.000   | Republic of Poland Government International Bond, 3.63%, 11/01/2034 | 575.339    |
| 524.000   | Spain Government Bond, 3.45%, 31/10/2034                            | 547.349    |
| 568.696   | Slovakia Government Bond, 1.63%, 21/01/2031                         | 529.459    |
| 451.000   | European Union, 3.13%, 04/12/2030                                   | 466.329    |
| 480.000   | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 1.25%, 30/06/2027                  | 465.845    |
| 450.000   | DSM BV, 3.63%, 02/07/2034   | 455.625    |
| 435.000   | Molson Coors Beverage Co, 3.80%, 15/06/2032                         | 445.771    |
| 400.000   | National Grid North America Inc, 4.67%, 12/09/2033                  | 438.064    |
| 459.996   | French Republic Government Bond OAT, 1.50%, 25/05/2031              | 427.552    |
| 400.000   | A2A SpA, 5.00%, 31/12/2149  | 409.920    |
| 400.000   | New York Life Global Funding, 3.63%, 07/06/2034                     | 409.792    |
| 400.000   | Commerzbank AG, 4.88%, 16/10/2034                                   | 407.826    |
| 400.000   | Credit Agricole Home Loan SFH SA, 3.13%, 18/10/2030                 | 406.780    |
| 400.000   | Electricite de France SA, 5.63%, 31/12/2149                         | 403.420    |

## Euro Bond Absolute Return – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

| Anteile    | Wertpapierbezeichnung   | Kosten EUR |
|------------|---|------------|
| 3.425.000  | Bundesobligation, 2.10%, 12/04/2029                               | 3.407.184  |
| 25.250.000 | Nykredit Realkredit AS, 4.00%, 01/10/2056                         | 3.340.050  |
| 3.145.824  | United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 2.13%, 15/04/2029 | 2.939.324  |
| 2.363.042  | United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0.13%, 15/04/2026 | 2.107.685  |
| 2.025.000  | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 2.63%, 26/04/2029                | 2.028.327  |
| 1.942.034  | European Union, 3.13%, 04/12/2030                                 | 1.974.046  |
| 1.896.629  | European Union, 3.00%, 04/12/2034                                 | 1.904.080  |
| 1.700.000  | European Stability Mechanism, 2.63%, 18/09/2029                   | 1.728.237  |
| 1.666.000  | European Financial Stability Facility, 3.50%, 11/04/2029          | 1.716.464  |
| 7.184.000  | Republic of Poland Government Bond, 4.75%, 25/07/2029             | 1.623.017  |
| 1.250.000  | United Kingdom Gilt, 4.13%, 22/07/2029                            | 1.500.440  |
| 1.500.000  | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.30%, 15/02/2033       | 1.487.685  |
| 1.358.000  | European Investment Bank, 2.88%, 15/10/2031                       | 1.379.892  |
| 6.310.000  | Republic of Poland Government Bond, 5.00%, 25/10/2034             | 1.372.568  |
| 32.400.000 | Czech Republic Government Bond, 4.90%, 14/04/2034                 | 1.370.180  |
| 1.356.000  | Lithuania Government International Bond, 3.50%, 03/07/2031        | 1.358.780  |
| 10.130.000 | Nykredit Realkredit AS, 4.00%, 01/10/2053                         | 1.352.973  |
| 5.450.000  | Republic of Poland Government Bond, 5.75%, 25/04/2029             | 1.283.816  |
| 1.218.000  | Croatia Government International Bond, 3.38%, 12/03/2034          | 1.211.393  |
| 28.880.000 | Czech Republic Government Bond, 4.50%, 11/11/2032                 | 1.191.068  |

## Euro Bond Absolute Return – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

| Anteile    | Wertpapierbezeichnung   | Erlöse EUR |
|------------|---|------------|
| 2.383.500  | United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0.13%, 15/04/2026 | 2.117.269  |
| 15.789.788 | Nykredit Realkredit AS, 4.00%, 01/10/2053                         | 2.087.594  |
| 1.666.000  | European Financial Stability Facility, 3.50%, 11/04/2029          | 1.749.717  |
| 1.480.000  | European Union, 3.00%, 04/12/2034                                 | 1.469.278  |
| 1.425.000  | Bundesobligation, 2.10%, 12/04/2029                               | 1.404.889  |
| 1.488.404  | United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 2.13%, 15/04/2029 | 1.382.591  |
| 5.450.000  | Republic of Poland Government Bond, 5.75%, 25/04/2029             | 1.277.636  |
| 4.900.000  | Republic of Poland Government Bond, 6.00%, 25/10/2033             | 1.174.274  |
| 1.135.000  | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.30%, 15/02/2033       | 1.142.438  |
| 8.070.801  | Nykredit Realkredit AS, 5.00%, 01/10/2053                         | 1.101.193  |
| 1.081.000  | Republic of Poland Government Bond, 3.63%, 11/01/2034             | 1.097.795  |
| 1.059.227  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.00%, 14/03/2028              | 1.053.835  |
| 1.000.000  | Bundesschatzanweisungen, 2.90%, 18/06/2026                        | 1.010.735  |
| 963.000    | European Financial Stability Facility, 2.88%, 28/05/2031          | 990.783    |
| 955.000    | Bundesobligation, 2.50%, 11/10/2029                               | 981.186    |
| 800.000    | Centrica Plc, 6.50%, 21/05/2055                                   | 959.827    |
| 4.070.000  | Republic of Poland Government Bond, 5.00%, 25/10/2034             | 890.114    |
| 950.000    | Slovakia Government Bond, 1.63%, 21/01/2031                       | 884.678    |
| 862.000    | Lithuania Government International Bond, 3.50%, 03/07/2031        | 872.597    |
| 934.455    | United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1.08%, 15/01/2027 | 867.014    |

## European High Yield Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung  | Kosten EUR |
|-----------|--|------------|
| 5.783.000 | Bellis Acquisition Co Plc, 8.13%, 14/05/2030                     | 6.744.477  |
| 5.871.000 | Orsted AS, 5.13%, 14/03/3024                                     | 5.895.061  |
| 5.215.000 | CECONOMY AG, 6.25%, 15/07/2029                                   | 5.226.371  |
| 6.090.000 | Castellum AB, 3.13%, 31/12/2149                                  | 5.218.813  |
| 5.000.000 | Proximus SADP, 4.75%, 31/12/2149                                 | 4.989.715  |
| 4.950.000 | Synthomer Plc, 7.38%, 02/05/2029                                 | 4.955.925  |
| 4.855.000 | Sappi Papier Holding GmbH, 3.13%, 15/04/2026                     | 4.778.376  |
| 4.565.000 | Bubbles Bidco SPA, 6.50%, 30/09/2031                             | 4.573.636  |
| 4.511.000 | Forvia SE, 5.50%, 15/06/2031                                     | 4.514.246  |
| 4.426.000 | ProGroup AG, 5.38%, 15/04/2031                                   | 4.382.845  |
| 4.445.000 | Elior Group SA, 3.75%, 15/07/2026                                | 4.333.681  |
| 4.944.000 | Grifols SA, 3.88%, 15/10/2028                                    | 4.262.711  |
| 4.355.000 | TK Elevator Midco GmbH, 4.38%, 15/07/2027                        | 4.226.650  |
| 4.068.000 | RAY Financing LLC, 6.50%, 15/07/2031                             | 4.114.662  |
| 4.100.000 | Air France-KLM, 4.63%, 23/05/2029                                | 4.085.467  |
| 4.115.000 | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 4.38%, 09/05/2030 | 4.074.895  |
| 3.977.000 | CT Investment GmbH, 6.38%, 15/04/2030                            | 4.004.428  |
| 3.908.000 | Amber Finco Plc, 6.63%, 15/07/2029                               | 3.977.726  |
| 3.954.000 | Neopharmed Gentili SpA, 7.13%, 08/04/2030                        | 3.961.425  |
| 4.050.000 | Primo Water Holdings Inc, 3.88%, 31/10/2028                      | 3.939.913  |

## European High Yield Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung   | Erlöse EUR |
|-----------|---|------------|
| 5.200.000 | EDP - Energias de Portugal SA, 5.94%, 23/04/2083                | 5.456.850  |
| 5.223.000 | Forvia SE, 5.50%, 15/06/2031                                    | 5.218.094  |
| 5.700.000 | Cellnex Telecom SA, 1.75%, 23/10/2030                           | 5.040.648  |
| 4.526.468 | IHO Verwaltungs GmbH, 8.75%, 15/05/2028                         | 4.817.486  |
| 4.595.000 | SES SA, 2.88%, 31/12/2149                                       | 4.369.794  |
| 3.545.000 | Dana Financing Luxembourg Sarl, 8.50%, 15/07/2031               | 3.884.331  |
| 3.223.000 | Bellis Acquisition Co Plc, 8.13%, 14/05/2030                    | 3.780.417  |
| 3.770.000 | Telecom Italia SpA, 4.00%, 11/04/2024                           | 3.761.876  |
| 3.500.000 | Bayer AG, 7.00%, 25/09/2083                                     | 3.565.386  |
| 3.420.000 | Nidda Healthcare Holding GmbH, 7.50%, 21/08/2026                | 3.546.540  |
| 2.755.000 | British Telecommunications Plc, 8.38%, 20/12/2083               | 3.437.361  |
| 3.392.000 | Avis Budget Finance Plc, 7.25%, 31/07/2030                      | 3.410.260  |
| 4.677.000 | Heimstaden Bostad Treasury BV, 1.63%, 13/10/2031                | 3.388.310  |
| 3.480.000 | Dana Financing Luxembourg Sarl, 3.00%, 15/07/2029               | 3.170.687  |
| 3.000.000 | Valeo SE, 5.38%, 28/05/2027                                     | 3.097.755  |
| 2.981.000 | Orsted AS, 5.13%, 14/03/3024                                    | 3.068.556  |
| 3.124.000 | Primo Water Holdings Inc, 3.88%, 31/10/2028                     | 2.987.403  |
| 3.000.000 | International Consolidated Airlines Group SA, 3.75%, 25/03/2029 | 2.955.550  |
| 3.000.000 | Abertis Infraestructuras Finance BV, 3.25%, 31/12/2149          | 2.940.608  |
| 2.912.000 | Jaguar Land Rover Automotive Plc, 4.50%, 15/07/2028             | 2.903.071  |

## European Sustainable Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung    | Kosten EUR |
|---------|--------------------------|------------|
| 438.495 | Sage Group Plc           | 5.722.371  |
| 40.250  | AstraZeneca Plc          | 5.508.149  |
| 203.720 | Compass Group Plc        | 5.360.940  |
| 808.227 | Haleon Plc               | 3.608.116  |
| 1.457   | Hermes International SCA | 3.362.762  |
| 27.903  | Galderma Group AG        | 2.344.588  |
| 68.860  | Dassault Systemes SE     | 2.241.214  |
| 401.137 | Nibe Industrier AB       | 2.200.873  |
| 6.016   | Spotify Technology SA    | 1.895.774  |
| 2.299   | ASML Holding NV          | 1.666.611  |
| 27.855  | Diploma Plc              | 1.491.385  |
| 2.792   | Ferrari NV               | 1.260.168  |
| 5.723   | EssilorLuxottica SA      | 1.178.100  |
| 8.979   | Beiersdorf AG            | 1.164.088  |
| 864     | Adyen NV                 | 1.031.092  |
| 12.685  | Scout24 SE               | 910.595    |
| 23.142  | Netcompany Group A/S     | 896.194    |
| 8.532   | Nestle SA                | 815.226    |
| 4.048   | Sartorius Stedim Biotech | 753.407    |
| 49.728  | Atlas Copco AB Class A   | 745.588    |
| 13.811  | Bakkafrost P/F           | 708.887    |
| 4.438   | Novo Nordisk A/S Class B | 516.585    |
| 1.413   | L'Oreal SA               | 512.552    |

## European Sustainable Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung           | Erlöse EUR |
|---------|---------------------------------|------------|
| 175.041 | 3i Group Plc                    | 6.246.509  |
| 5.436   | ASML Holding NV                 | 4.880.728  |
| 19.841  | Schneider Electric SE           | 4.406.763  |
| 31.631  | Novo Nordisk A/S Class B        | 3.962.193  |
| 15.435  | Kering SA                       | 3.867.678  |
| 30.808  | London Stock Exchange Group Plc | 3.732.036  |
| 17.487  | EssilorLuxottica SA             | 3.653.799  |
| 74.412  | Netcompany Group A/S            | 3.194.727  |
| 30.151  | Euronext NV                     | 2.775.865  |
| 5.558   | VAT Group AG                    | 2.588.632  |
| 50.979  | Bakkafrost P/F                  | 2.573.219  |
| 1.903   | Adyen NV                        | 2.556.067  |
| 83.499  | Compass Group Plc               | 2.547.060  |
| 19.154  | Reply SpA                       | 2.508.201  |
| 156.475 | Sage Group Plc                  | 2.262.028  |
| 5.351   | L'Oreal SA                      | 2.223.845  |
| 1.603   | Partners Group Holding AG       | 2.064.739  |
| 73.351  | Alfen NV                        | 2.055.433  |
| 20.672  | Nestle SA                       | 1.960.600  |
| 45.679  | RELX Plc                        | 1.944.020  |
| 6.491   | Tecan Group AG                  | 1.891.503  |
| 67.804  | Assa Abloy AB Class B           | 1.849.991  |
| 23.016  | Scout24 SE                      | 1.796.363  |
| 130.773 | CVS Group Plc                   | 1.790.890  |
| 401.137 | Nibe Industrier AB              | 1.640.439  |
| 3.710   | Ferrari NV                      | 1.534.332  |
| 114.400 | TeamViewer SE                   | 1.524.292  |
| 39.659  | Zalando SE                      | 984.456    |
| 137.963 | HelloFresh SE                   | 973.853    |
| 25.840  | SolarEdge Technologies Inc      | 926.343    |
| 7.080   | Straumann Holding AG            | 852.682    |
| 5.758   | Beiersdorf AG                   | 797.522    |

## Event Driven – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile    | Wertpapierbezeichnung                                  | Kosten US\$ |
|------------|--|-------------|
| 36.200.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 05/12/2024         | 35.781.924  |
| 26.355.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 27/02/2025         | 26.092.556  |
| 23.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 18/03/2025         | 22.763.754  |
| 22.425.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 21/01/2025         | 22.215.107  |
| 15.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 07/11/2024         | 14.853.258  |
| 15.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 19/12/2024         | 14.844.825  |
| 13.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 05/09/2024         | 12.860.531  |
| 10.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 07/01/2025         | 9.907.459   |
| 10.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 24/10/2024         | 9.868.197   |
| 9.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 06/08/2024         | 8.925.202   |
| 8.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 23/07/2024         | 7.869.284   |
| 7.635.000  | Morgan Stanley, 5.43%, 18/02/2026                      | 7.655.081   |
| 7.645.000  | Citibank NA, 5.19%, 19/11/2027                         | 7.646.389   |
| 7.635.000  | Goldman Sachs Bank USA, 5.22%, 21/05/2027              | 7.642.426   |
| 7.445.000  | Wells Fargo Bank NA, 5.49%, 11/12/2026                 | 7.532.282   |
| 7.379.000  | Simon Property Group LP, 3.50%, 01/09/2025             | 7.325.558   |
| 7.145.000  | JPMorgan Chase & Co, 5.16%, 22/09/2027                 | 7.167.015   |
| 7.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 02/05/2024         | 6.908.913   |
| 7.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 29/08/2024         | 6.908.116   |
| 7.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 20/06/2024         | 6.888.285   |
| 7.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 07/05/2024         | 6.879.678   |
| 7.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 16/05/2024         | 6.873.083   |
| 7.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 06/06/2024         | 6.869.036   |
| 7.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 30/05/2024         | 6.868.959   |
| 7.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 23/05/2024         | 6.868.446   |
| 7.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 13/06/2024         | 6.862.496   |
| 6.835.000  | Caterpillar Financial Services Corp, 5.01%, 14/05/2027 | 6.845.232   |
| 6.440.000  | Citigroup Inc, 6.90%, 17/03/2026                       | 6.483.173   |
| 6.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 17/10/2024         | 5.927.543   |
| 6.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 26/09/2024         | 5.921.625   |
| 6.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 27/06/2024         | 5.909.919   |
| 6.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 05/07/2024         | 5.903.596   |
| 6.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 16/07/2024         | 5.898.454   |

## Event Driven – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                                      | Erlöse US\$ |
|-----------|--|-------------|
| 8.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 05/12/2024             | 7.998.516   |
| 7.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 11/04/2024             | 6.998.986   |
| 7.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 16/05/2024             | 6.983.808   |
| 7.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 02/05/2024             | 6.977.512   |
| 7.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 07/05/2024             | 6.972.343   |
| 6.440.000 | Citigroup Inc, 6.90%, 17/03/2026                           | 6.464.214   |
| 6.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 30/04/2024             | 5.982.462   |
| 5.365.000 | Goldman Sachs Bank USA, 6.14%, 18/03/2027                  | 5.372.994   |
| 5.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 16/04/2024             | 4.995.620   |
| 5.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 23/04/2024             | 4.990.529   |
| 5.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 09/05/2024             | 4.984.939   |
| 4.940.000 | JPMorgan Chase & Co, 5.49%, 22/04/2027                     | 4.965.237   |
| 3.000.000 | JPMorgan Chase & Co, 6.01%, 23/06/2025                     | 3.001.581   |
| 3.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 18/04/2024             | 2.996.502   |
| 2.960.000 | JPMorgan Chase & Co, 6.29%, 24/02/2026                     | 2.970.186   |
| 2.500.000 | John Deere Capital Corp, 5.93%, 07/03/2025                 | 2.504.100   |
| 2.204.000 | Volkswagen Group of America Finance LLC, 6.20%, 20/03/2026 | 2.205.630   |
| 61.767    | StandardAero Inc   | 1.914.777   |
| 25.052    | Tempus AI Inc Class A                                      | 1.112.857   |
| 41.994    | Viking Holdings Ltd  | 1.098.143   |

## Global Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung                                       | Kosten US\$ |
|-------------|---|-------------|
| 3.416.000   | State of Lower Saxony, 2.63%, 09/01/2034                    | 3.714.673   |
| 3.685.000   | United States Treasury Note/Bond, 4.38%, 15/05/2034         | 3.709.241   |
| 3.165.000   | United States Treasury Note/Bond, 4.00%, 15/02/2034         | 3.083.382   |
| 2.832.336   | Bundesobligation, 2.10%, 12/04/2029                         | 2.993.297   |
| 2.659.595   | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.20%, 15/02/2034 | 2.824.514   |
| 2.000.000   | Estonia Government International Bond, 3.25%, 17/01/2034    | 2.175.491   |
| 1.600.000   | United Kingdom Gilt, 1.50%, 22/07/2026                      | 1.922.312   |
| 289.900.000 | Japan Government Ten Year Bond, 0.50%, 20/03/2033           | 1.890.539   |
| 1.720.000   | Land Berlin, 3.00%, 13/03/2054                              | 1.846.973   |
| 1.860.000   | United States Treasury Note/Bond, 3.88%, 15/08/2034         | 1.823.805   |
| 1.500.000   | State of Mecklenburg – Western Pomerania, 2.55%, 12/01/2032 | 1.636.867   |
| 1.500.000   | Romanian Government International Bond, 5.63%, 22/02/2036   | 1.599.335   |
| 1.400.000   | State of Hesse, 2.50%, 01/10/2031                           | 1.557.581   |
| 1.400.000   | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.85%, 01/07/2034        | 1.507.723   |
| 1.500.000   | Province of Manitoba Canada, 4.90%, 31/05/2034              | 1.495.890   |
| 1.331.000   | Spain Government Bond, 3.25%, 30/04/2034                    | 1.454.451   |
| 1.266.000   | Spain Government Bond, 3.45%, 31/10/2034                    | 1.366.533   |
| 1.000.000   | United Kingdom Gilt, 4.63%, 31/01/2034                      | 1.352.936   |
| 1.370.000   | United States Treasury Note/Bond, 4.25%, 15/08/2054         | 1.336.767   |
| 1.232.562   | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 2.13%, 17/10/2028        | 1.316.856   |

## Global Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

| Anteile        | Wertpapierbezeichnung                                       | Erlöse US\$ |
|----------------|---|-------------|
| 3.416.000      | State of Lower Saxony, 2.63%, 09/01/2034                    | 3.664.977   |
| 3.250.000      | United States Treasury Note/Bond, 4.38%, 15/05/2034         | 3.371.285   |
| 3.165.000      | United States Treasury Note/Bond, 4.00%, 15/02/2034         | 3.065.339   |
| 2.305.345      | Bundesobligation, 2.10%, 12/04/2029                         | 2.529.864   |
| 2.050.000      | State of Hesse, 2.88%, 04/07/2033                           | 2.288.600   |
| 2.065.000      | United States Treasury Note/Bond, 4.50%, 15/11/2033         | 2.147.322   |
| 1.600.000      | United States Treasury Note/Bond, 1.50%, 22/07/2026         | 1.967.274   |
| 1.720.000      | Land Berlin, 3.00%, 13/03/2054                              | 1.819.365   |
| 1.830.000      | United States Treasury Note/Bond, 3.88%, 15/08/2034         | 1.777.000   |
| 1.755.000      | United States Treasury Note/Bond, 4.13%, 15/08/2053         | 1.703.980   |
| 1.500.000      | Gemeinsame Deutsche Bundeslaender, 3.00%, 26/04/2030        | 1.644.881   |
| 1.500.000      | Romanian Government International Bond, 5.63%, 22/02/2036   | 1.622.709   |
| 1.500.000      | State of Mecklenburg – Western Pomerania, 2.55%, 12/01/2032 | 1.598.020   |
| 1.500.000      | Estonia Government International Bond, 3.25%, 17/01/2034    | 1.589.978   |
| 1.400.000      | State of Hesse, 2.50%, 01/10/2031                           | 1.481.817   |
| 1.300.000      | State of Brandenburg, 3.00%, 20/07/2033                     | 1.465.164   |
| 23.773.000.000 | Indonesia Treasury Bond, 6.63%, 15/05/2033                  | 1.425.988   |
| 1.236.000      | Autonomous Community of Madrid Spain, 3.60%, 30/04/2033     | 1.354.862   |
| 1.200.000      | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.85%, 01/07/2034        | 1.331.415   |
| 1.370.000      | United States Treasury Note/Bond, 4.25%, 15/08/2054         | 1.301.069   |

## Global Diversified Income FMP – 2024 – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Käufe insgesamt:

| Anteile    | Wertpapierbezeichnung                          | Kosten US\$ |
|------------|--|-------------|
| 35.290.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 18/06/2024 | 35.005.866  |
| 33.130.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 18/04/2024 | 32.718.412  |
| 30.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 12/06/2025 | 28.583.276  |
| 28.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 27/06/2024 | 27.848.557  |
| 18.390.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 14/05/2024 | 18.239.186  |

Verkäufe insgesamt:

| Anteile    | Wertpapierbezeichnung                                      | Erlöse US\$ |
|------------|--|-------------|
| 30.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 12/06/2025             | 28.577.280  |
| 7.060.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 18/04/2024             | 7.003.389   |
| 4.000.000  | Barclays Plc, 4.38%, 11/09/2024                            | 3.986.000   |
| 3.850.000  | Synchrony Financial, 4.25%, 15/08/2024                     | 3.839.875   |
| 3.685.000  | EQM Midstream Partners LP, 4.00%, 01/08/2024               | 3.666.944   |
| 3.005.000  | Buckeye Partners LP, 4.35%, 15/10/2024                     | 2.989.975   |
| 2.600.000  | Societe Generale SA, 2.63%, 16/10/2024                     | 2.573.142   |
| 2.500.000  | SNB Funding Ltd, 2.75%, 02/10/2024                         | 2.476.500   |
| 1.930.000  | Live Nation Entertainment Inc, 4.88%, 01/11/2024           | 1.921.315   |
| 1.600.000  | Huarong Finance 2019 Co Ltd, 3.25%, 13/11/2024             | 1.570.982   |
| 1.250.000  | REC Ltd, 3.38%, 25/07/2024                                 | 1.236.375   |
| 1.100.000  | Anglo American Capital Plc, 3.63%, 11/09/2024              | 1.093.213   |
| 1.000.000  | Weibo Corp, 3.50%, 05/07/2024                              | 998.500     |
| 889.000    | Wynn Macau Ltd, 4.88%, 01/10/2024                          | 884.111     |
| 889.000    | Minmetals Bounteous Finance BVI Ltd, 3.38%, 31/12/2149     | 883.666     |
| 450.000    | REC Ltd, 3.50%, 12/12/2024                                 | 441.576     |
| 400.000    | ABJA Investment Co Pte Ltd, 5.95%, 31/07/2024              | 399.404     |
| 249.000    | Adani Ports & Special Economic Zone Ltd, 3.38%, 24/07/2024 | 247.929     |

## Global Equity Megatrends – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung             | Kosten US\$ |
|-----------|-----------------------------------|-------------|
| 9.008.476 | Pets at Home Group Plc            | 30.046.864  |
| 146.443   | Nice Ltd ADR                      | 25.915.804  |
| 179.218   | Chart Industries Inc              | 24.957.994  |
| 872.589   | Perrigo Co Plc                    | 24.107.195  |
| 419.480   | Cisco Systems Inc                 | 23.509.091  |
| 253.466   | Amdocs Ltd                        | 21.523.903  |
| 257.250   | Alibaba Group Holding Ltd ADR     | 21.174.202  |
| 556.203   | Criteo SA ADR                     | 20.977.149  |
| 281.794   | Uber Technologies Inc             | 18.563.124  |
| 106.010   | Expedia Group Inc                 | 14.728.627  |
| 636.584   | ModivCare Inc                     | 14.475.048  |
| 297.063   | Delta Air Lines Inc               | 13.728.077  |
| 978.993   | Despegar.com Corp                 | 12.458.707  |
| 394.639   | Scholastic Corp                   | 12.343.145  |
| 192.894   | Tetra Tech Inc                    | 11.930.555  |
| 251.480   | Corning Inc                       | 10.447.848  |
| 505.700   | Element Fleet Management Corp     | 10.107.215  |
| 50.082    | Alphabet Inc Class A              | 8.388.004   |
| 466.655   | Zeta Global Holdings Corp Class A | 8.348.086   |
| 144.875   | ATI Inc                           | 8.045.507   |
| 284.904   | Gen Digital Inc                   | 7.498.484   |
| 279.654   | Element Solutions Inc             | 7.351.520   |
| 68.062    | Vistra Corp                       | 6.712.569   |
| 88.692    | Stericycle Inc                    | 4.234.988   |

## Global Equity Megatrends – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung             | Erlöse US\$ |
|---------|-----------------------------------|-------------|
| 226.392 | Stericycle Inc                    | 13.766.298  |
| 48.880  | Chart Industries Inc              | 8.418.110   |
| 74.340  | Vistra Corp                       | 7.252.980   |
| 29.229  | Expedia Group Inc                 | 5.490.626   |
| 94.457  | Delta Air Lines Inc               | 5.049.013   |
| 283.922 | Despegar.com Corp                 | 4.628.364   |
| 24.555  | TE Connectivity Ltd               | 3.498.760   |
| 105.752 | Zeta Global Holdings Corp Class A | 2.236.650   |
| 33.797  | Criteo SA ADR                     | 1.325.848   |
| 7.605   | Uber Technologies Inc             | 569.642     |
| 9.844   | Gen Digital Inc                   | 220.764     |
| 2.868   | Perrigo Co Plc                    | 96.921      |
| 22.661  | Pets at Home Group Plc            | 88.534      |
| 1.200   | Alibaba Group Holding Ltd ADR     | 87.734      |
| 1.994   | ModivCare Inc                     | 81.026      |
| 918     | Amdocs Ltd                        | 80.151      |
| 2.550   | Corning Inc                       | 77.784      |
| 535     | Alphabet Inc Class A              | 72.557      |
| 4.209   | Element Fleet Management Corp     | 69.346      |
| 1.816   | Scholastic Corp                   | 67.566      |

## Global Flexible Credit Income – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung  | Kosten US\$ |
|-----------|--|-------------|
| 2.730.000 | UKG Inc, 6.88%, 01/02/2031   | 2.757.074   |
| 2.500.000 | Aimco CLO 16 Ltd Series 2021-16X Class D1R, 7.20%, 17/07/2037                      | 2.500.000   |
| 2.390.000 | XPO Inc, 7.13%, 01/02/2032   | 2.473.999   |
| 2.585.000 | CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC, 5.50%, 15/06/2031                          | 2.473.955   |
| 2.680.000 | HealthEquity Inc, 4.50%, 01/10/2029  | 2.471.001   |
| 2.565.000 | Medline Borrower LP, 5.25%, 01/10/2029   | 2.404.091   |
| 2.300.000 | Alpha Generation LLC, 6.75%, 15/10/2032  | 2.328.893   |
| 2.215.000 | Wand NewCo 3 Inc, 7.63%, 30/01/2032  | 2.268.186   |
| 2.295.000 | BCPE Empire Holdings Inc, 7.63%, 01/05/2027  | 2.265.231   |
| 2.160.000 | Six Flags Entertainment Corp, 7.25%, 15/05/2031                                    | 2.174.784   |
| 2.125.000 | AmWINS Group Inc, 6.38%, 15/02/2029  | 2.133.912   |
| 2.075.000 | Lightning Power LLC, 7.25%, 15/08/2032   | 2.113.075   |
| 1.880.000 | Civitas Resources Inc, 8.63%, 01/11/2030   | 2.002.069   |
| 2.000.000 | AGL CLO 9 Ltd Series 2020-9X Class DR, 7.84%, 15/04/2037                           | 2.000.000   |
| 2.000.000 | Ballyrock CLO 26 Ltd Series 2024-26X Class C1, 8.63%, 15/07/2037                   | 2.000.000   |
| 2.000.000 | Canyon CLO 2023-2 Ltd Series 2023-2X Class D, 7.90%, 15/05/2037                    | 2.000.000   |
| 2.000.000 | GoldenTree Loan Management US CLO 9 Ltd Series 2021-9X Class DR, 7.64%, 20/04/2037 | 2.000.000   |
| 2.000.000 | Invesco US CLO 2024-2 Ltd Series 2024-2X Class D, 8.92%, 25/07/2037                | 2.000.000   |
| 2.000.000 | Invesco US CLO 2024-1 Ltd Series 2024-1RX Class ER, 12,72%, 20/04/2037             | 2.000.000   |
| 2.000.000 | OCP CLO Ltd Series 2024-38X Class D1, 7.15%, 21/01/2038                            | 2.000.000   |

## Global Flexible Credit Income – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung  | Erlöse US\$ |
|-----------|--|-------------|
| 5.080.000 | United States Treasury Note/Bond, 3.88%, 15/05/2043                            | 4.631.595   |
| 3.690.000 | APX Group Inc, 5.75%, 15/07/2029   | 3.498.827   |
| 3.200.000 | American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd, 5.75%, 20/04/2029            | 3.150.026   |
| 2.985.000 | CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC, 5.50%, 15/06/2031                      | 2.908.687   |
| 2.580.000 | TransDigm Inc, 6.75%, 15/08/2028   | 2.632.717   |
| 2.595.000 | Summit Midstream Holdings LLC/Summit Midstream Finance Corp, 8.50%, 15/10/2026 | 2.600.066   |
| 2.680.000 | HealthEquity Inc, 4.50%, 01/10/2029  | 2.509.900   |
| 2.500.000 | AIMCO CLO 16 Ltd Series 2021-16X Class D, 8.48%, 17/01/2035                    | 2.500.000   |
| 2.400.000 | KB Home, 7.25%, 15/07/2030   | 2.475.000   |
| 2.265.000 | Civitas Resources Inc, 8.63%, 01/11/2030                                       | 2.406.499   |
| 2.510.000 | New Fortress Energy Inc, 6.50%, 30/09/2026                                     | 2.401.643   |
| 2.550.000 | Boeing Co, 5.81%, 01/05/2050   | 2.395.802   |
| 2.305.000 | Comstock Resources Inc, 6.75%, 01/03/2029                                      | 2.210.200   |
| 2.035.000 | Ritchie Bros Holdings Inc, 7.75%, 15/03/2031                                   | 2.143.079   |
| 2.085.000 | Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp, 8.25%, 31/12/2028        | 2.118.844   |
| 2.125.000 | United Rentals North America Inc, 5.25%, 15/01/2030                            | 2.064.948   |
| 2.000.000 | Invesco US CLO 2024-1 Ltd Series 2024-1RX Class ER, 12.72%, 15/04/2037         | 2.027.500   |
| 2.035.000 | Camelot Return Merger Sub Inc, 8.75%, 01/08/2028                               | 2.010.513   |
| 2.000.000 | TCW CLO Ltd Series 2018-1X Class D, 8.50%, 25/04/2031                          | 2.000.000   |
| 2.400.000 | EPR Properties, 3.60%, 15/11/2031  | 1.999.272   |

## Global High Yield Engagement – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung   | Kosten US\$ |
|-----------|---|-------------|
| 4.360.000 | Medline Borrower LP, 5.25%, 01/10/2029  | 4.111.429   |
| 3.085.000 | Lightning Power LLC, 7.25%, 15/08/2032  | 3.158.676   |
| 2.900.000 | Block Inc, 6.50%, 15/05/2032  | 2.923.339   |
| 2.970.000 | CSC Holdings LLC, 11.75%, 31/01/2029  | 2.855.023   |
| 2.675.000 | UKG Inc, 6.88%, 01/02/2031  | 2.693.631   |
| 2.615.000 | Champions Financing Inc, 8.75%, 15/02/2029                                      | 2.672.479   |
| 2.650.000 | Alpha Generation LLC, 6.75%, 15/10/2032   | 2.670.185   |
| 3.290.000 | Bausch Health Cos Inc, 4.88%, 01/06/2028  | 2.626.600   |
| 2.600.000 | Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd, 5.63%, 15/02/2029                            | 2.549.588   |
| 2.000.000 | Telecom Italia SpA, 7.88%, 31/07/2028   | 2.403.683   |
| 2.490.000 | Cloud Software Group Inc, 6.50%, 31/03/2029                                     | 2.383.491   |
| 2.220.000 | XPO Inc, 7.13%, 01/02/2032  | 2.280.019   |
| 2.235.000 | Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer, 7.00%, 15/01/2031 | 2.271.957   |
| 2.230.000 | Post Holdings Inc, 6.38%, 01/03/2033  | 2.226.416   |
| 1.782.000 | Bellis Acquisition Co Plc, 8.13%, 14/05/2030                                    | 2.223.968   |
| 2.200.000 | Acrisure LLC/Acrisure Finance Inc, 7.50%, 06/11/2030                            | 2.221.614   |
| 2.410.000 | Sunrise FinCo I BV, 4.88%, 15/07/2031   | 2.166.444   |
| 2.415.000 | 1011778 BC ULC/New Red Finance Inc, 4.00%, 15/10/2030                           | 2.160.007   |
| 2.485.000 | Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp, 6.00%, 01/06/2029    | 2.116.089   |
| 2.319.000 | Braskem Netherlands Finance BV, 7.25%, 13/02/2033                               | 2.111.086   |

## Global High Yield Engagement – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung   | Erlöse US\$ |
|-----------|---|-------------|
| 3.270.000 | Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp, 5.88%, 30/06/2029 | 3.086.348   |
| 3.050.000 | GTCR AP Finance Inc, 8.00%, 15/05/2027                                  | 3.052.394   |
| 2.915.000 | Solaris Midstream Holdings LLC, 7.63%, 01/04/2026                       | 2.933.114   |
| 2.985.000 | Medline Borrower LP, 5.25%, 01/10/2029                                  | 2.905.773   |
| 3.160.000 | 1011778 BC ULC/New Red Finance Inc, 4.00%, 15/10/2030                   | 2.861.375   |
| 2.660.000 | Civitas Resources Inc, 8.63%, 01/11/2030                                | 2.844.385   |
| 2.541.000 | Verisure Holding AB, 3.88%, 15/07/2026                                  | 2.700.160   |
| 2.645.000 | Energizer Holdings Inc, 6.50%, 31/12/2027                               | 2.622.506   |
| 2.465.000 | NCL Corp Ltd, 8.13%, 15/01/2029   | 2.587.757   |
| 2.415.000 | Windsor Holdings III LLC, 8.50%, 15/06/2030                             | 2.494.331   |
| 2.497.000 | Banco Mercantil del Norte SA, 7.50%, 31/12/2149                         | 2.428.009   |
| 2.480.000 | Clearway Energy Operating LLC, 4.75%, 15/03/2028                        | 2.379.258   |
| 2.185.000 | Lorca Telecom Bondco SA, 4.00%, 18/09/2027                              | 2.321.270   |
| 2.520.000 | Ziggo BV, 4.88%, 15/01/2030   | 2.270.613   |
| 2.339.000 | Sasol Financing USA LLC, 6.50%, 27/09/2028                              | 2.245.695   |
| 2.285.000 | BBVA Bancomer SA, 5.88%, 13/09/2034                                     | 2.143.890   |
| 2.705.000 | Nemak SAB de CV, 3.63%, 28/06/2031                                      | 2.117.825   |
| 2.105.000 | SRS Distribution Inc, 6.13%, 01/07/2029                                 | 2.108.488   |
| 2.125.000 | Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd, 5.63%, 15/02/2029                    | 2.094.251   |
| 1.960.000 | Cemex SAB de CV, 9.13%, 31/12/2149                                      | 2.065.968   |

## Global Investment Grade Credit – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                                     | Kosten US\$ |
|-----------|---|-------------|
| 1.600.000 | NGG Finance Plc, 5.63%, 18/06/2073                        | 2.069.197   |
| 1.284.000 | AA Bond Co Ltd, 6.85%, 31/07/2031                         | 1.657.800   |
| 1.200.000 | Coventry Building Society, 5.88%, 12/03/2030              | 1.582.595   |
| 1.400.000 | Warnermedia Holdings Inc, 4.69%, 17/05/2033               | 1.520.842   |
| 1.425.000 | Ally Financial Inc, 6.18%, 26/07/2035                     | 1.443.650   |
| 1.405.000 | Algonquin Power & Utilities Corp, 5.37%, 15/06/2026       | 1.410.925   |
| 1.000.000 | OSB Group Plc, 8.88%, 16/01/2030                          | 1.381.342   |
| 1.200.000 | AA Bond Co Ltd, 3.25%, 31/07/2028                         | 1.374.869   |
| 1.275.000 | GE HealthCare Technologies Inc, 5.86%, 15/03/2030         | 1.352.247   |
| 1.200.000 | Daimler Truck International Finance BV, 3.38%, 23/09/2030 | 1.316.120   |
| 1.315.000 | United States Treasury Note/Bond, 4.13%, 31/03/2029       | 1.304.834   |
| 1.299.000 | Otis Worldwide Corp, 5.13%, 19/11/2031                    | 1.300.276   |
| 1.260.000 | JPMorgan Chase & Co, 4.60%, 22/10/2030                    | 1.260.509   |
| 1.250.000 | Lloyds Banking Group Plc, 5.09%, 26/11/2028               | 1.250.686   |
| 1.210.000 | OGE Energy Corp, 5.45%, 15/05/2029                        | 1.237.337   |
| 1.200.000 | Stellantis NV, 2.75%, 01/04/2032                          | 1.208.421   |
| 1.095.000 | Timken Co, 4.13%, 23/05/2034                              | 1.195.202   |
| 1.100.000 | Standard Chartered Plc, 2.50%, 09/09/2030                 | 1.148.751   |
| 1.130.000 | JPMorgan Chase & Co, 5.29%, 22/07/2035                    | 1.141.053   |
| 1.110.000 | Barclays Plc, 5.67%, 12/03/2028                           | 1.124.841   |

## Global Investment Grade Credit – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung   | Erlöse US\$ |
|-----------|---|-------------|
| 1.625.000 | HSBC Holdings Plc, 2.01%, 22/09/2028                                | 1.476.725   |
| 1.200.000 | Daimler Truck International Finance BV, 3.38%, 23/09/2030           | 1.300.247   |
| 1.315.000 | United States Treasury Note/Bond, 4.13%, 31/03/2029                 | 1.291.831   |
| 1.000.000 | Morgan Stanley, 3.96%, 21/03/2035                                   | 1.105.942   |
| 1.090.000 | WEC Energy Group Inc, 4.75%, 09/01/2026                             | 1.079.601   |
| 856.000   | Molson Coors Beverage Co, 3.80%, 15/06/2032                         | 926.213     |
| 1.000.000 | Athene Global Funding, 1.61%, 29/06/2026                            | 924.604     |
| 915.000   | GE HealthCare Technologies Inc, 5.60%, 15/11/2025                   | 922.730     |
| 700.000   | BPCE SA, 5.38%, 22/10/2031  | 900.308     |
| 875.000   | Regal Rexnord Corp, 6.05%, 15/04/2028                               | 894.381     |
| 900.000   | JPMorgan Chase & Co, 4.01%, 23/04/2029                              | 860.940     |
| 628.000   | Schroders Plc, 6.35%, 18/07/2034                                    | 810.141     |
| 600.000   | Centrica Plc, 6.50%, 21/05/2055                                     | 777.746     |
| 700.000   | European Union, 0.50%, 04/04/2025                                   | 767.965     |
| 700.000   | Intesa Sanpaolo SpA, 4.27%, 14/11/2036                              | 738.055     |
| 750.000   | Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp, 3.80%, 15/09/2030 | 707.255     |
| 700.000   | Dell International LLC/EMC Corp, 5.30%, 01/10/2029                  | 703.640     |
| 600.000   | Schaeffler AG, 4.50%, 28/03/2030                                    | 669.890     |
| 645.000   | PNC Financial Services Group Inc, 5.40%, 23/07/2035                 | 661.499     |
| 600.000   | Anglo American Capital Plc, 4.13%, 15/03/2032                       | 654.260     |

## Global Opportunistic Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

| Anteile        | Wertpapierbezeichnung                                  | Kosten US\$ |
|----------------|--|-------------|
| 2.547.000      | Australia Government Bond, 3.25%, 21/04/2029           | 1.695.865   |
| 1.361.000      | United States Treasury Note/Bond, 4.13%, 31/07/2031    | 1.393.170   |
| 1.259.279      | Bundesobligation, 2.10%, 12/04/2029                    | 1.348.571   |
| 1.118.000      | Bundesobligation, 2.50%, 11/10/2029                    | 1.250.043   |
| 16.026.000.000 | Indonesia Treasury Bond, 6.63%, 15/02/2034             | 1.012.150   |
| 20.700.000     | Mexican Bonos, 7.75%, 23/11/2034                       | 999.769     |
| 704.000        | United Kingdom Gilt, 0.50%, 31/01/2029                 | 785.942     |
| 116.250.000    | Japan Government Ten Year Bond, 0.80%, 20/03/2034      | 733.065     |
| 236.820.000    | Hungary Government Bond, 7.00%, 24/10/2035             | 702.335     |
| 764.000        | French Republic Government Bond OAT, 0.00%, 25/11/2031 | 700.290     |
| 656.000        | United States Treasury Note/Bond, 3.63%, 30/09/2031    | 641.601     |
| 11.370.000     | Czech Republic Government Bond, 4.90%, 14/04/2034      | 543.762     |
| 529.000        | United States Treasury Note/Bond, 4.25%, 31/05/2025    | 524.662     |
| 526.000        | United States Treasury Note/Bond, 3.88%, 15/08/2034    | 516.818     |
| 495.000        | Ginnie Mae II Pool, 5.50%, 01/02/2053                  | 499.294     |
| 495.000        | Ginnie Mae II Pool, 5.50%, 01/04/2054                  | 495.029     |
| 495.000        | Ginnie Mae II Pool, 5.50%, 01/03/2054                  | 494.954     |
| 495.000        | Ginnie Mae II Pool, 5.50%, 01/05/2053                  | 489.747     |
| 348.000        | United Kingdom Gilt, 4.13%, 22/07/2029                 | 456.512     |
| 395.000        | Ginnie Mae II Pool, 6.00%, 01/07/2054                  | 398.132     |

## Global Opportunistic Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

| Anteile       | Wertpapierbezeichnung                                       | Erlöse US\$ |
|---------------|---|-------------|
| 4.212.000     | New Zealand Government Bond, 3.50%, 14/04/2033              | 2.371.808   |
| 2.547.000     | Australia Government Bond, 3.25%, 21/04/2029                | 1.546.463   |
| 1.361.000     | United States Treasury Note/Bond, 4.13%, 31/07/2031         | 1.371.787   |
| 1.212.000     | Bundesobligation, 2.10%, 12/04/2029                         | 1.330.729   |
| 1.033.000     | Bundesobligation, 2.50%, 11/10/2029                         | 1.166.663   |
| 7.850.000     | China Government Bond, 2.62%, 25/06/2030                    | 1.141.210   |
| 3.099.000     | Republic of Poland Government Bond, 6.00%, 25/10/2033       | 820.634     |
| 704.000       | United Kingdom Gilt, 0.50%, 31/01/2029                      | 798.604     |
| 11.640.000    | Mexican Bonos, 7.75%, 29/05/2031                            | 597.035     |
| 529.000       | United States Treasury Note/Bond, 4.25%, 31/05/2025         | 528.606     |
| 549.000       | French Republic Government Bond OAT, 0.00%, 25/11/2031      | 504.933     |
| 495.000       | Ginnie Mae II Pool, 5.50%, 01/01/2054                       | 499.216     |
| 8.108.000.000 | Indonesia Treasury Bond, 7.00%, 15/02/2033                  | 496.648     |
| 495.000       | Ginnie Mae II Pool, 5.50%, 01/02/2053                       | 495.070     |
| 495.000       | Ginnie Mae II Pool, 5.50%, 01/03/2054                       | 495.068     |
| 499.871       | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 1.65%, 16/07/2032        | 493.305     |
| 495.000       | Ginnie Mae II Pool, 5.50%, 01/04/2054                       | 490.308     |
| 495.000       | Ginnie Mae II Pool, 5.50%, 01/05/2053                       | 488.663     |
| 395.000       | Ginnie Mae II Pool, 6.00%, 01/09/2054                       | 399.592     |
| 348.000       | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.60%, 15/08/2034 | 398.723     |

## Global Real Estate Securities – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung                  | Kosten US\$ |
|---------|--|-------------|
| 3.294   | AvalonBay Communities Inc              | 603.813     |
| 4.495   | Prologis Inc                           | 567.030     |
| 663     | Equinix Inc                            | 539.891     |
| 23.482  | Goodman Group                          | 536.807     |
| 235     | Comforia Residential REIT Inc          | 487.556     |
| 16.507  | Warehouses de Pauw CVA                 | 450.488     |
| 4.666   | Camden Property Trust                  | 444.530     |
| 430     | LaSalle Logiport REIT                  | 417.774     |
| 9.755   | Brookfield Corp                        | 406.170     |
| 37.000  | Sun Hung Kai Properties Ltd            | 357.744     |
| 7.673   | Gaming and Leisure Properties Inc      | 357.295     |
| 10.226  | Invitation Homes Inc                   | 351.590     |
| 65.347  | British Land Co Plc                    | 339.648     |
| 11.066  | Vonovia SE                             | 338.681     |
| 2.498   | Sun Communities Inc                    | 321.978     |
| 8.521   | UDR Inc                                | 320.761     |
| 137.160 | Scentre Group                          | 311.082     |
| 1.036   | Marriott International Inc Class A     | 290.676     |
| 5.598   | Ventas Inc                             | 288.360     |
| 2.007   | Digital Realty Trust Inc               | 284.534     |
| 1.384   | American Tower Corp                    | 284.197     |
| 3.287   | Iron Mountain Inc                      | 276.400     |
| 9.304   | Essential Properties Realty Trust Inc  | 272.088     |
| 7.465   | Cellnex Telecom SA                     | 266.472     |
| 7.021   | American Homes 4 Rent Class A          | 263.853     |
| 11.373  | Kimco Realty Corp                      | 261.826     |
| 6.953   | Kilroy Realty Corp                     | 259.903     |
| 2.383   | Federal Realty Investment Trust        | 246.750     |
| 1.104   | SBA Communications Corp Class A        | 242.286     |
| 78.575  | Stockland                              | 236.611     |
| 35.377  | Inmobiliaria Colonial Socimi SA        | 226.186     |
| 32.800  | Tokyu Fudosan Holdings Corp            | 226.167     |
| 107.500 | CapitaLand Investment Ltd              | 222.547     |
| 8.800   | Nomura Real Estate Holdings Inc        | 222.185     |
| 52      | Nippon Accommodations Fund Inc Class A | 218.903     |
| 7.000   | Sumitomo Realty & Development Co Ltd   | 216.120     |
| 1.861   | Crown Castle Inc                       | 211.876     |
| 12.595  | Macerich Co                            | 200.229     |
| 675     | Public Storage                         | 200.201     |
| 14.870  | American Healthcare REIT Inc           | 188.482     |
| 2.566   | BXP Inc                                | 184.416     |
| 1.357   | PSP Swiss Property AG                  | 176.114     |
| 1.141   | Simon Property Group Inc               | 173.941     |

## Global Real Estate Securities – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung               | Erlöse US\$ |
|---------|-------------------------------------|-------------|
| 1.662   | Equinix Inc                         | 1.523.998   |
| 11.752  | Prologis Inc                        | 1.277.132   |
| 6.558   | American Tower Corp                 | 1.275.282   |
| 3.742   | Public Storage                      | 1.173.857   |
| 4.554   | AvalonBay Communities Inc           | 987.110     |
| 5.271   | Simon Property Group Inc            | 883.364     |
| 6.773   | Welltower Inc                       | 828.085     |
| 7.785   | Iron Mountain Inc                   | 808.972     |
| 789     | LaSalle Logiport REIT               | 761.708     |
| 33.772  | Kimco Realty Corp                   | 725.929     |
| 12.537  | Ventas Inc                          | 725.443     |
| 6.722   | Crown Castle Inc                    | 685.087     |
| 54.300  | Mitsui Fudosan Co Ltd               | 640.914     |
| 4.962   | Sun Communities Inc                 | 617.177     |
| 4.008   | Extra Space Storage Inc             | 610.125     |
| 2.830   | SBA Communications Corp Class A     | 605.998     |
| 406.739 | Region RE Ltd                       | 579.909     |
| 59.883  | Sun Hung Kai Properties Ltd         | 571.988     |
| 139.400 | UOL Group Ltd                       | 546.644     |
| 4.666   | Camden Property Trust               | 542.344     |
| 23.482  | Goodman Group                       | 539.954     |
| 9.755   | Brookfield Corp                     | 519.993     |
| 9.321   | Realty Income Corp                  | 509.875     |
| 34.277  | RioCan Real Estate Investment Trust | 441.621     |
| 13.318  | Invitation Homes Inc                | 436.981     |
| 11.315  | Apartment Income REIT Corp          | 429.413     |
| 14.509  | VICI Properties Inc Class A         | 427.036     |
| 17.400  | Nomura Real Estate Holdings Inc     | 426.431     |
| 38.597  | Merlin Properties Socimi SA         | 422.787     |
| 235     | Comforia Residential REIT Inc       | 419.341     |
| 394.000 | Sino Land Co Ltd                    | 413.151     |
| 141.022 | Grainger Plc                        | 408.128     |
| 1.732   | Essex Property Trust Inc            | 403.066     |
| 11.453  | Cellnex Telecom SA                  | 376.102     |
| 3.708   | Gecina SA                           | 375.440     |
| 231     | Nippon Prologis REIT Inc            | 373.516     |
| 8.521   | UDR Inc                             | 370.354     |
| 7.673   | Gaming and Leisure Properties Inc   | 359.591     |
| 2.007   | Digital Realty Trust Inc            | 356.733     |
| 32.672  | UNITE Group Plc                     | 348.774     |

## Global Sustainable Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung                         | Kosten US\$ |
|---------|---|-------------|
| 18.698  | NVIDIA Corp                                   | 8.419.231   |
| 16.864  | Broadcom Inc                                  | 7.830.958   |
| 5.579   | MSCI Inc Class A                              | 3.220.558   |
| 43.645  | Uber Technologies Inc                         | 3.209.850   |
| 15.601  | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR | 2.942.791   |
| 104.711 | Compass Group Plc                             | 2.918.368   |
| 31.198  | CoStar Group Inc                              | 2.593.933   |
| 3.254   | Eli Lilly & Co                                | 2.111.623   |
| 4.588   | Microsoft Corp                                | 1.812.375   |
| 3.847   | Kinsale Capital Group Inc                     | 1.681.419   |
| 4.385   | Spotify Technology SA                         | 1.508.092   |
| 42.148  | Dassault Systemes SE                          | 1.499.126   |
| 1.903   | ASML Holding NV                               | 1.401.130   |
| 3.180   | L'Oreal SA                                    | 1.237.778   |
| 18.809  | Nasdaq Inc                                    | 1.126.279   |
| 767     | Adyen NV                                      | 999.747     |
| 1.657   | Adobe Inc                                     | 873.007     |
| 6.257   | Novo Nordisk A/S Class B                      | 796.234     |
| 4.902   | Amazon.com Inc                                | 734.579     |
| 3.970   | Alphabet Inc Class A                          | 590.879     |

## Global Sustainable Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung        | Erlöse US\$ |
|---------|------------------------------|-------------|
| 32.917  | Broadcom Inc                 | 6.368.817   |
| 11.247  | Microsoft Corp               | 4.725.952   |
| 6.349   | Netflix Inc                  | 4.715.833   |
| 7.934   | S&P Global Inc               | 3.833.400   |
| 5.826   | Intuit Inc                   | 3.695.525   |
| 21.348  | Alphabet Inc Class A         | 3.425.735   |
| 17.977  | Amazon.com Inc               | 3.399.678   |
| 7.560   | Elevance Health Inc          | 3.208.885   |
| 5.919   | Synopsys Inc                 | 2.906.223   |
| 6.917   | Ulta Beauty Inc              | 2.731.744   |
| 4.262   | UnitedHealth Group Inc       | 2.306.111   |
| 55.570  | 3i Group Plc                 | 2.072.029   |
| 3.457   | Thermo Fisher Scientific Inc | 2.023.560   |
| 21.604  | Estee Lauder Cos Inc Class A | 1.921.049   |
| 1.795   | ASML Holding NV              | 1.659.512   |
| 3.458   | Mastercard Inc Class A       | 1.658.402   |
| 5.780   | Visa Inc Class A             | 1.612.917   |
| 3.188   | VAT Group AG                 | 1.604.969   |
| 18.299  | Starbucks Corp               | 1.571.706   |
| 48.948  | Alfen NV                     | 1.548.745   |
| 1.014   | Adyen NV                     | 1.379.425   |
| 41.256  | Compass Group Plc            | 1.365.434   |
| 5.535   | Schneider Electric SE        | 1.307.373   |
| 24.300  | Recruit Holdings Co Ltd      | 1.271.898   |
| 2.835   | Moody's Corp                 | 1.197.594   |
| 17.022  | Nasdaq Inc                   | 1.149.427   |
| 11.818  | Brown & Brown Inc            | 1.118.964   |
| 8.806   | NVIDIA Corp                  | 1.048.427   |
| 4.940   | Applied Materials Inc        | 1.036.864   |
| 3.373   | Danaher Corp                 | 895.344     |
| 15.145  | Bakkafrost P/F               | 882.957     |

## Global Value – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung                        | Kosten US\$ |
|---------|--|-------------|
| 497     | Booking Holdings Inc                         | 1.898.970   |
| 6.099   | QUALCOMM Inc                                 | 1.014.720   |
| 5.017   | Apple Inc                                    | 963.379     |
| 12.632  | General Mills Inc                            | 923.782     |
| 11.319  | Gilead Sciences Inc                          | 919.250     |
| 11.004  | Medtronic Plc                                | 914.493     |
| 3.459   | American Express Co                          | 782.652     |
| 131.473 | BP Plc                                       | 768.696     |
| 227.826 | Intesa Sanpaolo SpA                          | 760.293     |
| 18.328  | Verizon Communications Inc                   | 732.016     |
| 18.157  | Cie Generale des Etablissements Michelin SCA | 694.448     |
| 13.198  | eBay Inc                                     | 682.476     |
| 23.003  | BHP Group Ltd                                | 646.992     |
| 2.468   | NXP Semiconductors NV                        | 639.133     |
| 2.280   | Cummins Inc                                  | 628.081     |
| 18.900  | KDDI Corp                                    | 590.709     |
| 30.049  | AT&T Inc                                     | 571.897     |
| 5.791   | Novartis AG                                  | 571.151     |
| 1.097   | Lockheed Martin Corp                         | 559.351     |
| 14.345  | UniCredit SpA                                | 557.821     |

## Global Value – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung      | Erlöse US\$ |
|---------|----------------------------|-------------|
| 353     | Booking Holdings Inc       | 1.432.484   |
| 11.050  | Merck & Co Inc             | 1.185.247   |
| 15.066  | Gilead Sciences Inc        | 1.063.668   |
| 4.517   | Apple Inc                  | 1.041.250   |
| 5.630   | Alphabet Inc Class A       | 965.008     |
| 720     | Broadcom Inc               | 940.918     |
| 19.366  | Cisco Systems Inc          | 908.079     |
| 25.061  | UniCredit SpA              | 897.098     |
| 4.153   | Ferguson Enterprises Inc   | 844.180     |
| 52.507  | Eni SpA                    | 816.512     |
| 2.763   | American Express Co        | 796.947     |
| 18.868  | Verizon Communications Inc | 792.037     |
| 69.700  | Honda Motor Co Ltd         | 768.899     |
| 15.647  | Comcast Corp Class A       | 645.506     |
| 55.218  | Fortescue Ltd              | 642.569     |
| 11.685  | Kroger Co                  | 641.133     |
| 1.100   | Ameriprise Financial Inc   | 614.474     |
| 4.050   | Nucor Corp                 | 610.005     |
| 5.491   | Aflac Inc                  | 604.082     |
| 1.577   | Caterpillar Inc            | 603.687     |

## High Yield Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

| Anteile    | Wertpapierbezeichnung                               | Kosten US\$ |
|------------|---|-------------|
| 21.565.000 | Medline Borrower LP, 5.25%, 01/10/2029              | 20.304.846  |
| 12.710.000 | CSC Holdings LLC, 11.75%, 31/01/2029                | 12.508.950  |
| 12.205.000 | Alpha Generation LLC, 6.75%, 15/10/2032             | 12.294.244  |
| 11.810.000 | Block Inc, 6.50%, 15/05/2032                        | 11.853.309  |
| 9.765.000  | UKG Inc, 6.88%, 01/02/2031                          | 9.781.350   |
| 9.539.000  | Lightning Power LLC, 7.25%, 15/08/2032              | 9.662.750   |
| 10.160.000 | Cloud Software Group Inc, 6.50%, 31/03/2029         | 9.654.081   |
| 9.380.000  | United Rentals North America Inc, 6.13%, 15/03/2034 | 9.375.331   |
| 9.076.000  | Cotiviti Inc, 0.08%, 01/05/2031                     | 9.076.000   |
| 8.460.000  | Windstream Services LLC, 8.25%, 01/10/2031          | 8.630.132   |
| 9.241.000  | Level 3 Financing Inc, 4.88%, 15/06/2029            | 8.628.483   |
| 9.615.000  | Zayo Group Holdings Inc, 4.00%, 01/03/2027          | 8.530.725   |
| 8.290.000  | Vistra Operations Co LLC, 6.88%, 15/04/2032         | 8.290.000   |
| 8.180.000  | Post Holdings Inc, 6.38%, 01/03/2033                | 8.180.000   |
| 8.065.000  | Surgery Center Holdings Inc, 7.25%, 15/04/2032      | 8.109.063   |
| 8.050.000  | Fortress Intermediate 3 Inc, 7.50%, 01/06/2031      | 8.103.063   |
| 8.060.000  | Standard Building Solutions Inc, 6.50%, 15/08/2032  | 8.101.000   |
| 8.100.000  | Allied Universal Holdco LLC, 7.88%, 15/02/2031      | 8.094.475   |
| 7.970.000  | Crescent Energy Finance LLC, 7.38%, 15/01/2033      | 8.008.913   |
| 7.725.000  | Wand NewCo 3 Inc, 7.63%, 30/01/2032                 | 7.812.588   |

## High Yield Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

| Anteile    | Wertpapierbezeichnung  | Erlöse US\$ |
|------------|--|-------------|
| 35.890.000 | United States Treasury Bill, 5.00%, 31/08/2025   | 36.179.840  |
| 18.650.000 | New Fortress Energy Inc, 6.50%, 30/09/2026   | 17.807.377  |
| 14.575.000 | Parexel International Inc, 0.12%, 15/11/2029   | 14.575.000  |
| 12.655.000 | American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 5.75%, 20/04/2029                     | 12.359.013  |
| 10.735.000 | Civitas Resources Inc, 8.63%, 01/11/2030   | 11.490.151  |
| 10.622.000 | EquipmentShare.com Inc, 9.00%, 15/05/2028  | 10.908.099  |
| 10.850.000 | Pactiv Evergreen Group Issuer LLC/Pactiv Evergreen Group Issuer Inc, 4.38%, 15/10/2028 | 10.469.022  |
| 10.323.333 | American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 5.50%, 20/04/2026                     | 10.222.943  |
| 10.445.000 | Medline Borrower LP, 5.25%, 01/10/2029   | 9.958.820   |
| 9.980.000  | Energizer Holdings Inc, 6.50%, 31/12/2027  | 9.897.700   |
| 9.076.000  | Cotiviti Inc, 0.08%, 01/05/2031  | 9.020.985   |
| 8.990.000  | Camelot Return Merger Sub Inc, 8.75%, 01/08/2028                                       | 8.912.810   |
| 8.185.000  | Carnival Holdings Bermuda Ltd, 10.38%, 01/05/2028                                      | 8.866.441   |
| 8.380.000  | Royal Caribbean Cruises Ltd, 5.50%, 01/04/2028   | 8.284.893   |
| 9.220.000  | TreeHouse Foods Inc, 4.00%, 01/09/2028   | 8.243.353   |
| 7.619.000  | Calderys Financing LLC, 11.25%, 01/06/2028   | 8.045.288   |
| 8.655.000  | Ziff Davis Inc, 4.63%, 15/10/2030  | 7.947.894   |
| 7.380.000  | Benteler International AG, 10.50%, 15/05/2028  | 7.900.709   |
| 14.630.000 | CSC Holdings LLC, 5.75%, 15/01/2030  | 7.764.629   |
| 7.735.000  | Royal Caribbean Cruises Ltd, 6.25%, 15/03/2032   | 7.764.006   |

## InnovAsia – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung                       | Kosten US\$ |
|---------|---|-------------|
| 17.900  | Towa Corp                                   | 1.000.188   |
| 77.300  | Appier Group Inc                            | 796.474     |
| 21.000  | MediaTek Inc                                | 792.522     |
| 27.900  | Taiyo Yuden Co Ltd                          | 699.257     |
| 27.330  | TechWing Inc                                | 696.045     |
| 2.800   | Maruwa Co Ltd                               | 688.703     |
| 14.000  | Global Unichip Corp                         | 684.064     |
| 11.000  | ASMedia Technology Inc                      | 679.343     |
| 34.000  | Phison Electronics Corp                     | 672.159     |
| 41.100  | SUMCO Corp                                  | 660.029     |
| 76.000  | Chroma ATE Inc                              | 648.395     |
| 19.400  | Micronics Japan Co Ltd                      | 631.733     |
| 21.400  | Kokusai Electric Corp                       | 624.035     |
| 48.000  | Silergy Corpp                               | 621.403     |
| 3.939   | LEENO Industrial Inc                        | 619.429     |
| 11.300  | SoftBank Group Corp                         | 599.592     |
| 48.800  | ASMPT Ltd                                   | 593.002     |
| 25.000  | AURAS Technology Co Ltd                     | 576.540     |
| 7.100   | Horiba Ltd                                  | 567.284     |
| 15.000  | Nitto Boseki Co Ltd                         | 557.982     |
| 32.000  | Accton Technology Corp                      | 527.834     |
| 65.000  | Fitipower Integrated Technology Inc         | 519.929     |
| 29.700  | MISUMI Group Inc                            | 519.452     |
| 984.000 | Innolux Corp                                | 509.016     |
| 10.500  | Shibaura Mechatronics Corp                  | 496.518     |
| 2.718   | HD Hyundai Electric Co Ltd                  | 489.842     |
| 12.000  | Lotes Co Ltd                                | 484.531     |
| 2.450   | LG Innotek Co Ltd                           | 477.336     |
| 15.100  | Socionext Inc                               | 464.791     |
| 115.800 | Shenzhen Envicool Technology Co Ltd Class A | 451.570     |
| 15.400  | Tokyo Ohka Kogyo Co Ltd                     | 430.921     |
| 27.600  | Rohm Co Ltd                                 | 416.222     |
| 2.885   | EO Technics Co Ltd                          | 414.387     |
| 10.000  | M31 Technology Corp                         | 398.824     |
| 6.938   | PSK Holdings Inc                            | 379.813     |

## InnovAsia – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung                     | Erlöse US\$ |
|---------|---|-------------|
| 33.000  | Jentech Precision Industrial Co Ltd       | 984.531     |
| 34.500  | Towa Corp                                 | 940.096     |
| 7.172   | SK Hynix Inc                              | 939.415     |
| 62.000  | Rohm Co Ltd                               | 919.978     |
| 11.343  | Hanmi Semiconductor Co Ltd                | 919.348     |
| 5.146   | LEENO Industrial Inc                      | 830.695     |
| 4.273   | Fabrinet                                  | 830.542     |
| 31.000  | Harmonic Drive Systems Inc                | 787.759     |
| 50.000  | Accton Technology Corp                    | 784.714     |
| 325.790 | Zomato Ltd                                | 773.979     |
| 21.000  | MediaTek Inc                              | 772.376     |
| 11.300  | SoftBank Group Corp                       | 737.682     |
| 58.600  | Sansan Inc                                | 734.828     |
| 1.400   | SMC Corp                                  | 721.042     |
| 73.500  | Appier Group Inc                          | 720.506     |
| 17.400  | Nitto Boseki Co Ltd                       | 700.174     |
| 15.000  | Global Unichip Corp                       | 697.154     |
| 16.785  | TechWing Inc                              | 690.579     |
| 42.000  | Novatek Microelectronics Corp             | 678.394     |
| 48.000  | Silergy Corp                              | 644.897     |
| 19.400  | Micronics Japan Co Ltd                    | 635.063     |
| 34.000  | Phison Electronics Corp                   | 629.856     |
| 41.100  | SUMCO Corp                                | 622.966     |
| 76.000  | Chroma ATE Inc                            | 619.623     |
| 11.000  | ASMedia Technology Inc                    | 615.596     |
| 25.000  | Auras Technology Co Ltd                   | 613.000     |
| 18.328  | HPSP Co Ltd                               | 604.620     |
| 12.800  | Shibaura Mechatronics Corp                | 597.468     |
| 36.804  | Bharti Airtel Ltd                         | 583.978     |
| 12.000  | Lotes Co Ltd                              | 581.773     |
| 7.000   | eMemory Technology Inc                    | 571.751     |
| 48.800  | ASMPT Ltd                                 | 556.409     |
| 146.000 | Wistron Corp                              | 548.169     |
| 34.793  | Tech Mahindra Ltd                         | 540.400     |
| 21.400  | Kokusai Electric Corp                     | 537.939     |
| 19.000  | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd | 537.270     |
| 38.300  | Mercari Inc                               | 533.385     |
| 27.900  | Taiyo Yuden Co Ltd                        | 532.295     |
| 126.073 | Shenzhen Sinexcel Electric Co Ltd Class A | 528.209     |
| 29.700  | MISUMI Group Inc                          | 521.995     |
| 65.000  | Fitipower Integrated Technology Inc       | 504.858     |
| 10.000  | M31 Technology Corp                       | 500.529     |
| 10.200  | Enplas Corp                               | 489.214     |
| 56.000  | E Ink Holdings Inc                        | 481.063     |

## Japan Equity Engagement – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung            | Kosten JPY  |
|---------|----------------------------------|-------------|
| 278.000 | Mitsubishi Logistics Corp        | 796.775.662 |
| 242.600 | Shofu Inc                        | 748.558.455 |
| 153.700 | Sinfonia Technology Co Ltd       | 744.735.544 |
| 155.000 | Sanwa Holdings Corp              | 678.330.451 |
| 220.000 | Kinden Corp                      | 670.543.312 |
| 120.000 | Niterra Co Ltd                   | 540.255.056 |
| 160.000 | Dai-Dan Co Ltd                   | 527.088.461 |
| 160.000 | Resorttrust Inc                  | 459.966.134 |
| 102.200 | Okinawa Cellular Telephone Co    | 434.262.541 |
| 250.000 | Trial Holdings Inc               | 425.000.000 |
| 250.000 | Itoki Corp                       | 424.750.721 |
| 383.000 | EUCALIA Inc                      | 405.980.000 |
| 220.000 | Lion Corp                        | 405.231.376 |
| 90.000  | baudroie inc                     | 400.979.555 |
| 117.000 | Yamazaki Baking Co Ltd           | 391.632.727 |
| 390.000 | Tokyu Fudosan Holdings Corp      | 385.753.960 |
| 161.000 | Mitsubishi Pencil Co Ltd         | 381.966.498 |
| 125.200 | Daiei Kankyo Co Ltd              | 367.012.581 |
| 176.200 | Transaction Co Ltd               | 349.135.781 |
| 66.000  | Lifedrink Co Inc                 | 346.307.803 |
| 231.000 | USS Co Ltd                       | 324.124.185 |
| 114.000 | SBI Sumishin Net Bank Ltd        | 303.080.573 |
| 100.000 | San-A Co Ltd                     | 289.610.279 |
| 240.000 | Shimizu Corp                     | 287.847.603 |
| 63.000  | Juroku Financial Group Inc       | 286.021.869 |
| 91.000  | Internet Initiative Japan Inc    | 273.682.067 |
| 47.000  | Micronics Japan Co Ltd           | 260.128.295 |
| 100.000 | Premium Group Co Ltd             | 258.312.128 |
| 141.700 | Yamanashi Chuo Bank Ltd          | 257.443.284 |
| 246.000 | Hachijuni Bank Ltd               | 250.209.821 |
| 434.400 | Kosaido Holdings Co Ltd          | 229.464.645 |
| 55.000  | Tsumura & Co                     | 222.282.028 |
| 58.000  | Life Corp                        | 220.873.029 |
| 53.000  | Tokyo Ohka Kogyo Co Ltd          | 219.627.612 |
| 50.000  | Zuken Inc                        | 210.704.933 |
| 152.300 | Mamezo Digital Holdings Co Ltd   | 200.421.661 |
| 115.000 | Midac Holdings Co Ltd            | 198.645.303 |
| 90.000  | Musashi Seimitsu Industry Co Ltd | 193.286.044 |
| 64.000  | Asics Corp                       | 187.920.693 |
| 113.000 | Amada Co Ltd                     | 182.100.762 |

## Japan Equity Engagement – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung               | Erlöse JPY    |
|---------|-------------------------------------|---------------|
| 177.000 | FP Partner Inc                      | 1.049.579.152 |
| 250.000 | Trial Holdings Inc                  | 591.842.925   |
| 262.200 | Ricoh Co Ltd                        | 338.366.133   |
| 145.000 | Kansai Paint Co Ltd                 | 323.850.600   |
| 213.000 | Amada Co Ltd                        | 322.815.236   |
| 65.000  | Hokkoku Financial Holdings Inc      | 318.301.401   |
| 47.000  | Micronics Japan Co Ltd              | 311.529.383   |
| 115.000 | Genda Inc                           | 277.413.567   |
| 75.000  | Nifco Inc                           | 277.075.543   |
| 100.000 | Mitsubishi Pencil Co Ltd            | 248.440.139   |
| 60.000  | Asics Corp                          | 248.159.671   |
| 56.400  | Juroku Financial Group Inc          | 244.110.530   |
| 23.000  | Tokyo Seimitsu Co Ltd               | 223.252.688   |
| 210.000 | Tokyu Fudosan Holdings Corp         | 222.049.008   |
| 120.000 | Mitsubishi Logistics Corp           | 221.648.230   |
| 56.000  | Lifedrink Co Inc                    | 220.843.235   |
| 52.200  | Okinawa Cellular Telephone Co       | 216.895.934   |
| 21.000  | Lawson Inc                          | 215.880.000   |
| 53.000  | MEC Co Ltd                          | 214.052.971   |
| 33.700  | Sinfonia Technology Co Ltd          | 198.039.447   |
| 53.000  | Tokyo Ohka Kogyo Co Ltd             | 189.310.104   |
| 44.000  | Osaka Soda Co Ltd                   | 187.983.435   |
| 31.000  | M&A Research Institute Holdings Inc | 180.062.408   |
| 93.000  | Menicon Co Ltd                      | 179.591.965   |
| 183.000 | EUCALIA Inc                         | 177.980.115   |
| 70.000  | MISUMI Group Inc                    | 176.671.756   |
| 71.100  | Sakai Moving Service Co Ltd         | 175.466.904   |
| 138.800 | Mamezo Digital Holdings Co Ltd      | 175.250.453   |
| 42.000  | Pilot Corp                          | 172.263.251   |
| 25.000  | Macnica Holdings Inc                | 171.998.100   |
| 80.000  | Shoei Co Ltd                        | 170.135.916   |
| 30.000  | Takasago Thermal Engineering Co Ltd | 160.133.683   |
| 53.200  | Daiei Kankyo Co Ltd                 | 159.782.782   |
| 56.000  | Pasona Group Inc                    | 159.079.076   |
| 105.000 | Tokyo Century Corp                  | 159.016.166   |
| 78.000  | Open Up Group Inc                   | 148.619.101   |
| 40.000  | Musashi Seimitsu Industry Co Ltd    | 147.456.406   |
| 50.300  | JSB Co Ltd                          | 145.849.475   |
| 61.200  | Transaction Co Ltd                  | 143.929.655   |
| 29.000  | San-A Co Ltd                        | 132.344.923   |
| 89.500  | Yamaha Corp                         | 126.641.068   |
| 36.000  | Zuken Inc                           | 126.437.929   |
| 80.000  | Daiwa Industries Ltd                | 123.534.162   |

## Macro Opportunities FX – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Es gab keine Käufe im Berichtszeitraum.

Verkäufe insgesamt:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung                                  | Erlöse EUR |
|---------|--|------------|
| 650.000 | Finland T-Bill, 0.00%, 14/05/2024                      | 642.176    |
| 550.000 | France Treasury Bill BTF, 0.00%, 12/06/2024            | 541.869    |
| 490.000 | German Treasury Bill, 0.00%, 19/06/2024                | 482.552    |
| 450.000 | German Treasury Bill, 0.00%, 17/04/2024                | 445.992    |
| 350.000 | French Republic Government Bond OAT, 0.00%, 25/03/2024 | 347.735    |
| 300.000 | Finland T-Bill, 0.00%, 13/03/2024                      | 298.429    |

## Next Generation Connectivity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                | Kosten US\$ |
|-----------|--------------------------------------|-------------|
| 1.067.000 | MediaTek Inc                         | 39.520.749  |
| 1.128.500 | Fujikura Ltd                         | 39.464.664  |
| 973.400   | Advantest Corp                       | 35.397.867  |
| 302.256   | ARM Holdings Plc ADR                 | 33.666.488  |
| 3.299.000 | Quanta Computer Inc                  | 32.558.210  |
| 94.119    | Arista Networks Inc                  | 31.539.135  |
| 7.020.000 | Hon Hai Precision Industry Co Ltd    | 31.220.604  |
| 844.720   | Flex Ltd                             | 29.645.579  |
| 470.587   | Vertiv Holdings Co Class A           | 28.721.861  |
| 1.366.500 | Murata Manufacturing Co Ltd          | 28.158.253  |
| 99.000    | Disco Corp                           | 27.449.165  |
| 580.651   | DraftKings Inc Class A               | 24.675.860  |
| 1.473.600 | SUMCO Corp                           | 23.501.768  |
| 149.265   | Take-Two Interactive Software Inc    | 23.471.220  |
| 197.857   | Amphenol Corp Class A                | 23.276.805  |
| 328.998   | Western Digital Corp                 | 20.624.487  |
| 94.763    | Snowflake Inc Class A                | 19.118.062  |
| 262.740   | Coherent Corp                        | 18.380.310  |
| 168.281   | DoorDash Inc Class A                 | 18.199.160  |
| 143.601   | Datadog Inc Class A                  | 17.935.164  |
| 318.000   | Global Unichip Corp                  | 17.693.041  |
| 172.100   | Micron Technology Inc                | 17.249.778  |
| 89.060    | International Business Machines Corp | 17.199.835  |
| 216.672   | Zillow Group Inc Class C             | 17.007.802  |
| 124.131   | SK Hynix Inc                         | 16.992.583  |
| 295.067   | Nutanix Inc Class A                  | 16.713.990  |
| 986.800   | Renesas Electronics Corp             | 16.618.061  |
| 105.257   | GoDaddy Inc Class A                  | 16.561.235  |
| 58.893    | Monday.com Ltd                       | 16.482.236  |
| 6.594.400 | Xiaomi Corp Class B                  | 16.473.967  |
| 24.878    | Netflix Inc                          | 15.955.789  |
| 60.628    | CrowdStrike Holdings Inc Class A     | 15.838.701  |
| 122.517   | Dell Technologies Inc Class C        | 15.732.861  |
| 410.416   | Infineon Technologies AG             | 15.304.850  |
| 147.198   | Marvell Technology Inc               | 15.229.356  |
| 92.225    | QUALCOMM Inc                         | 14.590.926  |
| 8.937     | Adyen NV                             | 13.904.004  |
| 37.476    | Corpay Inc                           | 13.212.600  |
| 663.000   | Asia Vital Components Co Ltd         | 12.759.208  |
| 49.500    | Tokyo Electron Ltd                   | 12.553.062  |
| 156.967   | CVS Health Corp                      | 11.971.084  |
| 662.500   | Mitsubishi Electric Corp             | 11.857.385  |

## Next Generation Connectivity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                     | Erlöse US\$ |
|-----------|---|-------------|
| 399.000   | Alchip Technologies Ltd                   | 48.488.444  |
| 99.153    | Super Micro Computer Inc                  | 48.100.064  |
| 132.696   | NVIDIA Corp                               | 46.418.902  |
| 866.500   | Advantest Corp                            | 44.623.235  |
| 309.238   | ARM Holdings Plc ADR                      | 44.115.791  |
| 470.587   | Vertiv Holdings Co Class A                | 42.795.102  |
| 1.001.000 | MediaTek Inc                              | 38.151.903  |
| 2.395.900 | Renesas Electronics Corp                  | 38.074.252  |
| 270.185   | Oracle Corp                               | 32.109.222  |
| 46.118    | HubSpot Inc                               | 30.387.951  |
| 177.894   | Advanced Micro Devices Inc                | 29.647.617  |
| 98.702    | Arista Networks Inc                       | 29.243.480  |
| 33.485    | ServiceNow Inc                            | 26.732.534  |
| 1.366.500 | Murata Manufacturing Co Ltd               | 24.509.218  |
| 4.129.000 | Hon Hai Precision Industry Co Ltd         | 24.048.448  |
| 337.087   | Celestica Inc                             | 23.343.163  |
| 1.473.600 | SUMCO Corp                                | 23.296.912  |
| 441.600   | TDK Corp                                  | 23.221.171  |
| 615.300   | Juniper Networks Inc                      | 22.960.150  |
| 105.999   | Atlassian Corp Class A                    | 22.195.594  |
| 65.808    | Broadcom Inc                              | 22.100.479  |
| 192.175   | Dexcom Inc                                | 21.858.721  |
| 46.700    | Keyence Corp                              | 20.601.854  |
| 135.591   | BE Semiconductor Industries NV            | 20.583.143  |
| 66.353    | CrowdStrike Holdings Inc Class A          | 20.343.440  |
| 168.281   | DoorDash Inc Class A                      | 20.076.965  |
| 580.651   | DraftKings Inc Class A                    | 19.194.224  |
| 6.594.400 | Xiaomi Corp Class B                       | 18.426.731  |
| 295.067   | Nutanix Inc Class A                       | 18.323.717  |
| 39.214    | Meta Platforms Inc Class A                | 17.948.668  |
| 595.000   | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd | 17.585.570  |
| 41.939    | Microsoft Corp                            | 17.522.223  |
| 60.302    | Workday Inc Class A                       | 16.403.169  |
| 94.763    | Snowflake Inc Class A                     | 16.350.898  |
| 92.494    | T-Mobile US Inc                           | 16.235.307  |
| 177.118   | Coherent Corp                             | 15.957.600  |
| 523.937   | Flex Ltd                                  | 15.594.715  |
| 387.433   | Pure Storage Inc Class A                  | 15.451.632  |
| 960.000   | Novatek Microelectronics Corp             | 15.394.595  |
| 51.924    | Salesforce Inc                            | 15.078.476  |
| 433.092   | Infineon Technologies AG                  | 14.596.164  |

## Next Generation Mobility – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung                          | Kosten US\$ |
|---------|--|-------------|
| 95.908  | Kia Corp                                       | 8.350.193   |
| 14.027  | Ferrari NV                                     | 6.092.837   |
| 161.127 | Infineon Technologies AG                       | 5.720.651   |
| 42.592  | L&F Co Ltd                                     | 5.372.277   |
| 48.127  | Hanmi Semiconductor Co Ltd                     | 5.279.250   |
| 75.600  | Hitachi Ltd                                    | 4.953.310   |
| 50.564  | MakeMyTrip Ltd                                 | 4.648.348   |
| 167.500 | Contemporary Amperex Technology Co Ltd Class A | 4.605.136   |
| 16.558  | Samsung SDI Co Ltd                             | 4.586.557   |
| 34.239  | Albemarle Corp                                 | 4.177.089   |
| 50.233  | ON Semiconductor Corp                          | 3.604.402   |
| 11.407  | Eaton Corp Plc                                 | 3.506.474   |
| 47.296  | nVent Electric Plc                             | 3.467.115   |
| 117.500 | BYD Co Ltd - H Shares                          | 3.420.340   |
| 118.986 | Stellantis NV                                  | 3.362.959   |
| 28.030  | Autoliv Inc                                    | 3.329.415   |
| 5.739   | Synopsys Inc                                   | 3.154.145   |
| 14.107  | Onto Innovation Inc                            | 3.020.562   |
| 11.316  | HEICO Corp                                     | 2.954.176   |
| 7.921   | Zebra Technologies Corp Class A                | 2.941.904   |
| 58.524  | Bentley Systems Inc Class B                    | 2.937.146   |
| 17.447  | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR  | 2.845.761   |
| 56.722  | ABB Ltd  | 2.691.723   |
| 37.524  | Samsung Electronics Co Ltd                     | 2.382.455   |
| 15.748  | HD Hyundai Heavy Industries Co Ltd             | 2.282.002   |
| 131.000 | Silergy Corp                                   | 2.171.319   |
| 287.500 | Samsung Heavy Industries Co Ltd                | 2.144.476   |
| 9.622   | Applied Materials Inc                          | 1.965.758   |
| 2.051   | ASML Holding NV                                | 1.820.472   |
| 5.821   | NXP Semiconductors NV                          | 1.528.048   |
| 3.112   | Linde Plc                                      | 1.366.018   |
| 10.014  | Teradyne Inc                                   | 1.284.772   |

## Next Generation Mobility – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung          | Erlöse US\$ |
|---------|--------------------------------|-------------|
| 39.110  | NVIDIA Corp                    | 7.494.262   |
| 17.447  | Caterpillar Inc                | 6.347.508   |
| 25.576  | Analog Devices Inc             | 5.698.078   |
| 62.471  | Amphenol Corp Class A          | 5.350.033   |
| 87.838  | Trimble Inc                    | 4.958.791   |
| 11.045  | Linde Plc                      | 4.957.646   |
| 12.473  | ANSYS Inc                      | 4.189.553   |
| 23.384  | T-Mobile US Inc                | 3.768.330   |
| 9.101   | Deere & Co                     | 3.624.952   |
| 76.790  | General Motors Co              | 3.613.116   |
| 37.784  | L&F Co Ltd                     | 3.578.147   |
| 12.218  | Cadence Design Systems Inc     | 3.524.018   |
| 54.953  | Rambus Inc                     | 3.384.056   |
| 40.280  | Lam Research Corp              | 3.342.015   |
| 96.731  | Gentex Corp                    | 3.237.568   |
| 22.301  | TE Connectivity Plc            | 3.223.178   |
| 19.825  | BE Semiconductor Industries NV | 3.003.817   |
| 11.752  | Autodesk Inc                   | 2.894.797   |
| 54.855  | Lattice Semiconductor Corp     | 2.876.772   |
| 13.977  | Texas Instruments Inc          | 2.836.052   |
| 12.003  | Schneider Electric SE          | 2.819.945   |
| 3.117   | Monolithic Power Systems Inc   | 2.802.595   |
| 17.834  | Advanced Micro Devices Inc     | 2.711.284   |
| 11.293  | NXP Semiconductors NV          | 2.706.486   |
| 28.030  | Autoliv Inc                    | 2.663.359   |
| 179.594 | MP Materials Corp              | 2.638.819   |
| 14.159  | Tesla Inc                      | 2.488.328   |
| 28.878  | Altair Engineering Inc Class A | 2.421.007   |
| 13.679  | Amazon.com Inc                 | 2.349.960   |
| 32.901  | Aptiv Plc                      | 2.288.559   |
| 31.915  | Uber Technologies Inc          | 2.267.927   |
| 18.393  | Keysight Technologies Inc      | 2.266.852   |
| 10.391  | Samsung SDI Co Ltd             | 2.180.479   |
| 51.000  | MediaTek Inc                   | 2.011.279   |
| 118.986 | Stellantis NV                  | 2.002.361   |
| 102.297 | Epiroc AB Class A              | 1.975.444   |
| 108.542 | Murata Manufacturing Co Ltd    | 1.966.065   |
| 37.524  | Samsung Electronics Co Ltd     | 1.955.089   |
| 7.640   | Air Products and Chemicals Inc | 1.868.057   |
| 1.813   | ASML Holding NV                | 1.649.426   |
| 12.151  | Prologis Inc                   | 1.621.064   |

## Next Generation Space Economy – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung                  | Kosten US\$ |
|---------|--|-------------|
| 82.851  | AST SpaceMobile Inc Class A            | 1.841.654   |
| 19.269  | Amphenol Corp Class A                  | 1.673.730   |
| 83.289  | BAE Systems Plc                        | 1.406.803   |
| 3.044   | Linde Plc                              | 1.362.347   |
| 7.081   | AeroVironment Inc                      | 1.331.299   |
| 7.803   | Airbus SE                              | 1.231.338   |
| 208.200 | SKY Perfect JSAT Holdings Inc          | 1.210.498   |
| 6.857   | Boeing Co                              | 1.172.510   |
| 38.058  | Intellian Technologies Inc             | 1.157.880   |
| 154.000 | Astroscale Holdings Inc                | 1.154.275   |
| 6.521   | QUALCOMM Inc                           | 1.028.534   |
| 6.790   | Keysight Technologies Inc              | 1.013.045   |
| 2.105   | Northrop Grumman Corp                  | 992.411     |
| 2.397   | Motorola Solutions Inc                 | 952.119     |
| 2.200   | Microsoft Corp                         | 949.803     |
| 4.565   | Analog Devices Inc                     | 939.142     |
| 276.100 | Singapore Technologies Engineering Ltd | 907.687     |
| 1.916   | Teledyne Technologies Inc              | 862.938     |
| 12.462  | Uber Technologies Inc                  | 830.843     |
| 1.024   | ASML Holding NV                        | 809.598     |
| 218.592 | Eutelsat Communications SACA           | 799.045     |
| 3.563   | Safran SA                              | 794.442     |
| 5.144   | Thales SA                              | 789.531     |
| 57.165  | MDA Space Ltd                          | 775.859     |
| 1.784   | CACI International Inc Class A         | 746.346     |
| 43.800  | Mitsubishi Electric Corp               | 731.781     |
| 3.828   | Amazon.com Inc                         | 729.334     |
| 2.545   | Palo Alto Networks Inc                 | 724.261     |
| 159.481 | Rocket Lab USA Inc                     | 689.063     |
| 518     | TransDigm Group Inc                    | 659.175     |
| 60.459  | Intuitive Machines Inc Class A         | 633.326     |
| 16.416  | AXA SA                                 | 580.395     |
| 1.269   | Deere & Co                             | 520.189     |
| 33.700  | Mitsubishi Heavy Industries Ltd        | 499.753     |
| 98.600  | Toray Industries Inc                   | 474.546     |
| 7.317   | Trimble Inc                            | 471.053     |
| 3.013   | Advanced Micro Devices Inc             | 463.786     |
| 5.800   | NEC Corp                               | 457.055     |
| 45.299  | Redwire Corp                           | 437.602     |
| 2.436   | NVIDIA Corp                            | 432.675     |
| 37.887  | MDA Ltd                                | 418.768     |
| 1.460   | Cadence Design Systems Inc             | 413.561     |

## Next Generation Space Economy – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung                            | Erlöse US\$ |
|---------|--|-------------|
| 152.842 | Rocket Lab USA Inc                               | 1.866.433   |
| 4.032   | Hanwha Aerospace Co Ltd                          | 812.234     |
| 134.900 | Toray Industries Inc                             | 695.138     |
| 7.922   | Hexcel Corp                                      | 497.018     |
| 204.682 | Spirent Communications Plc                       | 458.155     |
| 48.000  | Universal Microwave Technology Inc               | 448.000     |
| 462     | NVIDIA Corp                                      | 407.612     |
| 937     | Lockheed Martin Corp                             | 406.521     |
| 2.319   | Boeing Co  | 401.362     |
| 99.460  | Shanghai Huace Navigation Technology Ltd Class A | 372.340     |
| 1.067   | ANSYS Inc  | 365.629     |
| 11.104  | Iridium Communications Inc                       | 327.677     |
| 2.356   | Okta Inc Class A                                 | 219.899     |
| 810     | CrowdStrike Holdings Inc Class A                 | 206.361     |
| 21.801  | Intuitive Machines Inc Class A                   | 206.049     |
| 471     | Teledyne Technologies Inc                        | 173.301     |
| 485     | Palo Alto Networks Inc                           | 166.407     |
| 12.300  | Mitsubishi Heavy Industries Ltd                  | 151.246     |
| 4.665   | AST SpaceMobile Inc Class A                      | 145.627     |
| 383     | Deere & Co                                       | 134.138     |
| 25.200  | ispace Inc                                       | 117.966     |
| 379     | Cadence Design Systems Inc                       | 102.309     |
| 734     | Jacobs Solutions Inc                             | 96.884      |
| 439     | Safran SA  | 93.241      |

## Short Duration Emerging Market Debt – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile    | Wertpapierbezeichnung   | Kosten US\$ |
|------------|---|-------------|
| 90.626.000 | Panama Government International Bond, 7.50%, 01/03/2031                   | 97.996.304  |
| 68.600.000 | Ivory Coast Government International Bond, 5.88%, 17/10/2031              | 67.508.602  |
| 66.714.000 | Petroleos Mexicanos, 6.70%, 16/02/2032                                    | 60.173.205  |
| 43.900.000 | Panama Government International Bond, 9.38%, 01/04/2029                   | 49.430.500  |
| 48.200.000 | United States Treasury Note/Bond, 4.63%, 30/04/2029                       | 48.558.629  |
| 44.942.000 | YPF SA, 9.50%, 17/01/2031   | 44.529.882  |
| 49.500.000 | Serbia International Bond, 2.13%, 01/12/2030                              | 41.471.100  |
| 34.460.000 | El Sukuk Co Ltd, 5.43%, 28/05/2029  | 34.480.000  |
| 31.484.000 | Abu Dhabi Developmental Holding Co PJSC, 5.38%, 08/05/2029                | 31.694.698  |
| 28.900.000 | Romanian Government International Bond, 5.88%, 30/01/2029                 | 28.873.250  |
| 26.600.000 | Gulf International Bank BSC, 5.75%, 05/06/2029                            | 26.424.512  |
| 20.000.000 | Romanian Government International Bond, 5.50%, 18/09/2028                 | 22.004.717  |
| 22.042.000 | Abu Dhabi Government International Bond, 4.88%, 30/04/2029                | 21.954.052  |
| 21.520.000 | Arab Petroleum Investments Corp, 5.43%, 02/05/2029                        | 21.520.000  |
| 21.156.000 | SUCI Second Investment Co, 4.38%, 10/09/2027                              | 21.089.570  |
| 19.700.000 | Republic of South Africa Government International Bond, 5.88%, 22/06/2030 | 19.178.140  |
| 17.600.000 | Turkiye Government International Bond, 9.38%, 14/03/2029                  | 18.986.000  |
| 18.600.000 | ICA Ictas Altyapi Yavuz Sultan Selim Koprusu, 7.54%, 31/10/2027           | 18.693.000  |
| 18.175.000 | Commercial Bank of Dubai PSC, 4.86%, 10/10/2029                           | 18.147.000  |
| 18.507.000 | Nigeria Government International Bond, 8.38%, 24/03/2029                  | 17.780.020  |
| 16.856.000 | First Abu Dhabi Bank PJSC, 5.00%, 28/02/2029                              | 16.731.097  |
| 17.467.000 | El Salvador Government International Bond, 9.25%, 17/04/2030              | 16.378.316  |

## Short Duration Emerging Market Debt – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile    | Wertpapierbezeichnung  | Erlöse US\$ |
|------------|--|-------------|
| 88.646.000 | Serbia International Bond, 3.13%, 15/05/2027                 | 91.980.278  |
| 67.662.000 | Colombia Government International Bond, 3.88%, 25/04/2027    | 64.908.520  |
| 48.500.000 | Romanian Government International Bond, 5.50%, 18/09/2028    | 54.874.296  |
| 425.000    | Neuberger Berman Short Duration Euro Bond Fund               | 50.628.196  |
| 42.400.000 | Serbia International Bond, 1.00%, 23/09/2028                 | 40.963.806  |
| 30.930.000 | Romanian Government International Bond, 2.88%, 26/05/2028    | 33.017.728  |
| 30.986.000 | Saudi Arabian Oil Co, 2.88%, 16/04/2024                      | 30.752.105  |
| 36.381.000 | Sri Lanka Government International Bond, 5.75%, 18/04/2049   | 23.313.418  |
| 21.984.000 | Airport Authority, 1.75%, 12/01/2027                         | 20.309.918  |
| 20.500.000 | MDGH GMTN RSC Ltd, 2.50%, 07/11/2024                         | 20.264.250  |
| 17.600.000 | Turkiye Government International Bond, 9.38%, 14/03/2029     | 19.686.460  |
| 27.037.000 | Sri Lanka Government International Bond, 6.85%, 14/03/2024   | 17.241.889  |
| 17.582.801 | Ivory Coast Government International Bond, 5.75%, 31/12/2032 | 17.077.295  |
| 14.625.000 | REC Ltd, 3.50%, 12/12/2024                                   | 14.555.531  |
| 14.700.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 23/05/2024               | 14.461.494  |
| 21.600.000 | Sri Lanka Government International Bond, 6.35%, 28/06/2024   | 13.857.965  |
| 13.800.000 | Korea National Oil Corp, 1.75%, 18/04/2025                   | 13.381.574  |
| 25.934.000 | Ghana Government International Bond, 10.75%, 14/10/2030      | 13.111.205  |
| 15.000.000 | Serbia International Bond, 2.13%, 01/12/2030                 | 12.515.500  |
| 12.000.000 | Ivory Coast Government International Bond, 6.38%, 03/03/2028 | 11.988.050  |
| 12.000.000 | Corp Andina de Fomento, 1.25%, 26/10/2024                    | 11.863.760  |
| 12.000.000 | Mongolia Government International Bond, 5.13%, 07/04/2026    | 11.680.000  |
| 11.435.000 | Istanbul Metropolitan Municipality, 6.38%, 09/12/2025        | 11.423.565  |

## Short Duration Euro Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

| Anteile    | Wertpapierbezeichnung   | Kosten EUR |
|------------|---|------------|
| 32.000.000 | Enel SpA, 3.50%, 31/12/2149   | 32.008.100 |
| 25.000.000 | Westpac Banking Corp, 3.46%, 04/04/2025                             | 25.040.200 |
| 21.000.000 | Luminor Bank AS, 7.75%, 08/06/2027                                  | 22.382.400 |
| 19.000.000 | Nationwide Building Society, 2.00%, 25/07/2029                      | 18.844.500 |
| 18.500.000 | Shamrock Residential DAC Series 2024-1X Class A, 3.99% , 24/12/2078 | 18.457.450 |
| 1.810.000  | Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund                     | 18.334.250 |
| 16.400.000 | Crelan SA, 6.00%, 28/02/2030  | 17.566.650 |
| 18.000.000 | Santander UK Group Holdings Plc, 0.60%, 13/09/2029                  | 16.303.600 |
| 16.300.000 | Iberdrola International BV, 3.25%, 31/12/2149                       | 16.295.110 |
| 15.440.000 | Permanent TSB Group Holdings Plc, 3.00%, 19/08/2031                 | 15.013.440 |
| 14.850.000 | Domi BV Series 2024-1 Class A, 3.57%, 15/06/2056                    | 14.859.000 |
| 15.000.000 | Heimstaden Bostad AB, 3.25%, 31/12/2149                             | 14.640.500 |
| 1.410.000  | Neuberger Berman Euro Bond Fund                                     | 14.433.330 |
| 15.500.000 | BNP Paribas SA, 1.38%, 28/05/2029                                   | 14.312.890 |
| 14.200.000 | Landsbankinn HF, 3.75%, 08/10/2029                                  | 14.202.220 |
| 14.000.000 | Sumitomo Mitsui Banking Corp, 3.60%, 16/02/2026                     | 14.138.740 |
| 14.300.000 | Citigroup Inc, 1.50%, 24/07/2026                                    | 14.035.588 |
| 13.194.000 | Permanent TSB Group Holdings Plc, 6.63%, 25/04/2028                 | 13.969.873 |
| 13.325.000 | Islandsbanki HF, 4.63%, 27/03/2028                                  | 13.568.520 |
| 13.323.000 | SACE SPA, 3.88%, 31/12/2149   | 13.306.096 |

## Short Duration Euro Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

| Anteile    | Wertpapierbezeichnung  | Erlöse EUR |
|------------|--|------------|
| 14.900.000 | Sumitomo Mitsui Banking Corp, 3.60%, 16/02/2026              | 15.027.246 |
| 11.800.000 | Australia & New Zealand Banking Group Ltd, 3.44%, 04/04/2025 | 11.787.509 |
| 11.400.000 | Traton Finance Luxembourg SA, 4.13%, 18/01/2025              | 11.408.892 |
| 11.000.000 | Landsbankinn HF, 0.75%, 25/05/2026                           | 10.597.700 |
| 9.900.000  | Westpac Banking Corp, 3.46%, 04/04/2025                      | 9.894.639  |
| 8.900.000  | BPCE SFH SA, 0.13%, 31/03/2025                               | 8.643.868  |
| 9.000.000  | Wizz Air Finance Co BV, 1.00%, 19/01/2026                    | 8.585.500  |
| 8.500.000  | Skipton Building Society, 0.01%, 22/09/2024                  | 8.381.525  |
| 8.300.000  | UBS Group AG, 1.25%, 17/07/2025                              | 8.214.510  |
| 8.000.000  | Arval Service Lease SA, 3.38%, 04/01/2026                    | 7.961.080  |
| 7.100.000  | Crelan SA, 5.75%, 26/01/2028                                 | 7.499.050  |
| 7.100.284  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.55%, 21/05/2026         | 7.032.121  |
| 6.908.605  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.30%, 15/05/2028         | 6.979.971  |
| 7.000.000  | Morgan Stanley, 1.88%, 27/04/2027                            | 6.689.990  |
| 6.722.000  | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 2.88%, 20/10/2034         | 6.606.291  |
| 6.700.000  | Fastighets AB Balder, 1.88%, 23/01/2026                      | 6.282.120  |
| 5.801.000  | Slovenia Government Bond, 3.00%, 10/03/2034                  | 5.834.098  |
| 5.900.000  | Romanian Government International Bond, 3.62%, 26/05/2030    | 5.445.080  |
| 5.000.000  | Crelan SA, 5.25%, 23/01/2032                                 | 5.323.400  |
| 5.340.000  | Bank Gospodarstwa Krajowego, 3.00%, 30/05/2029               | 5.210.033  |

## Short Duration High Yield Engagement – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung   | Kosten US\$ |
|-----------|---|-------------|
| 5.575.000 | TransDigm Inc, 6.38%, 01/03/2029  | 5.573.563   |
| 5.890.000 | Service Properties Trust, 5.50%, 15/12/2027                                 | 5.544.056   |
| 5.755.000 | Comstock Resources Inc, 6.75%, 01/03/2029                                   | 5.380.025   |
| 5.100.000 | Champions Financing Inc, 8.75%, 15/02/2029                                  | 5.192.265   |
| 303.860   | Neuberger Berman CLO Income Fund  | 5.000.000   |
| 5.115.000 | Cloud Software Group Inc, 6.50%, 31/03/2029                                 | 4.879.953   |
| 4.930.000 | Medline Borrower LP, 5.25%, 01/10/2029                                      | 4.659.556   |
| 4.660.000 | American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 5.75%, 20/04/2029          | 4.603.674   |
| 4.430.000 | Windstream Services LLC / Windstream Escrow Finance Corp, 7.75%, 15/08/2028 | 4.462.730   |
| 4.375.000 | athenahealth Group Inc, 0.00%, 15/02/2029                                   | 4.341.031   |
| 4.285.000 | AmWINS Group Inc, 6.38%, 15/02/2029   | 4.289.706   |
| 4.455.000 | Kaiser Aluminum Corp, 4.63%, 01/03/2028                                     | 4.239.528   |
| 4.445.000 | SeaWorld Parks & Entertainment Inc, 5.25%, 15/08/2029                       | 4.228.869   |
| 4.390.000 | AthenaHealth Group Inc, 6.50%, 15/02/2030                                   | 4.225.375   |
| 4.255.000 | Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC, 5.50%, 01/05/2028   | 4.168.791   |
| 4.345.000 | VM Consolidated Inc, 5.50%, 15/04/2029                                      | 4.133.003   |
| 4.340.000 | Resideo Funding Inc, 4.00%, 01/09/2029                                      | 3.949.623   |
| 3.875.000 | Nationstar Mortgage Holdings Inc, 6.50%, 01/08/2029                         | 3.886.644   |
| 3.955.000 | Constellium SE, 5.63%, 15/06/2028   | 3.878.225   |
| 3.805.000 | US Acute Care Solutions LLC, 9.75%, 15/05/2029                              | 3.850.258   |

## Short Duration High Yield Engagement – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung   | Erlöse US\$ |
|-----------|---|-------------|
| 6.610.000 | Camelot Return Merger Sub Inc, 8.75%, 01/08/2028  | 6.544.848   |
| 6.045.000 | American Airlines Inc, 7.25%, 15/02/2028  | 6.124.933   |
| 5.825.000 | Civitas Resources Inc, 8.38%, 01/07/2028  | 6.068.569   |
| 5.825.000 | Gen Digital Inc, 6.75%, 30/09/2027  | 5.903.537   |
| 5.580.000 | Ally Financial Inc, 5.75%, 20/11/2025   | 5.580.942   |
| 5.700.000 | Advanced Drainage Systems Inc, 5.00%, 30/09/2027  | 5.521.871   |
| 5.890.000 | Service Properties Trust, 5.50%, 15/12/2027   | 5.466.013   |
| 5.340.000 | Solaris Midstream Holdings LLC, 7.63%, 01/04/2026   | 5.367.187   |
| 5.340.000 | Mattamy Group Corp, 5.25%, 15/12/2027   | 5.180.408   |
| 5.255.000 | Molina Healthcare Inc, 4.38%, 15/06/2028  | 5.064.021   |
| 4.820.000 | Energizer Holdings Inc, 6.50%, 31/12/2027   | 4.800.941   |
| 4.855.000 | Adient Global Holdings Ltd, 4.88%, 15/08/2026   | 4.791.892   |
| 4.885.000 | CSC Holdings LLC, 5.25%, 01/06/2024   | 4.775.088   |
| 5.145.000 | Hertz Corp, 4.63%, 01/12/2026   | 4.551.050   |
| 4.430.000 | Windstream Services LLC/Windstream Escrow Finance Corp, 7.75%, 15/08/2028                       | 4.515.942   |
| 4.360.000 | APX Group Inc, 6.75%, 15/02/2027  | 4.371.264   |
| 4.375.000 | athenahealth Group Inc, 0.00%, 15/02/2029   | 4.331.472   |
| 4.330.000 | Masonite International Corp, 5.38%, 01/02/2028  | 4.327.561   |
| 4.120.000 | Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/PK Finance Co-Issuer, 7.50%, 01/06/2025 | 4.142.270   |
| 4.010.000 | DISH Network Corp, 11.75%, 15/11/2027   | 4.030.050   |

## Strategic Income – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung   | Kosten US\$ |
|-------------|---|-------------|
| 116.930.000 | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/05/2054                                | 115.239.215 |
| 115.415.000 | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/04/2054                                | 114.919.798 |
| 115.110.000 | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/08/2054                                | 114.097.101 |
| 112.310.000 | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/06/2053                                | 110.479.250 |
| 110.055.000 | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/03/2049                                | 109.584.390 |
| 109.880.000 | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/07/2054                                | 108.767.637 |
| 83.985.000  | United Kingdom Gilt, 4.13%, 22/07/2029                            | 108.018.828 |
| 105.215.000 | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/02/2054                                | 105.378.449 |
| 102.600.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 10/10/2024                    | 100.014.503 |
| 120.615.000 | Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/08/2054                                | 99.445.392  |
| 100.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 11/04/2024                    | 98.683.979  |
| 100.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 20/02/2025                    | 97.679.572  |
| 87.810.912  | United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 2.13%, 15/04/2029 | 90.349.196  |
| 89.490.000  | United States Treasury Bill, 4.63%, 19/11/2024                    | 89.163.804  |
| 103.815.000 | Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/07/2050                                | 85.049.578  |
| 85.550.000  | Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/11/2048                                | 79.560.935  |
| 97.395.000  | Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/05/2054                                | 78.685.028  |
| 76.365.000  | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/09/2053                                | 76.701.594  |
| 92.520.000  | Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/06/2051                                | 74.399.844  |
| 78.435.000  | Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/12/2048                                | 73.033.401  |

## Strategic Income – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung   | Erlöse US\$ |
|-------------|---|-------------|
| 115.110.000 | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/08/2054                                | 115.624.137 |
| 116.930.000 | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/05/2054                                | 115.001.201 |
| 115.415.000 | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/04/2054                                | 113.960.480 |
| 112.310.000 | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/06/2053                                | 111.166.339 |
| 110.055.000 | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/03/2049                                | 109.553.649 |
| 109.880.000 | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/07/2054                                | 108.763.841 |
| 83.985.000  | United Kingdom Gilt, 4.13%, 22/07/2029                            | 106.376.067 |
| 105.215.000 | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/02/2054                                | 104.829.393 |
| 120.615.000 | Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/08/2054                                | 101.787.237 |
| 102.600.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 10/10/2024                    | 101.504.791 |
| 107.370.000 | Fannie Mae Pool, 4.00%, 31/12/2049                                | 98.893.190  |
| 100.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 20/02/2025                    | 98.148.127  |
| 89.250.000  | Fannie Mae Pool, 5.02%, 01/01/2054                                | 89.377.553  |
| 89.490.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 19/11/2024                    | 89.328.087  |
| 87.979.784  | United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 2.13%, 15/04/2029 | 88.722.725  |
| 103.815.000 | Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/07/2050                                | 85.384.694  |
| 85.550.000  | Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/11/2048                                | 79.793.336  |
| 97.395.000  | Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/05/2054                                | 78.218.095  |
| 76.365.000  | Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/09/2053                                | 77.275.701  |
| 92.520.000  | Fannie Mae Pool, 2.50%, 01/06/2051                                | 75.554.781  |
| 78.435.000  | Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/12/2048                                | 73.339.579  |
| 71.840.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 08/08/2024                    | 71.428.865  |
| 70.450.000  | Ginnie Mae, 6.00%, 01/09/2054                                     | 71.285.451  |
| 70.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 26/11/2024                    | 69.842.238  |
| 78.195.000  | Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/01/2051                                | 69.387.448  |
| 69.250.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 13/02/2025                    | 68.702.919  |
| 67.320.000  | Ginnie Mae, 6.00%, 01/07/2054                                     | 67.837.086  |
| 66.130.000  | Ginnie Mae, 6.00%, 01/06/2054                                     | 66.544.614  |
| 72.005.000  | Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/12/2052                                | 65.283.026  |
| 64.270.000  | Fannie Mae Pool, 6.00%, 01/08/2054                                | 65.238.357  |

## Sustainable Asia High Yield – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung  | Kosten US\$ |
|-----------|--|-------------|
| 700.000   | Development Bank of Mongolia LLC, 11.00%, 07/03/2026                 | 717.650     |
| 835.110   | Sri Lanka Government International Bond, 3.35%, 15/03/2033           | 585.387     |
| 950.000   | Vanke Real Estate Hong Kong Co Ltd, 3.98%, 09/11/2027                | 571.980     |
| 783.037   | Sri Lanka Government International Bond, 3.60%, 15/02/2038           | 530.053     |
| 600.000   | GLP Pte Ltd, 3.88%, 04/06/2025                                       | 525.080     |
| 800.000   | Sri Lanka Government International Bond, 6.85%, 03/11/2025           | 515.300     |
| 500.000   | City of Ulaanbaatar Mongolia, 7.75%, 21/08/2027                      | 511.875     |
| 700.000   | Franshion Brilliant Ltd, 4.25%, 23/07/2029                           | 510.850     |
| 500.000   | Shriram Finance Ltd, 6.63%, 22/04/2027                               | 499.805     |
| 600.000   | GLP China Holdings Ltd, 2.95%, 29/03/2026                            | 493.640     |
| 520.801   | Sri Lanka Government International Bond, 4.00%, 15/04/2028           | 488.772     |
| 563.892   | Sri Lanka Government International Bond, 3.60%, 15/06/2035           | 407.581     |
| 400.000   | Continuum Green Energy India Pvt/Co-Issuers, 7.50%, 26/06/2033       | 405.000     |
| 400.000   | FWD Group Holdings Ltd, 8.05%, 31/12/2149                            | 401.480     |
| 400.000   | SMIC SG Holdings Pte Ltd, 5.38%, 24/07/2029                          | 400.300     |
| 400.000   | FWD Group Holdings Ltd, 7.64%, 02/07/2031                            | 400.000     |
| 400.000   | MGM China Holdings Ltd, 7.13%, 26/06/2031                            | 400.000     |
| 400.000   | Hyundai Capital Services Inc, 5.13%, 05/02/2027                      | 398.912     |
| 400.000   | State Bank of India, 5.00%, 17/01/2029                               | 398.044     |
| 650.000   | Longfor Group Holdings Ltd, 3.95%, 16/09/2029                        | 390.275     |
| 400.000   | CAS Capital No 1 Ltd, 4.00%, 31/12/2149                              | 381.900     |
| 400.000   | Fortune Star BVI Ltd, 5.00%, 18/05/2026                              | 374.180     |
| 400.000   | Fuqing Investment Management Ltd, 3.25%, 23/06/2025                  | 366.650     |
| 400.000   | CFAMC III Co Ltd, 4.25%, 07/11/2027                                  | 364.740     |
| 400.000   | Mongolia Government International Bond, 3.50%, 07/07/2027            | 360.760     |
| 375.000   | CA Magnum Holdings, 5.38%, 31/10/2026                                | 353.213     |
| 400.000   | China Overseas Grand Oceans Finance IV Cayman Ltd, 2.45%, 09/02/2026 | 346.398     |
| 425.754   | Sri Lanka Government International Bond, 3.10%, 15/01/2030           | 324.459     |
| 500.000   | Sri Lanka Government International Bond, 6.83%, 18/07/2026           | 312.350     |
| 300.000   | Medco Maple Tree Pte Ltd, 8.96%, 27/04/2029                          | 312.300     |
| 400.000   | NWD Finance BVI Ltd, 5.25%, 31/12/2149                               | 306.000     |
| 300.000   | Woori Bank, 6.38%, 31/12/2149  | 300.000     |
| 300.000   | LG Electronics Inc, 5.63%, 24/04/2027                                | 298.800     |
| 300.000   | SK Hynix Inc, 5.50%, 16/01/2029                                      | 298.644     |
| 300.000   | Melco Resorts Finance Ltd, 5.25%, 26/04/2026                         | 296.070     |
| 286.000   | Singapore Airlines Ltd, 5.25%, 21/03/2034                            | 284.988     |
| 281.000   | IRB Infrastructure Developers Ltd, 7.11%, 11/03/2032                 | 280.767     |
| 300.000   | Meituan, 0.00%, 27/04/2028   | 269.850     |
| 391.354   | Sri Lanka Government International Bond, 3.60%, 15/05/2036           | 269.142     |
| 300.000   | VEON Holdings BV, 3.38%, 25/11/2027                                  | 262.830     |
| 2.394.644 | Sunac China Holdings Ltd, 7.25%, 30/09/2030                          | 251.394     |
| 250.000   | Bank of East Asia Ltd, 6.75%, 27/06/2034                             | 249.040     |
| 250.000   | Bank of East Asia Ltd, 5.83%, 31/12/2149                             | 245.225     |
| 460.000   | Sri Lanka Government International Bond, 6.75%, 18/04/2028           | 242.995     |

## Sustainable Asia High Yield – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung  | Erlöse US\$ |
|-----------|--|-------------|
| 1.950.000 | Sri Lanka Government International Bond, 6.85%, 03/11/2025       | 1.244.999   |
| 700.000   | CFAMC IV Co Ltd, 4.50%, 29/05/2029                               | 632.240     |
| 594.125   | Continuum Energy Levanter Pte Ltd, 4.50%, 09/02/2027             | 594.125     |
| 700.000   | Franshion Brilliant Ltd, 4.25%, 23/07/2029                       | 593.340     |
| 600.000   | Sands China Ltd, 5.40%, 08/08/2028                               | 583.330     |
| 600.000   | CFAMC III Co Ltd, 4.25%, 07/11/2027                              | 577.320     |
| 500.000   | Medco Bell Pte Ltd, 6.38%, 30/01/2027                            | 499.750     |
| 500.000   | ENN Clean Energy International Investment Ltd, 3.38%, 12/05/2026 | 479.202     |
| 750.000   | Vanke Real Estate Hong Kong Co Ltd, 3.98%, 09/11/2027            | 461.300     |
| 400.000   | Vedanta Resources Finance II Plc, 10.88%, 17/09/2029             | 418.450     |
| 400.000   | State Bank of India, 5.00%, 17/01/2029                           | 398.280     |
| 400.000   | Hyundai Capital Services Inc, 5.13%, 05/02/2027                  | 396.420     |
| 600.000   | Sri Lanka Government International Bond, 6.13%, 03/06/2025       | 393.710     |
| 600.000   | Sri Lanka Government International Bond, 7.55%, 28/03/2030       | 391.789     |
| 600.000   | Sri Lanka Government International Bond, 5.75%, 18/04/2049       | 388.576     |
| 400.000   | CFAMC III Co Ltd, 4.75%, 27/04/2027                              | 386.680     |
| 400.000   | CFAMC II Co Ltd, 4.63%, 03/06/2026                               | 385.500     |
| 400.000   | Mongolia Government International Bond, 3.50%, 07/07/2027        | 375.640     |
| 450.000   | Shui On Development Holding Ltd, 5.50%, 03/03/2025               | 364.925     |
| 368.000   | Vedanta Resources Finance II Plc, 13.88%, 09/12/2028             | 337.280     |
| 333.000   | Philippine Government International Bond, 5.00%, 17/07/2033      | 332.800     |
| 500.000   | Sri Lanka Government International Bond, 6.83%, 18/07/2026       | 330.739     |
| 330.000   | Shriram Finance Ltd, 4.40%, 13/03/2024                           | 329.010     |
| 300.000   | Medco Maple Tree Pte Ltd, 8.96%, 27/04/2029                      | 318.150     |
| 460.000   | Sri Lanka Government International Bond, 6.75%, 18/04/2028       | 306.819     |
| 300.000   | Woori Bank, 6.38%, 31/12/2149                                    | 305.400     |
| 300.000   | LG Electronics Inc, 5.63%, 24/04/2027                            | 302.253     |
| 300.000   | Korea Land & Housing Corp, 5.75%, 06/10/2025                     | 302.203     |
| 300.000   | SK Hynix Inc, 5.50%, 16/01/2029                                  | 301.059     |
| 300.000   | Meituan, 0.00%, 27/04/2028                                       | 293.490     |
| 400.000   | Longfor Group Holdings Ltd, 3.95%, 16/09/2029                    | 292.700     |
| 286.000   | Singapore Airlines Ltd, 5.25%, 21/03/2034                        | 286.366     |
| 273.000   | Lenovo Group Ltd, 5.83%, 27/01/2028                              | 273.366     |
| 300.000   | Meituan, 3.05%, 28/10/2030                                       | 258.750     |
| 229.000   | Industrial Bank of Korea, 5.38%, 04/10/2028                      | 237.097     |
| 234.900   | Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd, 6.75%, 24/04/2033       | 237.014     |
| 200.000   | FWD Group Holdings Ltd, 8.40%, 05/04/2029                        | 212.300     |
| 200.000   | SK Hynix Inc, 6.50%, 17/01/2033                                  | 209.204     |
| 200.000   | LG Energy Solution Ltd, 5.75%, 25/09/2028                        | 204.894     |

## Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile    | Wertpapierbezeichnung   | Kosten US\$ |
|------------|---|-------------|
| 9.600.000  | Dominican Republic International Bond, 4.88%, 23/09/2032            | 8.599.358   |
| 7.739.000  | Romanian Government International Bond, 5.63%, 22/02/2036           | 8.265.820   |
| 9.210.000  | Serbia International Bond, 1.65%, 03/03/2033                        | 7.507.786   |
| 10.082.604 | Ghana Government International Bond 03/07/2035                      | 7.149.474   |
| 7.180.000  | Brazilian Government International Bond, 6.00%, 20/10/2033          | 7.007.201   |
| 6.284.000  | Republic of Poland Government International Bond, 5.13%, 18/09/2034 | 6.345.999   |
| 7.011.466  | Ghana Government International Bond, 5.00%, 03/07/2029              | 6.201.221   |
| 6.450.000  | Ivory Coast Government International Bond, 6.88%, 17/10/2040        | 5.929.463   |
| 5.240.000  | Costa Rica Government International Bond, 6.55%, 03/04/2034         | 5.465.262   |
| 13.570.000 | Argentine Republic Government International Bond, 4.13%, 09/07/2046 | 5.253.302   |
| 4.690.000  | Colombia Government International Bond, 8.00%, 20/04/2033           | 4.881.832   |
| 5.670.000  | Serbia International Bond, 2.13%, 01/12/2030                        | 4.794.215   |
| 5.039.150  | Greenko Power II Ltd, 4.30%, 13/12/2028                             | 4.743.824   |
| 4.560.000  | Romanian Government International Bond, 3.62%, 26/05/2030           | 4.608.074   |
| 6.566.080  | Sri Lanka Government International Bond, 3.35%, 15/03/2033          | 4.602.625   |
| 4.420.000  | Bank Gospodarstwa Krajowego, 5.38%, 22/05/2033                      | 4.466.649   |
| 4.020.000  | Istanbul Metropolitan Municipality, 10.50%, 06/12/2028              | 4.352.340   |
| 4.368.000  | Bulgaria Government International Bond, 5.00%, 05/03/2037           | 4.345.923   |
| 4.133.000  | Bancolombia SA, 8.63%, 24/12/2034                                   | 4.304.222   |
| 6.156.650  | Sri Lanka Government International Bond, 3.60%, 15/02/2038          | 4.167.560   |
| 3.703.000  | Indonesia Government International Bond, 3.65%, 10/09/2032          | 4.116.872   |
| 3.950.000  | Latvia Government International Bond, 5.13%, 30/07/2034             | 4.010.762   |
| 4.142.019  | Sri Lanka Government International Bond, 4.00%, 15/04/2028          | 3.887.285   |
| 3.690.000  | Morocco Government International Bond, 6.50%, 08/09/2033            | 3.767.595   |
| 4.040.000  | Telecomunicaciones Digitales SA, 4.50%, 30/01/2030                  | 3.581.400   |
| 3.840.000  | Dominican Republic International Bond, 4.50%, 30/01/2030            | 3.568.414   |
| 3.130.000  | Chile Government International Bond, 4.13%, 05/07/2034              | 3.390.161   |
| 3.210.000  | Ivory Coast Government International Bond, 5.88%, 17/10/2031        | 3.268.417   |
| 4.040.000  | Prosus NV, 4.99%, 19/01/2052  | 3.265.433   |
| 4.433.616  | Sri Lanka Government International Bond, 3.60%, 15/06/2035          | 3.204.618   |
| 4.870.000  | Ghana Government International Bond, 10.75%, 14/10/2030             | 3.191.138   |
| 6.729.000  | Argentine Republic Government International Bond, 3.50%, 09/07/2041 | 3.175.726   |
| 3.060.000  | AIA Group Ltd, 5.38%, 05/04/2034                                    | 3.167.026   |
| 3.610.000  | Peruvian Government International Bond, 1.25%, 11/03/2033           | 3.137.103   |

## Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile    | Wertpapierbezeichnung   | Erlöse US\$ |
|------------|---|-------------|
| 12.088.000 | Serbia International Bond, 1.50%, 26/06/2029                        | 11.475.771  |
| 12.090.000 | Romanian Government International Bond, 3.75%, 07/02/2034           | 11.386.723  |
| 23.730.000 | Argentine Republic Government International Bond, 4.13%, 09/07/2035 | 10.108.505  |
| 12.840.000 | Sri Lanka Government International Bond, 6.83%, 18/07/2026          | 8.405.332   |
| 14.533.000 | Ghana Government International Bond, 0.11%, 14/10/2030              | 7.347.310   |
| 9.439.040  | Argentine Republic Government International Bond, 0.75%, 09/07/2030 | 5.491.525   |
| 8.678.000  | Ghana Government International Bond, 7.75%, 07/04/2029              | 4.791.611   |
| 6.307.000  | Sri Lanka Government International Bond, 6.85%, 03/11/2025          | 4.209.944   |
| 3.717.000  | Romanian Government International Bond, 5.63%, 22/02/2036           | 3.775.275   |
| 3.777.000  | Colombia Government International Bond, 3.88%, 25/04/2027           | 3.625.920   |
| 10.367.000 | Ukraine Government International Bond, 9.75%, 01/11/2030            | 3.480.828   |
| 3.912.000  | Mexico Government International Bond, 5.75%, 12/10/2110             | 3.260.380   |
| 4.820.000  | Sri Lanka Government International Bond, 6.75%, 18/04/2028          | 3.181.395   |
| 3.542.000  | Dominican Republic International Bond, 5.88%, 30/01/2060            | 3.110.703   |
| 4.696.000  | Sri Lanka Government International Bond, 6.20%, 11/05/2027          | 2.982.372   |
| 3.750.000  | Braskem Idesa SAPI, 6.99%, 20/02/2032                               | 2.943.750   |
| 4.150.000  | Colombia Government International Bond, 5.20%, 15/05/2049           | 2.937.670   |
| 2.620.000  | Türkiye Vakıflar Bankası TAO, 9.00%, 12/10/2028                     | 2.856.376   |
| 2.883.000  | El Salvador Government International Bond, 7.65%, 15/06/2035        | 2.610.878   |
| 2.490.000  | Gabon Blue Bond Master Trust Series 2, 6.10%, 01/08/2038            | 2.502.450   |
| 2.460.000  | Latvia Government International Bond, 0.25%, 23/01/2030             | 2.355.918   |
| 2.190.000  | Philippine Government International Bond, 0.70%, 03/02/2029         | 2.170.610   |
| 2.920.000  | Colombia Government International Bond, 5.00%, 15/06/2045           | 2.168.373   |
| 2.560.000  | Peruvian Government International Bond, 3.00%, 15/01/2034           | 2.115.594   |
| 2.833.000  | Romanian Government International Bond, 3.38%, 28/01/2050           | 2.033.102   |
| 1.720.000  | Bulgaria Government International Bond, 4.50%, 27/01/2033           | 2.029.544   |
| 2.350.000  | Chile Government International Bond, 3.50%, 31/01/2034              | 2.021.660   |
| 2.203.000  | Jordan Government International Bond, 7.38%, 10/10/2047             | 2.010.238   |
| 2.060.000  | Bank Gospodarstwa Krajowego, 0.50%, 08/07/2031                      | 1.879.596   |
| 3.430.000  | Ghana Government International Bond, 7.88%, 26/03/2027              | 1.878.551   |
| 1.608.000  | Republic of Poland Government International Bond, 4.13%, 11/01/2044 | 1.824.651   |

## Tactical Macro – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                          | Kosten US\$ |
|-----------|--|-------------|
| 7.696.800 | United States Treasury Bill, 0.00%, 18/07/2024 | 7.608.003   |
| 6.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 25/02/2025 | 5.930.642   |
| 6.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 28/05/2024 | 5.904.068   |
| 6.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 25/06/2024 | 5.897.222   |
| 5.825.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 15/04/2025 | 5.750.403   |
| 5.500.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 09/01/2025 | 5.451.079   |
| 5.500.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 14/01/2025 | 5.439.366   |
| 5.300.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 21/11/2024 | 5.231.871   |
| 5.250.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 26/12/2024 | 5.190.028   |
| 5.266.400 | United States Treasury Bill, 0.00%, 17/10/2024 | 5.165.411   |
| 5.249.100 | United States Treasury Bill, 0.00%, 24/09/2024 | 5.165.361   |
| 5.233.100 | United States Treasury Bill, 0.00%, 29/10/2024 | 5.158.727   |
| 5.222.100 | United States Treasury Bill, 0.00%, 20/08/2024 | 5.153.007   |
| 5.175.600 | United States Treasury Bill, 0.00%, 20/06/2024 | 5.152.935   |
| 5.200.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 04/06/2024 | 5.117.948   |
| 5.060.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 21/01/2025 | 5.009.223   |
| 5.060.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 31/10/2024 | 5.000.742   |
| 5.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 23/04/2024 | 4.930.059   |
| 3.892.400 | United States Treasury Bill, 0.00%, 25/07/2024 | 3.858.515   |
| 3.500.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 13/02/2025 | 3.457.633   |
| 3.492.100 | United States Treasury Bill, 0.00%, 05/11/2024 | 3.439.162   |
| 2.500.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 14/03/2024 | 2.482.555   |
| 2.100.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 13/03/2025 | 2.077.806   |
| 2.035.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 12/12/2024 | 2.000.522   |

## Tactical Macro – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Verkäufe insgesamt:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung                          | Erlöse US\$ |
|-----------|--|-------------|
| 6.805.800 | United States Treasury Bill, 0.00%, 30/01/2024 | 6.800.904   |
| 6.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 28/05/2024 | 5.963.150   |
| 6.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 25/06/2024 | 5.939.953   |
| 5.200.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 04/06/2024 | 5.163.468   |
| 5.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 23/04/2024 | 4.994.162   |
| 2.500.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 18/07/2024 | 2.466.693   |
| 557.500   | United States Treasury Bill, 0.00%, 05/07/2024 | 551.099     |
| 548.800   | United States Treasury Bill, 0.00%, 25/07/2024 | 540.963     |

## Uncorrelated Strategies – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung                          | Kosten US\$ |
|-------------|--|-------------|
| 130.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 09/05/2024 | 128.435.300 |
| 130.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 20/08/2024 | 128.071.959 |
| 125.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 02/05/2024 | 123.373.438 |
| 125.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 18/04/2024 | 123.344.479 |
| 110.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 18/07/2024 | 108.652.372 |
| 110.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 11/04/2024 | 108.533.443 |
| 100.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 04/04/2024 | 98.691.125  |
| 75.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 01/08/2024 | 74.061.077  |
| 75.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 13/08/2024 | 73.932.208  |
| 65.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 27/02/2025 | 64.312.525  |
| 65.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 20/02/2025 | 64.305.770  |
| 65.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 21/11/2024 | 64.165.790  |
| 65.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 29/11/2024 | 64.104.986  |
| 55.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 27/06/2024 | 54.394.829  |
| 55.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 23/01/2025 | 54.382.763  |
| 55.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 16/01/2025 | 54.377.125  |
| 55.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 17/10/2024 | 54.318.486  |
| 55.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 07/11/2024 | 54.279.500  |
| 55.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 24/10/2024 | 54.265.500  |
| 50.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 06/02/2025 | 49.494.565  |
| 50.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 14/11/2024 | 49.355.808  |
| 45.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 05/07/2024 | 44.426.075  |
| 67.000.000  | United Kingdom Gilt, 0.63%, 22/10/2050         | 34.939.582  |
| 25.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 23/04/2024 | 24.816.979  |
| 20.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 09/01/2025 | 19.784.068  |

## Uncorrelated Strategies – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Verkäufe insgesamt:

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung                          | Erlöse US\$ |
|-------------|--|-------------|
| 100.000.000 | United States Treasury Bill, 0.00%, 29/02/2024 | 99.883.689  |
| 55.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 27/06/2024 | 54.710.480  |
| 55.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 04/04/2024 | 54.701.222  |
| 45.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 05/07/2024 | 44.710.453  |
| 40.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 07/11/2024 | 39.729.950  |
| 67.000.000  | United Kingdom Gilt, 0.63%, 22/10/2050         | 33.487.829  |
| 25.000.000  | United States Treasury Bill, 0.00%, 13/08/2024 | 24.959.808  |
| 67.500      | Albemarle Corp                                 | 3.685.183   |

## US Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung                   | Kosten US\$ |
|---------|---|-------------|
| 18.394  | Microsoft Corp                          | 7.865.969   |
| 39.531  | Amazon.com Inc                          | 7.668.890   |
| 34.343  | NVIDIA Corp                             | 6.189.229   |
| 9.957   | Meta Platforms Inc Class A              | 5.266.509   |
| 24.056  | Apple Inc                               | 5.185.874   |
| 11.773  | Broadcom Inc                            | 4.351.229   |
| 24.629  | Alphabet Inc Class A                    | 4.041.152   |
| 10.029  | Salesforce Inc                          | 2.969.646   |
| 4.785   | Synopsys Inc                            | 2.607.209   |
| 8.702   | Visa Inc Class A                        | 2.543.816   |
| 3.500   | Netflix Inc                             | 2.500.317   |
| 25.728  | NIKE Inc Class B                        | 2.186.675   |
| 3.185   | Intuit Inc                              | 2.035.161   |
| 2.231   | ServiceNow Inc                          | 1.933.078   |
| 3.923   | Mastercard Inc Class A                  | 1.903.960   |
| 16.324  | TJX Cos Inc                             | 1.825.252   |
| 6.736   | Workday Inc Class A                     | 1.762.380   |
| 2.031   | Eli Lilly & Co                          | 1.724.234   |
| 10.286  | Advanced Micro Devices Inc              | 1.691.874   |
| 9.284   | AbbVie Inc                              | 1.619.143   |
| 2.814   | Thermo Fisher Scientific Inc            | 1.561.696   |
| 3.204   | S&P Global Inc                          | 1.521.981   |
| 18.935  | Boston Scientific Corp                  | 1.521.562   |
| 5.132   | McDonald's Corp                         | 1.488.153   |
| 3.791   | Home Depot Inc                          | 1.457.198   |
| 19.667  | NextEra Energy Inc                      | 1.377.545   |
| 7.168   | General Electric Co                     | 1.273.228   |
| 4.850   | Equifax Inc                             | 1.248.505   |
| 2.375   | UnitedHealth Group Inc                  | 1.244.442   |
| 8.040   | KKR & Co Inc                            | 1.232.094   |
| 14.204  | Walmart Inc                             | 1.221.363   |
| 1.402   | Costco Wholesale Corp                   | 1.201.086   |
| 5.490   | Analog Devices Inc                      | 1.143.952   |
| 16.657  | Amphenol Corp Class A                   | 1.134.882   |
| 24.540  | Brookfield Asset Management Ltd Class A | 1.123.203   |
| 32.705  | Match Group Inc                         | 1.102.202   |
| 15.248  | Uber Technologies Inc                   | 1.077.799   |

## US Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung                   | Erlöse US\$ |
|---------|---|-------------|
| 8.619   | Microsoft Corp                          | 3.672.052   |
| 15.360  | Amazon.com Inc                          | 2.997.928   |
| 14.009  | NVIDIA Corp                             | 2.861.072   |
| 5.312   | UnitedHealth Group Inc                  | 2.786.421   |
| 14.934  | Alphabet Inc Class A                    | 2.549.156   |
| 7.819   | Salesforce Inc                          | 2.264.543   |
| 4.286   | Meta Platforms Inc Class A              | 2.231.800   |
| 24.659  | NextEra Energy Inc                      | 1.830.498   |
| 7.947   | Apple Inc                               | 1.680.027   |
| 49.089  | Keurig Dr Pepper Inc                    | 1.654.178   |
| 2.633   | Adobe Inc                               | 1.309.384   |
| 1.551   | ServiceNow Inc                          | 1.283.981   |
| 1.855   | Netflix Inc                             | 1.282.413   |
| 4.905   | Equifax Inc                             | 1.278.518   |
| 5.770   | CME Group Inc Class A                   | 1.195.076   |
| 2.386   | Mastercard Inc Class A                  | 1.161.462   |
| 5.701   | Progressive Corp                        | 1.159.190   |
| 1.776   | Intuit Inc                              | 1.110.466   |
| 9.481   | TJX Cos Inc                             | 1.055.337   |
| 4.933   | Broadcom Inc                            | 1.011.806   |
| 6.793   | TE Connectivity Plc                     | 985.240     |
| 28.033  | Match Group Inc                         | 947.293     |
| 3.156   | Visa Inc Class A                        | 929.650     |
| 8.589   | Dollar Tree Inc                         | 928.802     |
| 4.374   | Analog Devices Inc                      | 904.471     |
| 5.151   | AbbVie Inc                              | 891.759     |
| 3.650   | Workday Inc Class A                     | 884.658     |
| 1.784   | S&P Global Inc                          | 873.447     |
| 4.346   | Waste Management Inc                    | 871.860     |
| 3.175   | McDonald's Corp                         | 871.833     |
| 37.729  | Chewy Inc Class A                       | 843.918     |
| 5.399   | Johnson & Johnson                       | 785.223     |
| 14.634  | Brookfield Asset Management Ltd Class A | 764.987     |
| 9.431   | NIKE Inc Class B                        | 760.105     |
| 928     | Costco Wholesale Corp                   | 754.210     |
| 10.129  | Walmart Inc                             | 739.269     |
| 1.301   | Thermo Fisher Scientific Inc            | 721.231     |
| 3.009   | CDW Corp                                | 662.452     |
| 7.384   | Boston Scientific Corp                  | 604.014     |

## US Equity Premium – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Käufe insgesamt:

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung                               | Kosten US\$ |
|-------------|---|-------------|
| 114.200.000 | United States Treasury Note/Bond, 5.00%, 31/08/2025 | 115.025.547 |
| 108.300.000 | United States Treasury Note/Bond, 4.25%, 31/05/2025 | 107.831.484 |
| 102.200.000 | United States Treasury Note/Bond, 4.63%, 15/03/2026 | 102.719.836 |
| 102.200.000 | United States Treasury Note/Bond, 4.63%, 28/02/2025 | 102.119.906 |
| 96.900.000  | United States Treasury Note/Bond, 4.13%, 15/06/2026 | 96.547.926  |
| 96.300.000  | United States Treasury Note/Bond, 4.25%, 31/12/2024 | 95.844.297  |
| 87.200.000  | United States Treasury Note/Bond, 4.25%, 31/01/2026 | 86.988.813  |
| 26.900.000  | United States Treasury Note/Bond, 4.63%, 15/09/2026 | 27.422.328  |
| 18.000.000  | United States Treasury Note/Bond, 4.00%, 15/12/2025 | 17.868.516  |
| 15.000.000  | United States Treasury Note/Bond, 3.50%, 15/09/2025 | 14.765.039  |
| 15.000.000  | United States Treasury Note/Bond, 2.88%, 15/06/2025 | 14.660.742  |

## US Equity Premium – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Verkäufe insgesamt:

| Anteile     | Wertpapierbezeichnung                               | Erlöse US\$ |
|-------------|---|-------------|
| 102.200.000 | United States Treasury Note/Bond, 4.63%, 28/02/2025 | 102.047.000 |
| 97.300.000  | United States Treasury Note/Bond, 3.50%, 15/09/2025 | 95.749.281  |
| 96.300.000  | United States Treasury Note/Bond, 4.25%, 31/12/2024 | 95.686.840  |
| 97.300.000  | United States Treasury Note/Bond, 2.88%, 15/06/2025 | 95.072.742  |
| 90.000.000  | United States Treasury Note/Bond, 0.25%, 15/06/2024 | 88.389.844  |
| 90.000.000  | United States Treasury Note/Bond, 0.38%, 15/09/2024 | 87.479.297  |
| 86.400.000  | United States Treasury Note/Bond, 0.25%, 15/03/2024 | 85.927.500  |
| 87.100.000  | United States Treasury Note/Bond, 1.00%, 15/12/2024 | 84.303.273  |
| 80.700.000  | United States Treasury Note/Bond, 1.75%, 15/03/2025 | 78.190.734  |

## US Large Cap Value – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung            | Kosten US\$ |
|-----------|----------------------------------|-------------|
| 65.614    | UnitedHealth Group Inc           | 36.437.677  |
| 75.794    | S&P Global Inc                   | 33.009.132  |
| 320.757   | Medtronic Plc                    | 28.717.220  |
| 76.786    | Accenture Plc Class A            | 27.769.905  |
| 175.011   | QUALCOMM Inc                     | 26.048.460  |
| 77.553    | Public Storage                   | 25.660.415  |
| 146.192   | Capital One Financial Corp       | 23.633.427  |
| 61.904    | Caterpillar Inc                  | 23.406.854  |
| 1.062.017 | Carnival Corp                    | 19.787.267  |
| 73.018    | Norfolk Southern Corp            | 19.250.954  |
| 369.472   | Las Vegas Sands Corp             | 18.723.865  |
| 257.202   | NextEra Energy Inc               | 18.617.195  |
| 318.876   | Wells Fargo & Co                 | 18.367.626  |
| 57.490    | Cummins Inc                      | 18.175.771  |
| 151.328   | Exxon Mobil Corp                 | 18.163.172  |
| 97.272    | Advanced Micro Devices Inc       | 18.071.342  |
| 253.312   | PayPal Holdings Inc              | 17.525.399  |
| 112.357   | Chevron Corp                     | 17.414.481  |
| 73.446    | CME Group Inc Class A            | 16.625.371  |
| 405.474   | Baker Hughes Co Class A          | 16.090.797  |
| 47.907    | Amgen Inc                        | 15.110.362  |
| 60.363    | Danaher Corp                     | 15.080.185  |
| 331.939   | Freeport-McMoRan Inc             | 14.999.974  |
| 27.889    | Lockheed Martin Corp             | 14.999.802  |
| 130.912   | Abbott Laboratories              | 14.863.777  |
| 139.040   | Morgan Stanley                   | 13.827.044  |
| 155.390   | Colgate-Palmolive Co             | 13.811.863  |
| 74.164    | AbbVie Inc                       | 13.605.851  |
| 45.905    | Salesforce Inc                   | 13.588.779  |
| 187.522   | Amphenol Corp Class A            | 13.266.733  |
| 108.299   | 3M Co                            | 13.185.633  |
| 175.124   | American International Group Inc | 12.868.252  |
| 15.682    | BlackRock Inc Class A            | 12.797.815  |
| 48.743    | Union Pacific Corp               | 12.385.472  |
| 33.637    | Humana Inc                       | 12.120.698  |
| 99.853    | RTX Corp                         | 11.810.369  |

## US Large Cap Value – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile   | Wertpapierbezeichnung              | Erlöse US\$ |
|-----------|------------------------------------|-------------|
| 524.401   | Procter & Gamble Co                | 86.190.428  |
| 574.710   | Merck & Co Inc                     | 70.848.570  |
| 815.400   | Mondelez International Inc Class A | 57.911.047  |
| 561.251   | Duke Energy Corp                   | 55.042.374  |
| 1.482.951 | Exelon Corp                        | 54.992.493  |
| 483.719   | DTE Energy Co                      | 54.461.846  |
| 511.225   | Walmart Inc                        | 47.202.361  |
| 631.074   | Sempra                             | 47.095.152  |
| 1.674.982 | Pfizer Inc                         | 46.255.102  |
| 108.738   | Berkshire Hathaway Inc Class B     | 46.158.238  |
| 592.314   | Gilead Sciences Inc                | 43.506.981  |
| 672.743   | Rio Tinto Plc ADR                  | 43.342.733  |
| 178.878   | Becton Dickinson & Co              | 42.212.001  |
| 469.680   | American Electric Power Co Inc     | 37.899.198  |
| 197.709   | JPMorgan Chase & Co                | 37.255.191  |
| 227.403   | Johnson & Johnson                  | 36.191.187  |
| 223.975   | PNC Financial Services Group Inc   | 35.028.799  |
| 68.585    | UnitedHealth Group Inc             | 34.423.759  |
| 98.165    | Stryker Corp                       | 34.413.358  |
| 560.152   | Citigroup Inc                      | 32.894.682  |
| 881.568   | Newmont Corp                       | 32.782.713  |
| 188.308   | QUALCOMM Inc                       | 31.948.455  |
| 111.664   | Amgen Inc                          | 31.635.845  |
| 140.822   | Applied Materials Inc              | 28.295.667  |
| 656.214   | Freeport-McMoRan Inc               | 27.441.091  |
| 249.034   | Exxon Mobil Corp                   | 26.562.196  |
| 126.520   | CME Group Inc Class A              | 25.886.539  |
| 365.323   | Agnico Eagle Mines Ltd             | 24.975.171  |
| 202.702   | Zimmer Biomet Holdings Inc         | 24.650.373  |
| 51.093    | Elevance Health Inc                | 24.357.056  |
| 52.901    | S&P Global Inc                     | 23.891.483  |
| 855.780   | CenterPoint Energy Inc             | 23.791.195  |
| 394.303   | Wells Fargo & Co                   | 21.978.299  |
| 419.231   | Kroger Co                          | 21.692.479  |
| 526.075   | Verizon Communications Inc         | 21.336.593  |

## US Long Short Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung                   | Kosten US\$ |
|---------|---|-------------|
| 15.917  | NVIDIA Corp                             | 2.826.533   |
| 4.538   | Synopsys Inc                            | 2.452.132   |
| 96.048  | Waystar Holding Corp                    | 2.133.123   |
| 8.177   | Norfolk Southern Corp                   | 2.112.464   |
| 2.981   | Broadcom Inc                            | 2.112.051   |
| 75.056  | CenterPoint Energy Inc                  | 2.097.293   |
| 29.968  | Wells Fargo & Co                        | 2.058.365   |
| 15.553  | Philip Morris International Inc         | 1.930.317   |
| 22.299  | NIKE Inc Class B                        | 1.928.780   |
| 44.287  | Brookfield Asset Management Ltd Class A | 1.792.740   |
| 7.792   | Apple Inc                               | 1.647.706   |
| 2.078   | HubSpot Inc                             | 1.508.209   |
| 8.129   | PNC Financial Services Group Inc        | 1.451.193   |
| 42.867  | Match Group Inc                         | 1.368.085   |
| 3.469   | Home Depot Inc                          | 1.329.432   |
| 8.696   | KKR & Co Inc                            | 1.324.752   |
| 7.312   | Advanced Micro Devices Inc              | 1.288.642   |
| 7.301   | General Electric Co                     | 1.253.636   |
| 2.376   | Meta Platforms Inc Class A              | 1.213.348   |
| 7.226   | Chevron Corp                            | 1.154.719   |
| 42.118  | Chewy Inc Class A                       | 1.105.044   |
| 5.415   | JPMorgan Chase & Co                     | 1.078.170   |
| 2.130   | MSCI Inc Class A                        | 1.026.724   |
| 25.944  | FirstEnergy Corp                        | 1.001.149   |
| 10.092  | Dollar Tree Inc                         | 982.867     |
| 16.010  | Alliant Energy Corp                     | 944.250     |
| 1.217   | ServiceNow Inc                          | 900.490     |
| 1.053   | Eli Lilly & Co                          | 887.438     |
| 3.268   | Salesforce Inc                          | 876.959     |
| 3.118   | Workday Inc Class A                     | 817.142     |
| 1.888   | Microsoft Corp                          | 798.563     |
| 1.169   | Netflix Inc                             | 767.796     |
| 6.353   | Abbott Laboratories                     | 745.308     |
| 3.379   | Amazon.com Inc                          | 704.712     |
| 13.087  | Chipotle Mexican Grill Inc Class A      | 698.344     |

## US Long Short Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung                   | Erlöse US\$ |
|---------|---|-------------|
| 15.646  | Progressive Corp                        | 3.219.010   |
| 6.270   | Adobe Inc                               | 3.174.193   |
| 10.488  | Salesforce Inc                          | 3.170.533   |
| 33.743  | WEC Energy Group Inc                    | 2.999.161   |
| 33.165  | Dollar Tree Inc                         | 2.915.790   |
| 5.570   | UnitedHealth Group Inc                  | 2.890.801   |
| 100.945 | Chewy Inc Class A                       | 2.499.495   |
| 75.564  | Sweetgreen Inc Class A                  | 2.365.699   |
| 4.805   | Meta Platforms Inc Class A              | 2.274.603   |
| 63.572  | Keurig Dr Pepper Inc                    | 2.148.866   |
| 16.832  | TJX Cos Inc                             | 1.780.324   |
| 10.742  | Splunk Inc                              | 1.672.127   |
| 5.443   | Equifax Inc                             | 1.448.312   |
| 6.658   | JPMorgan Chase & Co                     | 1.405.597   |
| 17.933  | NextEra Energy Inc                      | 1.377.515   |
| 26.684  | Brookfield Corp                         | 1.212.281   |
| 38.596  | CenterPoint Energy Inc                  | 1.158.568   |
| 5.418   | Boeing Co                               | 1.099.641   |
| 29.589  | Match Group Inc                         | 1.061.112   |
| 5.206   | CME Group Inc Class A                   | 1.060.518   |
| 1.329   | ServiceNow Inc                          | 1.015.190   |
| 50.887  | Kenvue Inc                              | 1.014.019   |
| 3.913   | Union Pacific Corp                      | 974.390     |
| 10.985  | Ashland Inc                             | 950.707     |
| 16.494  | Brookfield Asset Management Ltd Class A | 927.026     |
| 3.746   | Norfolk Southern Corp                   | 924.569     |
| 12.293  | Walmart Inc                             | 923.461     |
| 1.413   | Netflix Inc                             | 901.667     |
| 954.000 | Meta Platforms Inc, 4.65%, 15/08/2062   | 866.744     |
| 4.910   | Atlassian Corp Class A                  | 838.758     |
| 2.329   | NVIDIA Corp                             | 812.950     |
| 3.682   | SBA Communications Corp Class A         | 807.621     |
| 8.732   | Lamb Weston Holdings Inc                | 794.707     |

## US Multi Cap Opportunities – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung                        | Kosten US\$ |
|---------|--|-------------|
| 129.000 | Nasdaq Inc                                   | 8.401.888   |
| 32.000  | Charles River Laboratories International Inc | 6.723.333   |
| 79.000  | Uber Technologies Inc                        | 5.525.793   |
| 83.000  | Alliant Energy Corp                          | 5.087.920   |
| 37.000  | Morgan Stanley                               | 4.691.098   |
| 68.000  | NextEra Energy Inc                           | 4.587.778   |
| 59.700  | Ball Corp                                    | 3.756.221   |
| 5.000   | ASML Holding NV                              | 3.580.740   |
| 25.000  | Oracle Corp                                  | 3.564.522   |
| 32.500  | TransUnion                                   | 2.520.685   |
| 19.000  | EOG Resources Inc                            | 2.379.837   |
| 10.500  | Avery Dennison Corp                          | 2.221.166   |
| 10.800  | Intercontinental Exchange Inc                | 1.663.287   |
| 8.400   | Amazon.com Inc                               | 1.659.768   |
| 7.000   | Apple Inc                                    | 1.582.845   |
| 5.200   | McDonald's Corp                              | 1.512.816   |
| 7.500   | QUALCOMM Inc                                 | 1.273.495   |
| 3.000   | Microsoft Corp                               | 1.272.190   |
| 325     | Booking Holdings Inc                         | 1.159.621   |
| 3.800   | Chubb Ltd                                    | 1.075.407   |
| 3.900   | WD-40 Co                                     | 998.315     |
| 3.100   | HCA Healthcare Inc                           | 987.667     |
| 3.000   | Eagle Materials Inc                          | 837.576     |
| 28.000  | Graphic Packaging Holding Co                 | 827.542     |

## US Multi Cap Opportunities – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung                    | Erlöse US\$ |
|---------|--|-------------|
| 22.600  | HCA Healthcare Inc                       | 7.497.722   |
| 17.000  | Berkshire Hathaway Inc Class B           | 6.965.263   |
| 44.500  | Alphabet Inc Class C                     | 6.828.204   |
| 42.000  | Apollo Global Management Inc             | 5.962.492   |
| 15.000  | Motorola Solutions Inc                   | 5.773.886   |
| 126.000 | Brookfield Corp                          | 5.758.934   |
| 59.000  | RTX Corp                                 | 5.523.119   |
| 198.000 | Graphic Packaging Holding Co             | 5.297.535   |
| 22.500  | Becton Dickinson & Co                    | 5.253.537   |
| 27.500  | JPMorgan Chase & Co                      | 5.229.515   |
| 77.000  | Charles Schwab Corp                      | 5.115.636   |
| 140.000 | Simply Good Foods Co                     | 4.787.343   |
| 12.500  | Deere & Co                               | 4.649.232   |
| 25.400  | Amazon.com Inc                           | 4.416.999   |
| 40.000  | Walt Disney Co                           | 4.301.184   |
| 24.000  | T-Mobile US Inc                          | 4.281.948   |
| 115.000 | CSX Corp                                 | 4.102.874   |
| 16.300  | Chubb Ltd                                | 4.089.223   |
| 14.000  | Eagle Materials Inc                      | 3.629.196   |
| 22.000  | Westinghouse Air Brake Technologies Corp | 3.627.326   |
| 150.500 | Brookfield Renewable Corp Class A        | 3.368.259   |
| 245.000 | Vestis Corp                              | 3.228.380   |
| 58.500  | US Foods Holding Corp                    | 3.075.564   |
| 32.000  | TransUnion                               | 2.971.990   |
| 16.000  | Apple Inc                                | 2.920.134   |
| 88.000  | Aramark                                  | 2.855.450   |
| 35.500  | BJ's Wholesale Club Holdings Inc         | 2.672.014   |
| 10.000  | Nordson Corp                             | 2.579.073   |
| 25.000  | NIKE Inc Class B                         | 2.520.117   |
| 9.400   | WD-40 Co                                 | 2.509.228   |
| 22.500  | TJX Cos Inc                              | 2.260.134   |
| 5.500   | Microsoft Corp                           | 2.246.295   |
| 28.400  | Mondelez International Inc Class A       | 2.063.698   |
| 70.000  | Pfizer Inc                               | 1.967.639   |
| 8.800   | Lowe's Cos Inc                           | 1.955.179   |
| 5.700   | McDonald's Corp                          | 1.691.073   |
| 26.200  | Ball Corp                                | 1.655.488   |

## US Real Estate Securities – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung                 | Kosten US\$ |
|---------|---------------------------------------|-------------|
| 106.784 | AvalonBay Communities Inc             | 19.836.672  |
| 166.783 | Camden Property Trust                 | 16.310.640  |
| 121.030 | Prologis Inc                          | 15.124.765  |
| 323.677 | UDR Inc                               | 12.223.496  |
| 77.118  | Digital Realty Trust Inc              | 11.098.879  |
| 220.188 | Gaming & Leisure Properties Inc       | 10.359.858  |
| 35.877  | Marriott International Inc Class A    | 10.078.327  |
| 96.171  | Federal Realty Investment Trust       | 9.991.858   |
| 338.551 | Essential Properties Realty Trust Inc | 9.941.634   |
| 12.447  | Equinix Inc                           | 9.916.846   |
| 283.359 | Invitation Homes Inc                  | 9.686.968   |
| 72.396  | Sun Communities Inc                   | 9.270.786   |
| 163.986 | Ventas Inc                            | 8.603.228   |
| 204.772 | American Homes 4 Rent Class A         | 7.678.522   |
| 203.389 | Kilroy Realty Corp                    | 7.508.108   |
| 34.629  | SBA Communications Corp Class A       | 7.428.635   |
| 468.346 | Macerich Co                           | 7.405.496   |
| 558.038 | American Healthcare REIT Inc          | 7.028.706   |
| 30.393  | American Tower Corp                   | 6.476.773   |
| 84.669  | BXP Inc                               | 6.068.532   |
| 50.437  | Crown Castle Inc                      | 5.831.566   |
| 133.006 | Brookfield Corp                       | 5.462.690   |
| 55.449  | Iron Mountain Inc                     | 5.105.415   |
| 198.904 | Kimco Realty Corp                     | 4.872.948   |
| 82.152  | Rexford Industrial Realty Inc         | 3.986.113   |
| 114.533 | Omega Healthcare Investors Inc        | 3.717.008   |
| 10.909  | Public Storage                        | 3.587.593   |
| 157.159 | FrontView REIT Inc                    | 2.985.609   |
| 23.884  | Welltower Inc                         | 2.868.627   |
| 17.256  | Simon Property Group Inc              | 2.826.978   |

## US Real Estate Securities – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung               | Erlöse US\$ |
|---------|-------------------------------------|-------------|
| 83.456  | Public Storage                      | 26.671.974  |
| 22.481  | Equinix Inc                         | 18.891.425  |
| 90.827  | American Tower Corp                 | 18.633.251  |
| 163.974 | Crown Castle Inc                    | 17.500.952  |
| 444.724 | Apartment Income REIT Corp          | 16.865.915  |
| 62.292  | Essex Property Trust Inc            | 14.699.095  |
| 88.981  | Extra Space Storage Inc             | 13.503.298  |
| 436.707 | VICI Properties Inc Class A         | 12.896.269  |
| 60.506  | AvalonBay Communities Inc           | 12.621.081  |
| 106.212 | Prologis Inc                        | 12.395.239  |
| 54.070  | SBA Communications Corp Class A     | 12.001.830  |
| 102.961 | Camden Property Trust               | 11.848.313  |
| 107.614 | Iron Mountain Inc                   | 10.898.399  |
| 97.530  | Welltower Inc                       | 10.664.084  |
| 167.497 | Equity Residential                  | 10.031.471  |
| 177.070 | Realty Income Corp                  | 9.965.487   |
| 54.496  | Simon Property Group Inc            | 8.491.374   |
| 415.735 | Kimco Realty Corp                   | 8.096.682   |
| 389.237 | American Healthcare REIT Inc        | 7.381.649   |
| 133.725 | Ventas Inc                          | 6.939.441   |
| 421.727 | Retail Opportunity Investments Corp | 6.681.982   |
| 100.881 | BXP Inc                             | 6.516.556   |
| 202.611 | Weyerhaeuser Co                     | 6.350.615   |
| 133.006 | Brookfield Corp                     | 6.304.289   |
| 156.442 | Invitation Homes Inc                | 5.381.509   |
| 43.098  | Sun Communities Inc                 | 5.377.005   |
| 327.567 | Urban Edge Properties               | 5.372.491   |
| 87.677  | Regency Centers Corp                | 5.232.640   |
| 140.360 | American Homes 4 Rent Class A       | 5.007.305   |
| 123.097 | Omega Healthcare Investors Inc      | 3.967.065   |
| 22.481  | Gaming & Leisure Properties Inc     | 3.651.287   |

## US Small Cap – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung               | Kosten US\$ |
|---------|-------------------------------------|-------------|
| 377.203 | CNX Resources Corp                  | 10.494.707  |
| 73.138  | Arcosa Inc                          | 7.263.126   |
| 38.450  | Simpson Manufacturing Co Inc        | 7.042.754   |
| 50.216  | Armstrong World Industries Inc      | 6.794.493   |
| 56.203  | Kirby Corp                          | 6.733.173   |
| 31.122  | Installed Building Products Inc     | 6.693.223   |
| 79.645  | Haemonetics Corp                    | 6.676.343   |
| 112.020 | Tetra Tech Inc                      | 6.325.360   |
| 57.011  | MKS Instruments Inc                 | 6.291.031   |
| 68.342  | Federal Signal Corp                 | 6.044.200   |
| 78.947  | Prosperity Bancshares Inc           | 6.027.374   |
| 18.203  | Valmont Industries Inc              | 5.836.282   |
| 70.433  | American States Water Co            | 5.798.545   |
| 85.236  | Power Integrations Inc              | 5.702.491   |
| 53.487  | IDACORP Inc                         | 5.590.640   |
| 255.834 | Gates Industrial Corp Plc           | 5.514.580   |
| 28.686  | SPS Commerce Inc                    | 5.476.876   |
| 9.623   | Chemed Corp                         | 5.428.163   |
| 17.190  | RBC Bearings Inc                    | 5.367.609   |
| 28.850  | FirstService Corp                   | 5.322.478   |
| 28.082  | Texas Roadhouse Inc Class A         | 5.193.327   |
| 76.727  | Community Financial System Inc      | 5.051.138   |
| 30.176  | Enpro Inc                           | 5.004.400   |
| 38.842  | Chesapeake Utilities Corp           | 4.844.159   |
| 17.099  | Eagle Materials Inc                 | 4.837.602   |
| 2.615   | White Mountains Insurance Group Ltd | 4.786.186   |
| 43.643  | Rogers Corp                         | 4.769.437   |
| 19.131  | Littelfuse Inc                      | 4.746.388   |
| 80.381  | Tidewater Inc                       | 4.685.824   |
| 87.116  | Lattice Semiconductor Corp          | 4.651.213   |
| 28.812  | CommVault Systems Inc               | 4.614.940   |
| 33.898  | Cullen/Frost Bankers Inc            | 4.532.906   |
| 61.018  | Bio-Techne Corp                     | 4.509.443   |
| 113.718 | Enerpac Tool Group Corp Class A     | 4.431.056   |
| 15.789  | Manhattan Associates Inc            | 4.379.882   |
| 25.855  | Nexstar Media Group Inc Class A     | 4.357.932   |
| 22.491  | Standex International Corp          | 4.224.177   |
| 16.621  | Asbury Automotive Group Inc         | 4.187.619   |
| 2.143   | Fair Isaac Corp                     | 4.185.755   |
| 34.639  | ESAB Corp                           | 4.121.990   |
| 8.040   | Watsco Inc                          | 4.102.980   |
| 93.582  | Viper Energy Inc Class A            | 4.026.687   |

## US Small Cap – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung       | Erlöse US\$ |
|---------|-----------------------------|-------------|
| 7.668   | Fair Isaac Corp             | 11.696.189  |
| 36.725  | Aspen Technology Inc        | 8.905.542   |
| 22.735  | CSW Industrials Inc         | 6.496.263   |
| 761.145 | Southwestern Energy Co      | 5.560.077   |
| 19.298  | Eagle Materials Inc         | 5.147.533   |
| 20.402  | UFP Technologies Inc        | 5.133.842   |
| 12.638  | Pool Corp                   | 4.792.487   |
| 23.843  | FTI Consulting Inc          | 4.733.648   |
| 148.067 | Model N Inc                 | 4.346.512   |
| 18.761  | Asbury Automotive Group Inc | 4.190.574   |
| 71.344  | Matador Resources Co        | 3.915.306   |
| 33.673  | LCI Industries              | 3.783.922   |
| 26.882  | Qualys Inc                  | 3.775.587   |
| 8.277   | Atrion Corp                 | 3.735.809   |
| 14.738  | Manhattan Associates Inc    | 3.706.392   |
| 14.919  | Nordson Corp                | 3.539.201   |
| 94.187  | Fox Factory Holding Corp    | 3.396.544   |
| 45.525  | Bank of Hawaii Corp         | 3.207.499   |
| 17.440  | Quaker Chemical Corp        | 3.178.569   |
| 44.386  | CBIZ Inc                    | 3.175.813   |
| 9.810   | Kadant Inc                  | 3.118.557   |
| 32.411  | Tidewater Inc               | 2.839.990   |
| 79.284  | Simply Good Foods Co        | 2.786.095   |
| 64.082  | Simulations Plus Inc        | 2.562.501   |
| 6.837   | Cable One Inc               | 2.518.823   |
| 11.355  | MarketAxess Holdings Inc    | 2.478.748   |
| 537.692 | Transocean Ltd              | 2.402.737   |
| 2.157   | Texas Pacific Land Corp     | 2.138.233   |
| 7.525   | RBC Bearings Inc            | 2.109.445   |
| 16.661  | SPX Technologies Inc        | 2.054.794   |
| 87.067  | NetScout Systems Inc        | 1.882.754   |

## US Small Cap Intrinsic Value – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung             | Kosten US\$ |
|---------|-----------------------------------|-------------|
| 70.202  | Ormat Technologies Inc            | 4.886.890   |
| 266.610 | Wolfspeed Inc                     | 4.761.341   |
| 220.387 | International Game Technology Plc | 4.577.254   |
| 329.128 | Viasat Inc                        | 4.369.902   |
| 450.881 | Alight Inc Class A                | 3.519.820   |
| 40.729  | IPG Photonics Corp                | 3.342.648   |
| 74.155  | New Jersey Resources Corp         | 3.277.812   |
| 73.765  | Portland General Electric Co      | 3.229.661   |
| 62.645  | Northwestern Energy Group Inc     | 3.223.354   |
| 26.070  | Atmos Energy Corp                 | 3.187.196   |
| 213.489 | Banc of California Inc            | 3.116.071   |
| 225.619 | Huntington Bancshares Inc         | 2.981.046   |
| 234.239 | UiPath Inc Class A                | 2.925.846   |
| 26.602  | Whirlpool Corp                    | 2.720.055   |
| 63.204  | Criteo SA ADR                     | 2.610.247   |
| 127.492 | Resideo Technologies Inc          | 2.550.015   |
| 31.197  | Haemonetics Corp                  | 2.448.557   |
| 71.127  | Veeco Instruments Inc             | 2.430.201   |
| 44.925  | Acadia Healthcare Co Inc          | 2.252.997   |
| 34.788  | KBR Inc                           | 2.232.892   |
| 127.611 | OPENLANE Inc                      | 2.177.821   |
| 83.314  | Kyndryl Holdings Inc              | 2.157.118   |
| 48.719  | Helios Technologies Inc           | 2.132.325   |
| 426.892 | indie Semiconductor Inc Class A   | 2.031.408   |
| 33.813  | Ciena Corp                        | 1.992.197   |
| 29.348  | CONMED Corp                       | 1.973.502   |
| 28.567  | ALLETE Inc                        | 1.745.480   |
| 8.031   | Avery Dennison Corp               | 1.710.350   |
| 54.961  | Mercury Systems Inc               | 1.689.072   |
| 41.430  | TreeHouse Foods Inc               | 1.664.685   |
| 17.312  | AerCap Holdings NV                | 1.633.587   |
| 433.049 | TETRA Technologies Inc            | 1.603.879   |
| 50.567  | TechnipFMC Plc                    | 1.397.994   |
| 163.117 | Stratasys Ltd                     | 1.293.052   |

## US Small Cap Intrinsic Value – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

| Anteile | Wertpapierbezeichnung                   | Erlöse US\$ |
|---------|---|-------------|
| 141.170 | Vistra Corp                             | 15.642.643  |
| 76.859  | Crown Holdings Inc                      | 5.949.769   |
| 100.421 | Stericycle Inc                          | 5.788.313   |
| 47.446  | MACOM Technology Solutions Holdings Inc | 4.888.259   |
| 31.784  | Ciena Corp                              | 2.858.313   |
| 74.640  | Enerpac Tool Group Corp Class A         | 2.620.514   |
| 24.833  | Itron Inc                               | 2.275.591   |
| 30.615  | Coherent Corp                           | 2.273.170   |
| 48.761  | Comerica Inc                            | 2.256.592   |
| 82.926  | BankUnited Inc                          | 2.221.314   |
| 47.235  | Semtech Corp                            | 1.975.841   |
| 24.038  | Rambus Inc                              | 1.565.555   |
| 3.823   | Molina Healthcare Inc                   | 1.418.842   |
| 213.569 | Infinera Corp                           | 1.301.126   |
| 202.599 | Oil States International Inc            | 1.151.558   |
| 23.662  | Varonis Systems Inc Class B             | 1.028.117   |
| 6.829   | Entegris Inc                            | 887.869     |
| 87.552  | RLJ Lodging Trust                       | 876.085     |
| 4.744   | Wix.com Ltd                             | 826.429     |
| 86.537  | Chatham Lodging Trust                   | 735.931     |
| 35.034  | Quantum Corp                            | 701.019     |

# ANMERKUNGEN ZUM GEPRÜFTEN JAHRESABSCHLUSS

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

### 1. WESENTLICHE BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE

Die wesentlichen vom Fonds angewandten Bilanzierungsgrundsätze sind im Folgenden beschrieben:

#### Grundlage für die Aufstellung des Abschlusses

Der Jahresabschluss wurde in Übereinstimmung mit dem Financial Reporting Standard („FRS“) 102: „The financial reporting standard applicable in the UK and Republic of Ireland“ erstellt. Die in Irland allgemein anerkannten Bilanzierungsgrundsätze für die Erstellung von Abschlüssen, die ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild vermitteln, sind diejenigen, die von Chartered Accountants Irland veröffentlicht und vom Financial Reporting Council („FRC“) herausgegeben worden sind. Der Jahresabschluss wird ebenfalls in Übereinstimmung mit dem irischen Recht in Gestalt des Companies Act 2014 (in seiner geltenden Fassung) sowie den EG-Richtlinien über Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren („European Communities (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations, 2011“) (in ihrer geltenden Fassung) und dem Central Bank (Supervision and Enforcement) Act 2013 (Section 48(1)) (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2019 (die „OGAW-Vorschriften der Zentralbank“) erstellt.

Der Abschluss wird nach dem Anschaffungskostenprinzip erstellt, berichtigt um die erfolgswirksame Neubewertung finanzieller Vermögenswerte und finanzieller Verbindlichkeiten zum beizulegenden Zeitwert. Bewertungszeitpunkt ist Marktschluss am jeweiligen Handelstag. Der Handelstag ist jeder Geschäftstag oder sonstige Tag, den die Direktoren festlegen und der Verwaltungsstelle und den Anteilhabern im Voraus mitteilen. Das Direktorium hat die Fähigkeit des Fonds zur weiteren Unternehmensfortführung bewertet und hat sich vergewissert, dass der Fonds über die Ressourcen verfügt, um seine Geschäfte auf absehbare Zeit und für mindestens zwölf Monate ab dem Datum der Genehmigung dieses Abschlusses fortzuführen. Ferner sind den Direktoren keine wesentlichen Unsicherheiten bekannt, die erhebliche Zweifel an der Fähigkeit des Fonds zur Unternehmensfortführung wecken könnten. Der Abschluss wird daher auf der Grundlage der Unternehmensfortführung aufgestellt.

Das Format und bestimmte Passagen des Wortlauts des Abschlusses weichen in bestimmten Punkten von den im Companies Act von 2014 (in ihrer geltenden Fassung) und FRS 102 enthaltenen ab, so dass sie nach Auffassung der Direktoren den Charakter des Geschäfts des Fonds als Investmentfonds besser widerspiegeln. Der Fonds erfüllt die entsprechenden Kriterien, um von der für bestimmte offene Investmentgesellschaften nach FRS 102 und US GAAP möglichen Befreiung von der Erstellung einer Kapitalflussrechnung Gebrauch zu machen.

Die Aufstellung des Abschlusses in Übereinstimmung mit FRS 102 erfordert die Verwendung bestimmter kritischer Schätzungen bei der Rechnungslegung. Außerdem müssen die Direktoren bei der Anwendung der Bilanzierungsgrundsätze des Fonds ihr Ermessen ausüben. Die Bereiche, die ein höheres Maß an Ermessensspielraum oder Komplexität erfordern, oder solche Bereiche, in denen Annahmen und Schätzungen für den Abschluss bedeutungsvoll sind, wie die Besteuerung oder die Annahme der Unternehmensfortführung, werden in den folgenden Anmerkungen offengelegt. Angaben zu Unsicherheiten bei Annahmen und Schätzungen mit einem erheblichen Risiko daraus resultierender wesentlicher Berichtigungen der Buchwerte von Vermögenswerten und Verbindlichkeiten im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024 und 31. Dezember 2023 sind in Anmerkung 12 enthalten und beziehen sich auf die Bestimmung des beizulegenden Zeitwerts anhand maßgeblicher nicht beobachtbarer Parameter.

#### Finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

##### (i) Klassifizierung

Der Fonds wendet die Bestimmungen zu Ausweis und Bewertung des Internationalen Rechnungslegungsstandards 9: „Financial Instruments“ („IFRS 9“) sowie die die Offenlegungs- und Darstellungspflichten des FRS 102 auf alle Finanzinstrumente an. Gemäß IFRS 9 klassifiziert der Fonds finanzielle Vermögenswerte beim erstmaligen Ansatz als zu fortgeschriebenen Anschaffungskosten oder erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet. Ein finanzieller Vermögenswert wird zu fortgeschriebenen Anschaffungskosten bewertet, wenn er beide der folgenden Bedingungen erfüllt und nicht als erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet eingestuft ist: (a) er wird im Rahmen eines Geschäftsmodells gehalten, dessen Ziel das Halten von Vermögenswerten zur Inanspruchnahme von Einnahmen ist; und (b) seine Vertragsbedingungen führen zu festgelegten Zeitpunkten zu Einnahmen, die ausschließlich Tilgung und Zinszahlungen sind (Solely payments of principal and interest, „SPPI“). Alle anderen finanziellen Vermögenswerte der Portfolios werden erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet. Der Fonds hat seine Anlagen als erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert zu bewertende finanzielle Vermögenswerte bzw. finanzielle Verbindlichkeiten klassifiziert. Sämtliche Derivate, die Nettoforderungen darstellen (positiver beizulegender Zeitwert), werden unter erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten ausgewiesen. Sämtliche Derivate, die Nettoverbindlichkeiten darstellen (negativer beizulegender Zeitwert), werden unter erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten ausgewiesen.

Finanzielle Vermögenswerte, die nicht erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet werden, sind unter anderem bestimmte Beträge von Brokern und Verbindlichkeiten, die zu den fortgeschriebenen Anschaffungskosten bewertet werden.

Finanzielle Verbindlichkeiten, die nicht erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet werden, sind unter anderem bestimmte an Broker zahlbare Beträge und Verbindlichkeiten, die zu den fortgeschriebenen Anschaffungskosten bewertet werden.

##### (ii) Erstbewertung

Käufe und Verkäufe von Finanzinstrumenten werden in den Abschlüssen zum Handelsdatum verbucht. Realisierte Gewinne und Verluste aus Veräußerungen von Finanzinstrumenten werden anhand der „First in/First out“-Methode berechnet. Die Erstbewertung von Finanzinstrumenten, die als erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert zu bewertende finanzielle Vermögenswerte kategorisiert sind, erfolgt zum beizulegenden Zeitwert, und die Transaktionskosten für solche Wertpapiere werden direkt in der Gewinn- und Verlustrechnung erfasst.

**FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR**

**1. WESENTLICHE BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE (FORTSETZUNG)**

**Finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)**

(iii) Folgebewertung

Nach der Erstbewertung bewertet der Fonds Finanzinstrumente, die als erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert zu bewertende finanzielle Vermögenswerte klassifiziert sind, zu ihren beizulegenden Zeitwerten. Der Zeitwert ist der Betrag, für den ein Vermögenswert in einer Transaktion zu Marktbedingungen zwischen sachverständigen, vertragswilligen Parteien getauscht oder eine Verbindlichkeit beglichen werden könnte. Der beizulegende Zeitwert von Finanzinstrumenten basiert auf deren an einer anerkannten Börse notierten offiziellen Marktpreisen oder wird im Fall nicht börsennotierter Instrumente von einem angesehenen Broker/einer angesehenen Gegenpartei bezogen, jeweils zum Bilanzstichtag und ohne Abzug für geschätzte zukünftige Verkaufskosten. Gemäß IFRS 9 werden die Wertpapiere und sonstigen Vermögenswerte der Gesellschaft zum letzten Marktkurs per 31. Dezember 2024 und 2023 bewertet, um das den Inhabern rückzahlbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen („Nettovermögen“) zu bestimmen.

Die Direktoren können jedoch den Wert von finanziellen Vermögenswerten anpassen, wenn sie dies für erforderlich erachten, um deren marktgerechten Wert besser widerzuspiegeln. Ist kein an einer anerkannten Börse notierter offizieller Marktpreis und kein Preis von einem Broker/einer Gegenpartei verfügbar, so wird der wahrscheinliche Realisationswert mit Sorgfalt und in gutem Glauben gemäß der Bewertungspolitik des Fonds berechnet. Dieser wahrscheinliche Realisationswert kann von der Verwaltungsstelle anhand von Bewertungsmethoden ermittelt werden, u. a. unter Zugrundelegung marktüblicher Transaktionen, Bezugnahme auf den aktuellen beizulegenden Zeitwert eines anderen Instruments, das im Wesentlichen gleich ist, Anwendung von Discounted-Cashflow-Analysen, Preisbildungsmodellen für Optionsscheine und jeder anderen Bewertungsmethode, die eine verlässliche Preisschätzung unter Annahme der gegenwärtigen Markttransaktionen ergibt. Weitere Einzelheiten zu den Bewertungsgrundsätzen für alle Wertpapierarten finden Sie im Abschnitt „Beizulegender Zeitwert von Anlagen“ in Anmerkung 12. Anschließend Änderungen im Zeitwert der Kategorie erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert zu bewertende Finanzinstrumente werden in der Gewinn- und Verlustrechnung erfasst.

(iv) Ausbuchung finanzieller Vermögenswerte und Verbindlichkeiten

Der Fonds bucht einen finanziellen Vermögenswert aus, wenn die vertraglichen Ansprüche auf Einnahmen aus dem Vermögenswert erloschen sind oder wenn die Vermögenswerte übertragen werden und diese Übertragung eine Ausbuchung gemäß IFRS 9 begründet. Der Fonds bucht eine finanzielle Verbindlichkeit aus, wenn er von den entsprechenden vertraglichen Verpflichtungen befreit ist bzw. wenn diese erloschen oder abgelaufen sind.

**Immobilienaktiengesellschaften**

Anteile an Immobilienaktiengesellschaften, die an einem geregelten Markt notiert oder gehandelt werden, werden zum letzten notierten Handelskurs oder Mittelkurs bewertet oder, sofern diese nicht erhältlich oder repräsentativ sind, zum letzten verfügbaren, für den Organismus für gemeinsame Anlagen relevant erscheinenden Nettoinventarwert („NIW“).

**Investmentfonds**

Der beizulegende Zeitwert einer Anlage, bei der es sich um einen Anteil oder eine Beteiligung an einem Investmentfonds handelt, ist der letzte verfügbare NIW dieses Anteils bzw. dieser Beteiligung.

**Mittelfristige Schuldverschreibungen**

Bestimmte Portfolios können in direkte Schuldtitel investieren, bei denen es sich um Anteile an Beträgen handelt, die von Unternehmen, staatlichen Stellen oder anderen Kreditnehmern an Kreditgeber oder Kreditsyndikate geschuldet werden. Die Anlagen eines Portfolios in Kredite können in Form von Beteiligungen an Krediten oder Abtretungen aller oder eines Teils der Kredite von Dritten („Bankkredite“) erfolgen. Ein Bankkredit wird häufig von einer Bank oder einem anderen Finanzinstitut (dem „Kreditgeber“) verwaltet, das als Agent für alle Inhaber fungiert. Der Agent verwaltet die Bedingungen des Kredits, wie im Kreditvertrag festgelegt. Bei der Anlage in eine Kreditbeteiligung hat ein Portfolio das Recht, Kapitalzahlungen, Zinsen und etwaige Gebühren, auf die es Anspruch hat, lediglich von dem Kreditgeber zu erhalten, der den Kreditvertrag verkauft, und nur bei Eingang von Zahlungen des Kreditnehmers beim Kreditgeber. Allgemein hat ein Portfolio kein Recht, die Einhaltung der Bedingungen des Kreditvertrags mit dem Kreditnehmer durchzusetzen. Infolgedessen kann ein Portfolio dem Kreditrisiko durch sowohl den Kreditnehmer als auch durch den Kreditgeber, der den Kreditvertrag verkauft, ausgesetzt sein. Wenn ein Portfolio Abtretungen von Kreditgebern erwirbt, erwirbt es direkte Rechte gegenüber dem Kreditnehmer des Kredits.

Das Portfolio kann beim Handel mit Abtretungen und Beteiligungen an Dritte Schwierigkeiten haben. Es kann Beschränkungen für Übertragungen geben und es können nur begrenzte Möglichkeiten bestehen, solche Wertpapiere auf Sekundärmärkten zu verkaufen. Infolgedessen ist das Portfolio möglicherweise nicht in der Lage, Abtretungen oder Beteiligungen zum gewünschten Zeitpunkt zu verkaufen oder muss zu einem Preis unter dem beizulegenden Zeitwert verkaufen.

Das Portfolio kann einen Kreditvertrag über einen bestimmten zugesagten Betrag abschließen, doch wird dieser unter Umständen nicht in voller Höhe vom Kreditnehmer in Anspruch genommen. Diese nicht finanzierten Zusagen stellen die verbleibende Verpflichtung des Portfolios gegenüber dem Kreditnehmer dar. Der Kreditnehmer kann zu jedem Zeitpunkt bis zum Fälligkeitsdatum der Emission den nicht finanzierten Teil einfordern. Der beizulegende Zeitwert dieser ungedeckten Kreditzusagen ist in der Bilanz unter „Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen“ enthalten.

**Participatory Notes**

Die Portfolios können in Participatory Notes investieren. Participatory Notes, die voll eingezahlt sind und einen Ausübungskurs von null haben, weisen die gleichen Risiko/Rendite-Charakteristika auf, die im Falle eines direkten Kaufs der zugrunde liegenden Aktien vorliegen würden.

**FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR****1. WESENTLICHE BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE (FORTSETZUNG)****Forderungsbesicherte Wertpapiere und Mortgage-Backed Securities**

Zu den Parametern, die dazu verwendet werden, forderungsbesicherte Wertpapiere und Mortgage-Backed Securities zu bewerten, gehören im Allgemeinen Modelle, die eine Reihe an Faktoren berücksichtigen. Hierzu können folgende Punkte gehören: vorzeitige Rückzahlungen, Cashflows, Spreadanpassungen und andere Marktinformationen wie zum Beispiel Benchmarkrenditen, gemeldete Trades, Broker-Dealer-Quotierungen, Emittentenspreads, Benchmarkwertpapiere, Gebote, Angebote und Referenzdaten wie zum Beispiel falls verfügbar Veröffentlichungen im Bereich der Marktforschung.

**TBA-Wertpapiere**

Die Portfolios dürfen TBA-Kaufverpflichtungen eingehen, um Wertpapiere zu einem festen Preis und zu einem über den Abrechnungszeitpunkt hinausgehenden Termin zu kaufen. Obwohl der Stückpreis festgelegt worden ist, wurde der Nominalwert noch nicht bestimmt. Bis zum Abrechnungstermin hält und verwaltet das Portfolio in Höhe des Kaufpreises der TBA-Kaufverpflichtung ausreichende Geldmittel oder erstklassige Schuldtitel. Das Portfolio kann auch andere in seinem Besitz befindlichen Wertpapiere für eine Vereinbarung zur Glattstellung der Position verwenden. Erträge aus den Wertpapieren werden erst zum Abrechnungstermin realisiert. Offene TBA-Kaufverpflichtungen wurden mit dem aktuellen Marktwert bewertet.

Die Portfolios dürfen TBA-Verkaufverpflichtungen eingehen, um ihre Portfoliositionen abzusichern oder um hypothekebesicherte Wertpapiere zu verkaufen, die verzögerten Erfüllungsvereinbarungen (Delayed Delivery) unterliegen. Erlöse aus den TBA-Verkaufverpflichtungen gelten erst zum vertraglichen Abrechnungstermin als realisiert. Solange eine TBA-Verkaufverpflichtung nicht abgerechnet ist, hat das Portfolio ein gleichwertig erfüllbares Wertpapier oder eine glattstellende TBA-Abnahmeverpflichtung, die am oder vor dem Verkaufsverpflichtungstermin zu erfüllen ist, zur „Deckung“ der Verkaufsverpflichtung zu halten. Offene TBA-Kaufverpflichtungen werden gemäß dem in den Bilanzierungsgrundsätzen beschriebenen Verfahren zum aktuellen Marktwert bewertet.

**Bedingte Pflichtwandelanleihen**

Bedingte Pflichtwandelanleihen (Contingent Convertible Securities, kurz „CoCos“) sind eine Gattung hybrider Wertpapiere, deren Nennwert bei Eintritt bestimmter Auslöser entweder in Eigenkapital umgewandelt oder abgeschrieben wird. Die Auslöser stehen generell in Zusammenhang mit aufsichtsbehördlich vorgegebenen Kapitalquoten oder aufsichtsbehördlichen Maßnahmen, die die weitere Fähigkeit des Emittenten zur Unternehmensfortführung infrage stellen. Die einzigartigen Merkmale von CoCos zur Umwandlung in Eigenkapital oder die Abschreibung sind auf den Emittenten und dessen aufsichtsbehördliche Auflagen zugeschnitten. In aller Regel werden CoCos als nachrangige Schuldtitel begeben, um vor einer Umwandlung die entsprechende Eigenkapitalunterlegung sicherzustellen. Ferner haben CoCos nicht unbedingt eine festgesetzte Laufzeit und können absolut ermessensfreie Kupons aufweisen, die nach Ermessen des Emittenten gestrichen oder von der zuständigen Aufsichtsbehörde untersagt werden können, um dem Emittenten zu ermöglichen, Verluste zu absorbieren.

**Devisenterminkontrakte**

Ein Devisenterminkontrakt ist eine Vereinbarung zwischen zwei Parteien, eine Währung an einem zukünftigen Datum zu einem festgelegten Preis zu kaufen und zu verkaufen. Der Marktwert eines Devisenterminkontrakts schwankt mit den Devisenterminkursen. Devisenterminkontrakte werden täglich zum Marktwert bewertet, und die Wertveränderung wird vom Portfolio als nicht realisierter Gewinn oder Verlust ausgewiesen. Realisierte Gewinne oder Verluste in Höhe der Differenz zwischen dem Wert des Kontrakts zum Zeitpunkt seines Abschlusses und dem Wert zum Glattstellungszeitpunkt werden nach Lieferung bzw. Entgegennahme der Währung oder, wenn ein Devisenterminkontrakt durch Eingehen eines neuen Devisenterminkontrakts mit demselben Makler glattgestellt wird, nach Abrechnung des Nettogewinns bzw. -verlusts verbucht.

**Futures-Kontrakte**

Futures-Kontrakte können bestimmte Optionen auf börsengehandelte Futures-Kontrakte enthalten. Anfängliche Einschüsse werden beim Eingehen der Futures-Kontrakte getätigt und erfolgen im Allgemeinen in Barmitteln oder Barmitteläquivalenten. Der beizulegende Zeitwert von Futures-Kontrakten basiert auf ihren täglich notierten Abrechnungspreisen. Veränderungen im Wert offener Futures-Kontrakte werden als nicht realisierte Gewinne oder Verluste aus Futures-Kontrakten bis zur Glattstellung der Kontrakte ausgewiesen, danach erfolgt der Ausweis realisierter Gewinne und Verluste. Gewinne bzw. Verluste aus offenen Futures-Kontrakten werden in der Aufstellung des Wertpapierbestands des jeweiligen Portfolios aufgeführt und in der Bilanz jeweils unter den erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten bzw. Verbindlichkeiten ausgewiesen.

**Swap-Kontrakte**

Ein Swap-Kontrakt ist eine außerbörsliche Vereinbarung zwischen einem Portfolio und einer Gegenpartei, die Rendite eines Instruments gegen die Rendite eines anderen Instruments zu tauschen. Manche Swap-Kontrakte werden netto abgewickelt. Beim Eingehen eines Swap-Kontrakts im Freiverkehr („OTC-Kontrakt“) und während der Laufzeit der Transaktion kann das Portfolio und/oder der Swap-Kontrahent gemäß den Bestimmungen der jeweiligen Swap-Vereinbarungen Bargeld oder Wertpapiere als Sicherheiten stellen bzw. entgegennehmen, damit für den Fall eines Zahlungsausfalls oder eines Konkurses/einer Insolvenz werthaltige Vermögenswerte und Rückgriffsmöglichkeiten bereitstehen. Einige Clearingstellen bieten die Abwicklung von eingeschränkten Arten von Swaps. Bei einer abgewickelten Swap-Transaktion geht ein Portfolio die Transaktion in der Regel mit einem Finanzinstitut als Gegenpartei ein, die dann durch eine zentrale Clearingstelle abgewickelt wird. Nach Annahme eines Swaps durch eine zentrale Clearingstelle erlischt der Swap und wird durch einen Swap mit der Clearingstelle ersetzt, dadurch wird das Kreditrisiko des Portfolios gegenüber der ursprünglichen Gegenpartei reduziert oder eliminiert.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

### 1. WESENTLICHE BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE (FORTSETZUNG)

#### Swap-Kontrakte (Fortsetzung)

Ein Portfolio muss in der Regel eine bestimmte Höhe einer Einschuss- und Nachschussmarge bei der Clearingstelle oder nach Weisung der Clearingstelle hinterlegen. Die tägliche Veränderung in der Bewertung wird als Forderung oder Verbindlichkeit für Nachschusszahlungen verbucht und in bar mit der zentralen Clearing-Partei abgewickelt.

#### *Zins-/Inflation-Swaps*

Ein Portfolio kann Zins- oder Inflation-Swaps eingehen. Dabei handelt es sich um Vereinbarungen zwischen zwei Parteien über den Austausch von Zahlungsströmen auf Basis eines fiktiven Kapitalbetrags, mit denen das Zinsrisiko eines Portfolios gesteuert wird. Sowohl bei Zinsswaps als auch bei Inflation-Swaps verpflichtet sich eine Partei, der Swap-Gegenpartei eine festverzinsliche Zahlung zu leisten, während die andere Partei dem Portfolio eine variabel verzinsliche Zahlung leistet. Zinsswap- und Inflation-Swapkontrakte werden täglich zum Marktwert bewertet, in manchen Fällen auf Basis von Notierungen von Kontrahenten und in anderen Fällen auf Basis von Notierungen von Kursanbietern. Die Wertveränderung wird als nicht realisierter Gewinn bzw. Verlust verbucht. Geleistete und vereinnahmte Zahlungen werden als realisierte Gewinne bzw. Verluste ausgewiesen. Einige Zinsswaps können als Forward Starting Swaps betrachtet werden. Abgrenzungen auf Forward Starting Swaps beginnen zu einem zukünftigen Zeitpunkt.

#### *Credit Default Swaps*

Ein Credit Default Swap ist ein bilateraler Finanzkontrakt, bei dem der Absicherungskäufer eine Gebühr zahlt (in der Regel ausgedrückt in Basispunkten p. a. auf den Nennbetrag) und vom Absicherungsverkäufer im Gegenzug dafür eine Zahlung erhält, wenn in Bezug auf einen Referenzemittenten ein bestimmtes Kreditereignis eintritt, wie z. B. ein Konkurs, ein Zahlungsausfall oder eine Restrukturierung. Die Kreditereignisse und Abwicklungsmechanismen, die angewandt werden, um die Ausfallzahlung zu bestimmen, werden zwischen den Kontrahenten zum Zeitpunkt des Vertragsabschlusses ausgehandelt.

Sobald der Eintritt des Kreditereignisses erklärt wird, ist der Absicherungskäufer berechtigt, den Kontrakt abzuwickeln. Die Abwicklung erfolgt in der Regel physisch, wobei der Absicherungskäufer das Recht hat, Anleihen des Referenzemittenten bis zur Höhe des Nominalwertes des Kontrakts zu liefern. Im Gegenzug erhält der Absicherungskäufer den Nennwert dieser Schuldtitel. Absicherungsverkäufe sind das synthetische Äquivalent eines Kaufs einer Anleihe oder anderen Art von Schuldtitel. Absicherungskäufe sind das Äquivalent eines synthetischen Leerverkaufs oder der Absicherung einer Anleihe oder eines anderen Kreditengagements. Bei Credit Default Swaps auf Kreditindizes leistet eine Partei einen Zahlungsstrom zugunsten einer anderen Partei und erwirbt dafür einen Anspruch auf einen bestimmten Ertrag im Falle einer Abschreibung, einer Minderung des Grundkapitals, einer Minderung der Zinsen oder des Zahlungsausfalls aller oder eines Teils der Referenzemittenten, aus denen der Kreditindex besteht. Ein Kreditindex ist eine Auswahl aus einem Korb von Kreditinstrumenten oder Engagements, die als repräsentativ für einen Teil des gesamten Kreditmarktes angesehen wird. Der Index kann unter anderem aus folgenden Komponenten bestehen: Wertpapiere mit Investment-Grade-Rating, hochverzinsliche Wertpapiere, ABS-Anleihen, Schwellenmarktpapiere und/oder verschiedenen Bonitätsratings innerhalb jedes Sektors. Kreditindizes werden gehandelt, indem Credit Default Swaps mit standardisierten Bedingungen, wie z. B. einem festen Spread und standardisierten Fälligkeitsdaten eingesetzt werden. Ein Credit Default Swap auf einen Index bezieht sich auf alle Indexkomponenten, und bei Eintritt eines Zahlungsausfalls wird das Kreditereignis basierend auf der Gewichtung der Indexkomponente beglichen. Die Zusammensetzung der Indizes ändert sich regelmäßig, in der Regel alle sechs Monate, und in den meisten Indizes sind alle Komponenten gleich gewichtet.

Der Einsatz von Credit Default Swaps ist insoweit beschränkt, dass der Nutzen für das Portfolio dem Nutzen entsprechen muss, der durch ein direktes Investment in den Basisinstrumenten erzielt werden könnte, und dass die Swaps ein Portfolio keinen Risiken aussetzen dürfen, die es ansonsten nicht eingehen würde (außer dem Risiko in Bezug auf den Kontrahenten des Credit Default Swap). Die bei Abschluss bei einem Portfolio als Absicherungsverkäufer eingehende Zahlung wird in den Büchern des Portfolios als Verbindlichkeit ausgewiesen. Eine bei Abschluss von einem Portfolio als Absicherungskäufer geleistete Zahlung wird in den Büchern des Portfolios als Vermögenswert ausgewiesen. Bei einem Portfolio eingehende oder von diesem geleistete Zahlungen werden als realisierte Gewinne bzw. Verluste ausgewiesen. Credit Default Swaps werden mit Hilfe eines Pricing-Service-Anbieters bewertet. Ist kein Pricing-Service-Anbieter verfügbar, können Kontrakte täglich zum Marktpreis bewertet werden. Dabei beruht die Bewertung auf Kursnotierungen von Kontrahenten oder auf Berechnungen unter Verwendung von Bewertungsmodellen. Eine etwaige Wertveränderung wird als nicht realisierter Gewinn oder Verlust verbucht. Zahlungen, die infolge eines Kreditereignisses oder der Beendigung des Vertrages eingehen bzw. geleistet werden, werden nach Abzug eines anteiligen Betrags der Vorauszahlung als realisierte Gewinne oder Verluste verbucht.

#### *Total Return Swaps*

Total Return Swaps beinhalten die Verpflichtung zur Zahlung eines festen oder variablen Zinssatzes im Gegenzug für eine marktabhängige Rendite auf Basis eines Nominalwerts. Das Portfolio erhält eine Zahlung oder leistet eine Zahlung an die Gegenpartei in dem Maße, in dem die Gesamrendite des Referenztitels oder -index, der dem Total Return Swap zugrunde liegt, die gegenläufige Zinsverpflichtung über- oder unterschreitet. Der Abschluss von Total Return Swaps kann mit bestimmten Risiken verbunden sein, darunter der Ausfall der Gegenpartei, Illiquidität oder ungünstige Veränderungen des Werts des zugrunde liegenden Referenztitels oder -index. Der Barausgleich in und aus den Swaps kann nach dem Ermessen des Portfoliomanagements und der Gegenpartei während der Laufzeit der Vereinbarung zu einem Reset- oder einem anderen Datum erfolgen und wird im Allgemeinen auf der Grundlage von Grenz- und Schwellenwerten bestimmt, die im Rahmen einer zwischen dem Portfoliomanagement und der Gegenpartei getroffenen Vereinbarung festgelegt werden. Bei Basket-Swaps können die Cashflows, je nach Lokalwährung der Positionen innerhalb der Swaps, auf verschiedene Fremdwährungen lauten.

Etwaige Bewertungsveränderungen werden als nicht realisierte Gewinne bzw. Verluste ausgewiesen. Vereinnahmte und geleistete Zahlungen werden als realisierte Gewinne bzw. Verluste ausgewiesen. Der Fonds legt ausstehende Total Return Swaps am Jahresende in der Aufstellung des Wertpapierbestands offen. Für die am 31. Dezember 2024 und am 31. Dezember 2023 beendeten Geschäftsjahre ist der beizulegende Zeitwert der Total Return Swaps in der Aufstellung des Wertpapierbestands und in der Bilanz als nicht realisierter Nettogewinn oder -verlust ausgewiesen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

### 1. WESENTLICHE BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE (FORTSETZUNG)

#### Swap-Kontrakte (Fortsetzung)

##### *Volatility-Swaps*

Ein Volatility-Swap ist eine Vereinbarung zwischen Gegenparteien über den Austausch regelmäßiger Zahlungen auf Basis der festgestellten Volatilität eines Referenztitels, eines Referenzindex, einer Referenzwährung oder einer anderen Referenzanlage über einen festgelegten Zeitraum. Einer der Cashflows basiert in der Regel auf der realisierten Volatilität der Referenzanlage, festgestellt anhand von Änderungen des Preises oder Kursniveaus dieser Anlage über den festgelegten Zeitraum, während der andere Cashflow auf einem spezifischen Satz basiert, der die zum Zeitpunkt der Ausführung des Swaps erwartete Volatilität der Referenzanlage oder die festgestellte Volatilität einer anderen Referenzanlage über den festgelegten Zeitraum repräsentiert. Der Wertzuwachs oder die Wertminderung eines Volatility-Swap ist in der Regel auf das Ausmaß der Volatilität der Referenzanlage bzw. den Umfang seiner Kursschwankungen während des festgelegten Zeitraums zurückzuführen und nicht auf allgemeine direktionale Kursbewegungen.

Volatility-Swaps sind ihrer Struktur nach weniger standardisiert als andere Arten von Swaps und bieten ein reines bzw. isoliertes Engagement bezogen auf das Volatilitätsrisiko der jeweils zugrunde liegenden Referenzanlage. Für gewöhnlich werden Volatility-Swaps eingesetzt, um auf künftige Schwankungsbreiten zu spekulieren, Transaktionen in Bezug auf den Spread zwischen realisierter und erwarteter Volatilität einzugehen oder das Volatilitätsrisiko der vom Portfolio gehaltenen Anlagen zu mindern.

##### *Variance-Swaps*

Variance-Swap-Kontrakte erstrecken sich auf eine Vereinbarung zwischen zwei Parteien über den Austausch von Zahlungsströmen auf Basis der gemessenen Varianz (d. h. des Quadrats der Volatilität) eines bestimmten Basiswerts. Eine Partei erklärt sich im Rahmen dieser Vereinbarung bereit, einen „festen Zinssatz“ oder eine Zahlung in Bezug auf den Ausübungspreis gegen einen „variablen Zinssatz“ oder eine realisierte Preisvarianz des Basiswerts in Bezug auf den Nominalwert zu tauschen. Bei Vertragsabschluss wird der Ausübungspreis in der Regel so festgelegt, dass der beizulegende Zeitwert des Swaps gleich Null ist. Folglich findet bei Vertragsbeginn keinerlei Zahlungsaustausch statt. Am Fälligkeitstag entspricht der von einer Partei an die andere zu zahlende Betrag der Differenz zwischen der realisierten Preisvarianz des Basiswerts und dem Ausübungspreis, multipliziert mit dem Nominalwert. Ein Empfänger der realisierten Preisvarianz hätte Anspruch auf eine Zahlung, wenn die realisierte Preisvarianz des Basiswerts über dem Ausübungspreis liegt, und wäre zu einer Zahlung verpflichtet, wenn die Preisvarianz unter dem Ausübungspreis liegt. Ein Zahler der realisierten Preisvarianz wäre zu einer Zahlung verpflichtet, wenn die realisierte Preisvarianz des Basiswerts über dem Ausübungspreis liegt, und hätte Anspruch auf eine Zahlung, wenn die Preisvarianz unter dem Ausübungspreis liegt. Bei dieser Art von Vereinbarung handelt es sich im Grunde genommen um einen Terminkontrakt auf die künftige realisierte Preisvarianz des Basiswerts.

##### *Correlation-Swaps*

Ein Correlation-Swap ist ein Kontrakt, bei dem der Optionskäufer die Differenz zwischen der beobachteten Korrelation und der Korrelation zum Ausübungszeitpunkt eines Korbs von Vermögenswerten erhält, dessen Entwicklung über einen bestimmten Zeitraum beobachtet wird. Der Correlation-Swap kann als Terminkontrakt auf die realisierte Korrelation gesehen werden. Sein Auszahlungsprofil besteht einfach in der Differenz zwischen der realisierten Korrelation über den angegebenen Zeitraum und der Korrelation zum Ausübungszeitpunkt, multipliziert mit dem Nominalwert des Kontrakts. Aufgrund der Beschaffenheit des Kontrakts ist die Auszahlung mit dem Näherrücken der Fälligkeit de facto bekannt, da alle Beobachtungen für die Berechnung der Korrelation de facto bekannt sind. Daher nimmt das Modellrisiko mit zunehmender Laufzeit des Vertrags ab. Bei einem ausstehenden Kontrakt muss die implizite Korrelation für alle zukünftigen Korrelationen berechnet werden, die als Marktpreis der zukünftigen Korrelation gesehen werden können. Die implizite Korrelation bzw. Korrelationsmarke lässt sich aus beobachteten Preisen für Correlation-Swaps oder aus Notierungen von OTC-Händlern ableiten.

#### Optionen

Optionskontrakte können bestimmte Optionen auf börsengehandelte Futures-Kontrakte enthalten. Schreibt ein Portfolio eine Option, wird der Betrag, der dem Portfolio erhaltenen Prämie entspricht, als Verbindlichkeit verbucht und anschließend der beizulegende Zeitwert der geschriebenen Option um diesen Betrag angepasst. Die Prämie auf ausgeübte geschriebene Kaufoptionen wird bei der Ermittlung des realisierten Gesamtgewinns oder -verlusts zu den Erlösen aus dem Verkauf des zugrundeliegenden Wertpapiers oder der Fremdwährung hinzugerechnet. Die Prämie auf ausgeübte verkaufte Verkaufsoptionen wird von den Kosten für die erworbenen Wertpapiere, Indizes, Derivate oder Fremdwährungen abgezogen. Prämien aus geschriebenen Optionen, die verfallen, werden als realisierte Gewinne behandelt. Die Prämie auf gekaufte und ausgeübte Verkaufsoptionen wird bei Ermittlung des realisierten Gewinns oder Verlustes vom Verkaufserlös des Basiswerts bzw. der Basiswährung abgezogen. Die Prämie auf ausgeübte gekaufte Kaufoptionen wird zu den Kosten des gekauften Wertpapiers, Index, Derivats bzw. der gekauften Währung addiert. Auf den Kauf von auslaufenden und nicht ausgeübten Optionen gezahlte Prämien werden als realisierte Verluste behandelt. Die Ausübungspreise für Optionen auf Aktienkörbe lauten auf verschiedene Fremdwährungen, je nach den Landeswährungen der Positionen in den Wertpapierkörben.

##### *Swaptions*

Schreibt ein Portfolio eine Swaption, wird ein der Prämie, die der Portfolio erhält, entsprechender Betrag als Verbindlichkeit verbucht und anschließend auf den beizulegenden Zeitwert der geschriebenen Swaption angepasst. Erhaltene Prämien aus geschriebenen Swaptions, die unausgeübt verfallen, werden vom Portfolio an den Verfallsdaten als realisierte Gewinne behandelt. Die Prämie auf ausgeübte geschriebene Payer-Swaptions wird bei der Ermittlung des realisierten Gewinns oder Verlusts zu den Erlösen aus dem Verkauf des zugrundeliegenden Swaps hinzugerechnet. Wird eine geschriebene Receiver-Swaption ausgeübt, reduziert die Prämie die Kostenbasis des gekauften Swaps.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

### 1. WESENTLICHE BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE (FORTSETZUNG)

#### Optionen (Fortsetzung)

##### *Swaptions (Fortsetzung)*

Kauft ein Portfolio eine Swaption, wird ein der Prämie, die der Portfolio gezahlt hat, entsprechender Betrag als Vermögenswert verbucht und anschließend auf den beizulegenden Zeitwert der gekauften Swaption angepasst. Auf den Kauf von auslaufenden und nicht ausgeübten Swaptions gezahlte Prämien werden am Verfallsdatum als realisierte Verluste behandelt. Die Prämie auf ausgeübte gekaufte Payer-Swaptions wird bei der Feststellung, ob das betreffende Portfolio einen realisierten Gewinn oder Verlust hat, von den Erlösen des zugrundeliegenden Swaps abgezogen. Die Prämie auf ausgeübte Receiver-Swaptions wird zu der Kostenbasis der getauschten variabel verzinslichen Anlage addiert.

#### Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Ein Portfolio kann Pensionsgeschäfte abschließen, in deren Rahmen es ein Wertpapier von einer Gegenpartei kauft, die zum Zeitpunkt des Verkaufs zustimmt, das Wertpapier zu einem gemeinsam festgelegten Datum und Preis zurückzukaufen und somit die Rendite für das Portfolio während der Laufzeit des Pensionsgeschäft festlegt. Der Rückkaufpreis ist der Kaufpreis plus ein vereinbarter Marktzins, der nicht im Zusammenhang mit dem Zinssatz oder der Fälligkeit des gekauften Wertpapiers steht. Ein Portfolio kann auch umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließen, in deren Rahmen es ein Wertpapier an eine Gegenpartei (beispielsweise eine Bank oder einen Wertpapierhändler) verkauft und zustimmt, das Wertpapier zu einem gemeinsam festgelegten Datum und Preis zurückzukaufen.

#### Differenzkontrakte

Differenzkontrakte werden zur Schlussnotierung des zugrundeliegenden Wertpapiers abzüglich der jedem Kontrakt zurechenbaren Finanzierungskosten (die separat verbucht werden), umgerechnet in die Basiswährung des Differenzkontrakts, bewertet. Der aktuelle Marktwert wird in der Bilanz ausgewiesen. Beim Eingehen von Differenzkontrakten kann ein Portfolio verpflichtet sein, dem Broker einen Geldbetrag und/oder andere Vermögenswerte in Höhe eines bestimmten Prozentsatzes des Kontraktwertes („Ersteinschuss“) als Sicherheit zu übertragen. Anschließend werden je nach den Wertschwankungen des zugrundeliegenden Wertpapiers regelmäßig so genannte „Nachschusszahlungen“ vom einem Portfolio geleistet bzw. entgegengenommen. Während der Laufzeit des Differenzkontrakts werden Wertänderungen des Kontrakts als nicht realisierte Gewinne bzw. Verluste anhand der Marktbewertungsmethode an jedem Bewertungstag erfasst, so dass der Wert des zugrundeliegenden Wertpapiers widergespiegelt wird. Bei Schließung des Kontrakts entsprechen die realisierten Gewinne oder Verluste der Differenz zwischen dem Wert des Kontrakts zum Zeitpunkt seiner Eröffnung (einschließlich der Finanzierungskosten) und dem Wert zum Zeitpunkt seiner Schließung. Die Differenzkontrakten zuzurechnenden Dividenden (nach Abzug von Quellensteuern) werden als Dividendenforderungen oder -verbindlichkeiten am Ende des Geschäftsjahres verbucht.

#### Saldierung von Finanzinstrumenten

Finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten werden nur dann saldiert und der Nettobetrag in der Bilanz ausgewiesen, wenn ein Rechtsanspruch besteht, die erfassten Beträge miteinander zu verrechnen und beabsichtigt wird, entweder den Ausgleich auf Nettobasis herbeizuführen oder gleichzeitig mit der Verwertung der betreffenden Vermögenswerte die dazugehörigen Verbindlichkeiten abzulösen.

#### Barmittel und Barmitteläquivalente

Barmittel umfassen Sichtguthaben bei Banken. Barmitteläquivalente sind kurzfristige hochliquide Investitionen, die jederzeit in festgelegte Zahlungsmittelbeträge umgewandelt werden können, nur einem unwesentlichen Wertschwankungsrisiko unterliegen und zur Begleichung kurzfristiger Barverpflichtungen und nicht für Anlagezwecke oder andere Zwecke gehalten werden. Barmittel und Barmitteläquivalente werden zu ihrem Nennwert, gegebenenfalls einschließlich aufgelaufener Zinsen, am Bewertungszeitpunkt des jeweiligen Handelstages bewertet, es sei denn, nach Einschätzung der Direktoren (in Konsultation mit dem Manager und der Verwaltungsstelle) muss eine Anpassung vorgenommen werden, damit ihr tatsächlicher Wert reflektiert wird.

##### *Kassenbestände des Fonds*

Einige der Kassenbestände des Fonds werden gemäß den Leitlinien der Central Bank of Ireland mit dem Titel „Umbrella Funds – Cash Accounts Holding Subscription, Redemption and Dividend Monies“ (Kassenbestände mit Zeichnungs- Rücknahme- und Ausschüttungsgeldern) von der Verwaltungsstelle im Auftrag des Fonds gehalten. Diese Kassenbestände werden bei Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited (die „Verwahrstelle“) für den Fonds in Konten für nicht bearbeitete Zeichnungsgelder von Anlegern, an Anleger zahlbare Rücknamegelder und/oder sonstige an Anleger zahlbare Beträge gehalten und gelten als Vermögenswerte des Fonds. Jegliche zum Ende des Geschäftsjahres auf diesen Barkonten gehaltenen Gelder werden in den Gesamtbilanzen des Fonds ausgewiesen.

#### Forderungen von/gegenüber Brokern

Die von den Portfolios an eine Gegenpartei im Zusammenhang mit derivativen Finanzinstrumenten geleistete Marge und Sicherheiten werden in der Bilanz als Forderungen gegenüber Brokern ausgewiesen. Die von der Gegenpartei an ein Portfolio im Zusammenhang mit derivativen Finanzinstrumenten geleistete Marge und Sicherheiten werden in der Bilanz als Verbindlichkeiten gegenüber Brokern ausgewiesen. Bareinschüsse werden zum beizulegenden Zeitwert bewertet.

**FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR****1. WESENTLICHE BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE (FORTSETZUNG)****Währungsumrechnung***Funktionale Währung und Darstellungswährung*

Die funktionale und die Darstellungswährung Corporate Hybrid Bond, des Euro Bond Absolute Return, des Euro Bond, des European High Yield Bond, des European Sustainable Equity, des Macro Opportunities FX und des Short Duration Euro Bond ist der Euro. Die funktionale Währung und die Darstellungswährung des China A-Share Equity und des China Bond ist der CNY. Die funktionale Währung und die Darstellungswährung des Japan Equity Engagement ist der JPY. Die funktionale Währung und die Darstellungswährung aller anderen Portfolios ist der US-Dollar. Da die Basiswährung des größten Teils des Nettovermögens des Fonds der US-Dollar ist, wird der US-Dollar als die am besten geeignete Konsolidierungswährung betrachtet. Weitere Einzelheiten hierzu sind in Anmerkung 15 enthalten

*Transaktionen und Salden*

Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die auf andere Währungen als die funktionale Währung des Portfolios lauten, werden zu dem am Bilanzstichtag geltenden Wechselkurs in die funktionale Währung umgerechnet. Transaktionen in anderen Währungen als der funktionalen Währung des Portfolios werden zu dem am Datum der jeweiligen Transaktion geltenden Wechselkurs in die funktionale Währung umgerechnet. Gewinne und Verluste aus Devisentransaktionen werden bei der Ermittlung des Jahresergebnisses in der Gewinn- und Verlustrechnung ausgewiesen.

Zeichnungsgelder und Beträge, die bei der Rücknahme rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile in anderen Währungen als der funktionalen Währung gezahlt werden, werden zu dem am Datum der jeweiligen Transaktionen geltenden Wechselkurs in die funktionale Währung umgerechnet. Die Bilanz wird anhand der Wechselkurse zum Jahresende umgerechnet, und die Gewinn- und Verlustrechnung sowie die Aufstellung über die Entwicklung des Nettovermögens werden zum Durchschnittskurs des Jahres umgerechnet.

**Verbuchung von Aufwand und Ertrag**

Dividendenerträge werden in der Gewinn- und Verlustrechnung an dem Datum verbucht, an dem das betreffende Wertpapier „ex-Dividende“ notiert ist, soweit die entsprechende Information dem Portfolio in angemessener Weise zur Verfügung steht. Dividenden und Zinserträge werden vor Abzug von Quellensteuern ausgewiesen, die nicht zurückgefordert werden können und gesondert in der Gewinn- und Verlustrechnung ausgewiesen werden, sowie nach Abzug von etwaigen Steuergutschriften. Zinsen aus Bankeinlagen werden auf Kassenbasis verbucht, während andere Erträge periodengerecht ausgewiesen werden.

Zinserträge werden in der Gewinn- und Verlustrechnung für alle Schuldinstrumente, die als erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte klassifiziert sind, periodengerecht ausgewiesen.

**Realisierte Gewinne und Verluste aus Anlagen**

Realisierte Gewinne und Verluste aus der Veräußerung von finanziellen Vermögenswerten, die erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet werden, werden auf einer „First in/First out“-Basis berechnet. Die damit verbundene Wechselkursbewegung zwischen dem Kauf- und dem Verkaufsdatum bei Veräußerung von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten wird in den Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten einbezogen. Anlagetransaktionen werden am Handelstag verbucht, d. h. dem Tag, an dem das Portfolio sich verpflichtet, den entsprechenden Vermögenswert zu kaufen oder zu verkaufen.

**Besteuerung**

Gemäß geltendem Recht und den branchenüblichen Usancen ist der Fonds als Investmentgesellschaft im Sinne von Section 739B(1) des Taxes Consolidation Act von 1997 (Gesetz zur Steuerkonsolidierung), in seiner aktuellen Fassung, anerkannt. Dementsprechend sind seine relevanten Erträge oder Kapitalgewinne in Irland nicht steuerpflichtig. Jedoch können dem Fonds beim Eintreten eines Steuertatbestands irische Steuern entstehen.

Ein Steuertatbestand umfasst Ausschüttungszahlungen an Anteilinhaber oder die Einlösung, Rücknahme oder Übertragung von Anteilen sowie das Halten von Anteilen am Ende eines jeden Achtjahreszeitraums, beginnend mit dem Erwerb der Anteile. Bei Steuertatbeständen werden für den Fonds keine irischen Steuern fällig bei:

- (i) einem Anteilinhaber, der weder irischer Staatsbürger ist noch im Sinne des Steuerrechts zum Zeitpunkt des Steuertatbestands als in Irland ansässig gilt, vorausgesetzt, er hat die entsprechenden gültigen Erklärungen gemäß den Richtlinien des Taxes Consolidation Act von 1997 in der jeweils gültigen Fassung beim Fonds eingereicht, und
- (ii) bestimmte steuerbefreite, in Irland ansässige Anteilinhaber, die beim Fonds die notwendigen unterzeichneten Erklärungen eingereicht haben.

In diesem Berichtszeitraum lagen keine Steuertatbestände vor.

Etwasige Veräußerungsgewinne, Dividenden und Zinsen, welche der Fonds durch seine Wertpapiere erzielt, können ggf. Quellensteuern der Länder unterliegen, aus denen diese Erträge/Gewinne erzielt werden, und diese Steuern können vom Fonds oder seinen Anteilhabern ggf. nicht wiedererlangt werden.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

### 1. WESENTLICHE BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE (FORTSETZUNG)

#### Besteuerung (Fortsetzung)

Der Finance Act von 2010 sieht vor, dass die Steuerbehörden Investmentfonds, die außerhalb Irlands vermarktet werden, die Genehmigung erteilen können, Zahlungen an nicht in Irland ansässige Anleger ohne Abzug der irischen Steuer zu leisten, wenn keine maßgebliche Erklärung vorliegt, sofern „äquivalente Maßnahmen“ getroffen werden. Ein Fonds, der diese Genehmigung erhalten will, muss diese schriftlich bei den Steuerbehörden beantragen und die Erfüllung der maßgeblichen Bedingungen bestätigen. Die Gesellschaft hatte zum 31. Dezember 2024 und 2023 keinen Antrag auf Genehmigung bei der Revenue Commission gestellt.

Die Gesellschaft hat die Steuerposition für die offenen Steuerjahre zum 31. Dezember 2024 und 2023 überprüft und entschieden, dass keine Rückstellung für Ertragssteuern und/oder ungewisse Steuerpositionen im Abschluss der Gesellschaft erforderlich ist.

Es bestehen Unsicherheiten hinsichtlich der Auslegung komplexer Steuervorschriften und steuerrechtlicher Änderungen in Bezug auf ausländische Quellensteuern. Angesichts des breiten Spektrums an internationalen Anlagen könnten Differenzen, die sich zwischen tatsächlichen Investmenterträgen und den getroffenen Annahmen ergeben, oder künftige Änderungen an derartigen Annahmen weitere Berichtigungen des bereits erfassten Steueraufwands erfordern.

Der Fonds bildet auf der Grundlage angemessener Schätzungen Rückstellungen für die potenziellen Folgen von Prüfungen durch die Steuerbehörden der jeweiligen Länder, in denen er investiert. Die Höhe derartiger Rückstellungen richtet sich nach verschiedenen Faktoren wie Erfahrungen aus früheren Steuerprüfungen und abweichenden Auslegungen der Steuervorschriften durch das steuerpflichtige Unternehmen und die zuständige Steuerbehörde. Derartige unterschiedliche Auslegungen können sich zu vielen verschiedenen Fragen ergeben, je nach der vorliegenden Situation im Domizilland der jeweiligen Anlage. Da der Fonds die Wahrscheinlichkeit von Rechtsstreitigkeiten und anschließenden Abflüssen von Zahlungsmitteln im Hinblick auf Steuern als gering erachtet, wurde in den Geschäftsjahren zum 31. Dezember 2024 und zum 31. Dezember 2023 keine Eventualverbindlichkeit ausgewiesen.

Die Gesellschaft unterliegt nicht den globalen Mindestbesteuerungsanforderungen gemäß Säule Zwei, da die Portfolios die Anforderungen erfüllen, um im Einklang mit der Irish Finance Bill 2024 als Investmentunternehmen klassifiziert zu werden. Auf dieser Grundlage wird in den Abschlüssen keine inländische Zusatzsteuer ausgewiesen, da die Portfolios die Ausnahmeregelungen erfüllen, insbesondere aufgrund der Tatsache, dass sie eigenständige regulierte Investmentfonds (wie im Taxes Consolidation Act (TCA) 1997 definiert) sind.

#### Rückzahlbare, gewinnberechtigende Anteile

Die rückzahlbaren, gewinnberechtigenden Anteile sind auf Wunsch der Anteilhaber zurückzunehmen und werden als finanzielle Verbindlichkeiten eingestuft. Ausschüttungen auf diese Anteile werden in der Gewinn- und Verlustrechnung unter Finanzierungskosten ausgewiesen. Die rückzahlbaren, gewinnberechtigenden Anteile können an jedem Handelstag gegen einen Barbetrag an das Portfolio zurückgegeben werden, der ihrem anteiligen Wert am NIW des Portfolios entspricht. Die rückzahlbaren, gewinnberechtigenden Anteile werden zu dem Rücknahmebetrag ausgewiesen, der zum Bilanzstichtag zahlbar wäre, wenn der Anteilhaber von seinem Recht auf Rückgabe des Anteils an das Portfolio Gebrauch gemacht hätte.

#### Ausschüttungspolitik

Die Direktoren haben beschlossen, sämtliche Nettoerträge und realisierten Nettokapitalgewinne, die den thesaurierenden Klassen zuzurechnen sind, wiederanzulegen, und sie beabsichtigen daher nicht, für Anteile dieser Klassen Dividenden festzusetzen.

#### Quelle der Ausschüttungen

Satzungsgemäß können die Direktoren Dividenden auf Anteile aus den Nettoerträgen (einschließlich Dividendenerträge und Zinserträge) und/oder dem Überschuss aus realisierten und nicht realisierten Gewinnen nach Abzug der realisierten und nicht realisierten Verluste aus den Anlagen des Fonds (gemeinsam „Nettoertrag“) und auch aus dem Kapital beschließen. Dividenden, die aus dem Kapital gezahlt werden, kommen einer Rückzahlung oder Entnahme eines Teils der ursprünglichen Anlage eines Anteilhabers oder aus Kapitalerträgen, die dieser ursprünglichen Anlage zuzurechnen sind, gleich. Solche Dividenden können unmittelbar zu einem Rückgang des NIW der betreffenden Anteile führen.

Die Direktoren beabsichtigen derzeit, vorbehaltlich einer „de-minimis“-Grenze, mindestens 85 % der Nettoerträge, die jeder ausschüttenden Klasse zurechenbar sind, als Dividende festzusetzen und auszuschütten; ausgenommen sind hiervon (i) die (wöchentlich) ausschüttenden Klassen, (ii) die (monatlich) ausschüttenden Klassen, (iii) die (CG) ausschüttenden Klassen und (iv) alle sonstigen ausschüttenden Klassen in einem Portfolio, die laut dem maßgeblichen Prospektzusatz Dividenden aus Kapital und Nettoertrag ausschütten. Die Anteilhaber sollten jedoch beachten, dass die Direktoren sich in Bezug auf eine ausschüttende Klasse in ihrem eigenen Ermessen für oder gegen eine solche Festsetzung und Ausschüttung entscheiden können.

Im Bezug auf die monatlich ausschüttenden Klassen, die wöchentlich ausschüttenden Klassen und die (CG) ausschüttenden Klassen beabsichtigen die Direktoren, eine den Anteilen dieser Klassen zuweisbare, (wie zutreffend) monatliche, wöchentliche oder halbjährliche Dividende festzusetzen und zu zahlen; dies geschieht durch eine Kombination aus Nettoertrag und Kapital, so dass, falls der Nettoertrag für den entsprechenden Zeitraum weniger als der festgesetzte Betrag ist, die Differenz aus dem die betreffenden Anteile repräsentierenden Kapital gezahlt wird, was es den Klassen ermöglicht, regelmäßige, feste Dividenden auszuschütten. Falls die Nettoeinkünfte, die den (wöchentlich) ausschüttenden Klassen, den (monatlich) ausschüttenden Klassen oder den (CG) ausschüttenden Klassen zuzuschreiben sind, den Betrag übersteigen, der während des entsprechenden Zeitraums erklärt wurde, wird der Betrag der Nettoeinkünfte, der diesen Betrag übersteigt, in einem Ausschüttungskonto für die jeweiligen Anteile gehalten und bildet Teil der Dividende, die für spätere Ausschüttungszeiträume zu zahlen ist. Vorstehendes gibt die derzeitige Absicht der Direktoren bezüglich der Festsetzung und Zahlung von Dividenden für die (monatlich) ausschüttenden Klassen und die (wöchentlich) ausschüttenden Klassen wieder. Die Direktoren können sich jedoch in ihrem eigenen Ermessen gegen eine solche Festsetzung und Zahlung entscheiden, und es gibt keine Garantie dafür, dass solche Dividenden gezahlt werden.

**FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR****1. WESENTLICHE BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE (FORTSETZUNG)****Ausschüttungspolitik (Fortsetzung)***Ausschüttungshäufigkeit*

Unter normalen Umständen beabsichtigen die Direktoren, die Dividenden wie folgt zu zahlen:

- (a) Bei allen (wöchentlich) ausschüttenden Klassen in allen Portfolios werden Dividenden am oder vor dem letzten Geschäftstag einer jeden Woche erklärt und gezahlt;
- (b) Bei allen (monatlich) ausschüttenden Klassen in allen Portfolios werden Dividenden am oder vor dem letzten Geschäftstag eines jeden Monats festgesetzt und drei Geschäftstage später gezahlt;
- (c) bei allen (CG) ausschüttenden Klassen aller Portfolios ist beabsichtigt, dass etwaige Dividenden auf halbjährlicher Basis festgesetzt und innerhalb von dreißig Geschäftstagen gezahlt werden;
- (d) bei allen anderen ausschüttenden Klassen des China Bond, des Euro Bond, des Euro Bond Absolute Return, des Global Equity Megatrends und des Short Duration Euro Bond werden Dividenden vierteljährlich erklärt und innerhalb von dreißig Geschäftstagen in Bezug auf den Nettoertrag der ausschüttenden Klassen für das vorhergehende Quartal gezahlt;
- (e) bei jeder der ausschüttenden Klassen des Climate Innovation, des CLO Income, des Commodities, des Corporate Hybrid Bond, des Developed Market FMP – 2027, des EMD Corporate – Social and Environmental Transition, des Emerging Market Debt - Hard Currency, des Emerging Market Debt - Local Currency, des Emerging Market Debt Blend, des Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend, des European High Yield Bond, des Event Driven, des Global Bond, des Global Flexible Credit Income, des Global High Yield Engagement, des Global Investment Grade Credit, des Global Opportunistic Bond, des High Yield Bond, des Short Duration Emerging Market Debt, des Short Duration High Yield Engagement, des Strategic Income, des Sustainable Asia High Yield, des Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency, des Tactical Macro, des US Equity Premium und des US Real Estate Securities werden Dividenden vierteljährlich erklärt und innerhalb von dreißig Geschäftstagen gezahlt;
- (f) bei allen anderen ausschüttenden Klassen des US Long Short Equity ist beabsichtigt, dass etwaige Dividenden halbjährlich erklärt und innerhalb von dreißig Geschäftstagen gezahlt werden;
- (g) Ausschüttungen der anderen ausschüttenden Klassen des Uncorrelated Strategies, des US Equity, des US Large Cap Value, des US Multi Cap Opportunities, des US Small Cap und des US Small Cap Intrinsic Value werden jährlich erklärt und innerhalb von dreißig Geschäftstagen gezahlt;
- (h) bei allen anderen ausschüttenden Klassen aller anderen Portfolios ist beabsichtigt, dass etwaige Dividenden auf jährlicher Basis festgesetzt und innerhalb von dreißig Geschäftstagen in Bezug auf den Nettoertrag der ausschüttenden Klassen für das am vorhergehenden 31. Dezember abgelaufene Kalenderjahr gezahlt werden;
- (i) Bei allen (monatlich) Bruttoerträge ausschüttenden Klassen in den Portfolios werden Dividenden am oder vor dem letzten Geschäftstag eines jeden Monats festgesetzt und innerhalb von drei Geschäftstagen gezahlt; und
- (j) bei allen übrigen (Brutto-)Erträge ausschüttenden Klassen in den Portfolios werden Dividenden auf vierteljährlicher Basis festgesetzt und innerhalb von dreißig Geschäftstagen gezahlt.

Unter dem Vorbehalt, dass Erträge zur Ausschüttung zur Verfügung stehen, können die Direktoren auch beschließen, für jede der ausschüttenden Klassen Zwischendividenden festzusetzen und auszuschütten. Alle Anteile einer ausschüttenden Klasse, die an einem Datum, an dem die Direktoren beschließen, für diese ausschüttende Klasse eine Dividende festzusetzen, ausgegeben sind, haben Anspruch auf diese Dividende.

Die Direktoren behalten sich das Recht vor, die Dividendenpolitik jeder Anteilklasse nach ihrem eigenen Ermessen ohne vorherige Mitteilung an die Anteilhaber der betreffenden Klasse zu ändern. Jede Dividende, die nicht innerhalb eines Zeitraums von sechs Jahren ab dem Datum des Dividendenbeschlusses in Anspruch genommen wird, verjährt und fällt dem jeweiligen Portfolio wieder zu.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET

|   | Absolute Return Multi Strategy* |                       | Asia Responsible Transition Bond |                       |
|---|---------------------------------|-----------------------|----------------------------------|-----------------------|
|   | Zum 31. Dezember 2024           | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024            | Zum 31. Dezember 2023 |
|   | Zeitwert<br>US\$                | Zeitwert<br>US\$      | Zeitwert<br>US\$                 | Zeitwert<br>US\$      |
| <b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>                     |                                 |                       |                                  |                       |
| Unternehmensanleihen  | –                               | –                     | 21.012.411                       | 45.692.223            |
| Aktien  | –                               | 6.311                 | –                                | –                     |
| Staatsanleihen  | –                               | –                     | 5.093.501                        | 12.025.196            |
| Schatzwechsel   | –                               | –                     | –                                | 2.496.736             |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten  | –                               | –                     | 32.814                           | 255.858               |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten   | –                               | –                     | 101.004                          | 127.055               |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten  | –                               | –                     | 171                              | 575                   |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>    | –                               | 6.311                 | 26.239.901                       | 60.597.643            |
| <b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>                  |                                 |                       |                                  |                       |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten   | –                               | –                     | (67.920)                         | (128.113)             |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten  | –                               | –                     | (81.996)                         | (135.330)             |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten   | –                               | –                     | –                                | (21)                  |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | –                               | –                     | (149.916)                        | (263.464)             |

\* Das Portfolio wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

|   | China A-Share Equity  |                       | China Bond            |                       |
|---|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
|   | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 |
|   | Zeitwert<br>CNY       | Zeitwert<br>CNY       | Zeitwert<br>CNY       | Zeitwert<br>CNY       |
| <b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>                     |                       |                       |                       |                       |
| Einlagenzertifikat  | –                     | –                     | –                     | 58.557.000            |
| Unternehmensanleihen  | –                     | –                     | 69.415.652            | 290.154.114           |
| Aktien  | 14.682.825            | 13.480.937            | –                     | –                     |
| Staatsanleihen  | –                     | –                     | 47.383.173            | 95.858.682            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten  | –                     | –                     | 14.109                | 603.582               |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten   | –                     | –                     | 1.649.026             | 1.943.751             |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten  | –                     | –                     | 5.674                 | –                     |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>    | <b>14.682.825</b>     | <b>13.480.937</b>     | <b>118.467.634</b>    | <b>447.117.129</b>    |
| <b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>                  |                       |                       |                       |                       |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten  | –                     | –                     | (1.502.829)           | (2.361.945)           |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>–</b>              | <b>–</b>              | <b>(1.502.829)</b>    | <b>(2.361.945)</b>    |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

|   | China Equity          |                       | Climate Innovation <sup>1</sup> |                       |
|---|-----------------------|-----------------------|---------------------------------|-----------------------|
|   | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024           | Zum 31. Dezember 2023 |
|   | Zeitwert<br>US\$      | Zeitwert<br>US\$      | Zeitwert<br>US\$                | Zeitwert<br>US\$      |
| <b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>                     |                       |                       |                                 |                       |
| Aktien  | 134.512.686           | 171.916.351           | 2.949.182                       | 2.831.398             |
| Participatory Notes   | 255.378               | –                     | –                               | –                     |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten   | 685.905               | 547.220               | –                               | –                     |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>    | <b>135.453.969</b>    | <b>172.463.571</b>    | <b>2.949.182</b>                | <b>2.831.398</b>      |
| <b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>                  |                       |                       |                                 |                       |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten  | (866.976)             | (423.344)             | –                               | –                     |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(866.976)</b>      | <b>(423.344)</b>      | <b>–</b>                        | <b>–</b>              |

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

|   | CLO Income            |                       | Commodities           |                       |
|---|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
|   | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 |
|   | Zeitwert<br>US\$      | Zeitwert<br>US\$      | Zeitwert<br>US\$      | Zeitwert<br>US\$      |
| <b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>                     |                       |                       |                       |                       |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)   | 934.118.980           | 159.687.075           | –                     | –                     |
| Unternehmensanleihen  | –                     | –                     | 85.264.336            | 77.031.796            |
| Investmentfonds   | –                     | 12.221.060            | –                     | –                     |
| Pensionsgeschäfte   | 84.500.000            | –                     | –                     | –                     |
| Schatzwechsel   | 80.045.443            | 4.994.906             | 47.615.993            | 43.941.161            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten   | 28.699.677            | 2.345.289             | 329.265               | 1.573.388             |
| Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten  | –                     | 48.732                | –                     | –                     |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>    | <b>1.127.364.100</b>  | <b>179.297.062</b>    | <b>133.209.594</b>    | <b>122.546.345</b>    |
| <b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>                  |                       |                       |                       |                       |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten  | (8.100.316)           | (2.570.754)           | (1.617.307)           | (210.126)             |
| Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten   | (194.289)             | –                     | –                     | –                     |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(8.294.605)</b>    | <b>(2.570.754)</b>    | <b>(1.617.307)</b>    | <b>(210.126)</b>      |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

|   | Corporate Hybrid Bond |                       | Developed Market FMP – 2027 <sup>1</sup> |                       |
|---|-----------------------|-----------------------|--|-----------------------|
|   | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024                    | Zum 31. Dezember 2023 |
|   | Zeitwert<br>EUR       | Zeitwert<br>EUR       | Zeitwert<br>US\$                         | Zeitwert<br>US\$      |
| <b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>                     |                       |                       |  |                       |
| Unternehmensanleihen  | 2.167.985.323         | 1.743.583.625         | 125.679.450                              | 135.777.186           |
| Investmentfonds   | 12.265.572            | 10.956.412            | –  | –                     |
| Pensionsgeschäfte   | 14.002.897            | –                     | –  | –                     |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten   | 19.233.303            | 12.101.176            | 619                                      | 39.869                |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>    | <b>2.213.487.095</b>  | <b>1.766.641.213</b>  | <b>125.680.069</b>                       | <b>135.817.055</b>    |
| <b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>                  |                       |                       |  |                       |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten  | (27.715.188)          | (7.732.130)           | (69.447)                                 | (393)                 |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(27.715.188)</b>   | <b>(7.732.130)</b>    | <b>(69.447)</b>                          | <b>(393)</b>          |

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

|   | EMD Corporate – Social and Environmental Transition |                       | Emerging Market Debt - Hard Currency |                       |
|---|---|-----------------------|--------------------------------------|-----------------------|
|   | Zum 31. Dezember 2024                               | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024                | Zum 31. Dezember 2023 |
|   | Zeitwert<br>US\$                                    | Zeitwert<br>US\$      | Zeitwert<br>US\$                     | Zeitwert<br>US\$      |
| <b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>                     |   |                       |                                      |                       |
| Unternehmensanleihen  | 105.120.488   | 83.464.415            | 741.805.425                          | 732.442.764           |
| Staatsanleihen  | 6.781.268   | 7.168.384             | 1.813.828.146                        | 1.794.182.602         |
| Investmentfonds   | –   | –                     | –                                    | 17.580.000            |
| Pensionsgeschäfte   | –   | –                     | 60.000.000                           | –                     |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten  | 115.178   | 27.031                | 7.790.478                            | 19.568.314            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten   | 268.863   | 1.906.675             | 9.083.011                            | 24.839.124            |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten   | 125.331   | –                     | 3.456.849                            | –                     |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>    | <b>112.411.128</b>                                  | <b>92.566.505</b>     | <b>2.635.963.909</b>                 | <b>2.588.612.804</b>  |
| <b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>                  |   |                       |                                      |                       |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten   | (7.734)   | (236.161)             | (4.217.458)                          | (10.222.785)          |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten  | (2.500.151)   | (235.957)             | (22.032.237)                         | (5.652.118)           |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(2.507.885)</b>                                  | <b>(472.118)</b>      | <b>(26.249.695)</b>                  | <b>(15.874.903)</b>   |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

|   | Emerging Market Debt - Local Currency |                       | Emerging Market Debt Blend |                       |
|---|---------------------------------------|-----------------------|----------------------------|-----------------------|
|   | Zum 31. Dezember 2024                 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024      | Zum 31. Dezember 2023 |
|   | Zeitwert<br>US\$                      | Zeitwert<br>US\$      | Zeitwert<br>US\$           | Zeitwert<br>US\$      |
| <b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>                     |                                       |                       |                            |                       |
| Unternehmensanleihen  | 55.840.021                            | 41.825.600            | 152.243.177                | 148.077.852           |
| Staatsanleihen  | 974.722.981                           | 1.124.421.834         | 304.516.261                | 330.568.106           |
| Investmentfonds   | 4.040.368                             | 16.173.300            | 4.001.641                  | 14.297.035            |
| Schatzwechsel   | –                                     | 33.341.150            | –                          | 1.006.392             |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten  | 170.988                               | 313.668               | 515.959                    | 1.199.361             |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten   | 12.896.398                            | 17.116.276            | 3.978.941                  | 6.637.946             |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten   | –                                     | –                     | 563.137                    | –                     |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten  | 9.523.599                             | 11.479.756            | 3.564.172                  | 2.641.912             |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>    | <b>1.057.194.355</b>                  | <b>1.244.671.584</b>  | <b>469.383.288</b>         | <b>504.428.604</b>    |
| <b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>                  |                                       |                       |                            |                       |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten   | –                                     | (716.676)             | (353.288)                  | (969.525)             |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten  | (19.531.329)                          | (12.281.584)          | (9.007.086)                | (2.075.226)           |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten   | (17.894.200)                          | (14.977.755)          | (6.997.058)                | (5.804.925)           |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(37.425.529)</b>                   | <b>(27.976.015)</b>   | <b>(16.357.432)</b>        | <b>(8.849.676)</b>    |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

|   | Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend |                       | Emerging Markets Equity |                       |
|---|---|-----------------------|-------------------------|-----------------------|
|   | Zum 31. Dezember 2024                                   | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024   | Zum 31. Dezember 2023 |
|   | Zeitwert<br>US\$  | Zeitwert<br>US\$      | Zeitwert<br>US\$        | Zeitwert<br>US\$      |
| <b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>                     |   |                       |                         |                       |
| Unternehmensanleihen  | 10.355.204  | 9.239.606             | –                       | –                     |
| Aktien  | –   | –                     | 102.296.565             | 87.302.700            |
| Staatsanleihen  | 41.785.641  | 48.266.565            | –                       | –                     |
| Participatory Notes   | –   | –                     | 3.146.146               | –                     |
| Immobilienaktiengesellschaften  | –   | –                     | 869.911                 | 481.105               |
| Schatzwechsel   | –   | 821.151               | –                       | –                     |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten  | 286.707   | 832.110               | –                       | –                     |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten   | 370.527   | 2.325.031             | 874.873                 | 1.272.409             |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten  | 89.612  | 19.138                | –                       | –                     |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>    | <b>52.887.691</b>                                       | <b>61.503.601</b>     | <b>107.187.495</b>      | <b>89.056.214</b>     |
| <b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>                  |   |                       |                         |                       |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten   | (238.510)   | (356.901)             | –                       | –                     |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten  | (1.223.159)   | (284.238)             | (1.965.401)             | (787.152)             |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten   | (4.783)   | –                     | –                       | –                     |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten   | (107.358)   | (38.443)              | –                       | –                     |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(1.573.810)</b>                                      | <b>(679.582)</b>      | <b>(1.965.401)</b>      | <b>(787.152)</b>      |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

|   | Euro Bond             |                       | Euro Bond Absolute Return |                       |
|---|-----------------------|-----------------------|---------------------------|-----------------------|
|   | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024     | Zum 31. Dezember 2023 |
|   | Zeitwert<br>EUR       | Zeitwert<br>EUR       | Zeitwert<br>EUR           | Zeitwert<br>EUR       |
| <b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>                     |                       |                       |                           |                       |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)   | –                     | 4.100                 | 3.996.647                 | 158.727               |
| Unternehmensanleihen  | 33.145.394            | 4.770.071             | 41.216.156                | 18.558.164            |
| Staatsanleihen  | 34.603.245            | 5.399.389             | 36.582.154                | 14.456.150            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten  | 141.000               | 32.300                | 383.089                   | 47.035                |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten   | –                     | –                     | 1.998.238                 | 25.383                |
| Nicht realisierter Gewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten   | –                     | 6.642                 | –                         | 26.569                |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten  | 1.698                 | 7.001                 | 6.217                     | 113.881               |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>    | <b>67.891.337</b>     | <b>10.219.503</b>     | <b>84.182.501</b>         | <b>33.385.909</b>     |
| <b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>                  |                       |                       |                           |                       |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten   | (226.870)             | (19.007)              | (27.780)                  | (301.831)             |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten  | –                     | –                     | (172.800)                 | (1.117.757)           |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten   | (239.328)             | (54.486)              | (271.500)                 | (181.087)             |
| Nicht realisierter Verlust aus Inflation-Swap-Kontrakten  | –                     | (3.665)               | –                         | (14.661)              |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten   | (6.230)               | (3.982)               | (9.491)                   | –                     |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(472.428)</b>      | <b>(81.140)</b>       | <b>(481.571)</b>          | <b>(1.615.336)</b>    |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

|   | European High Yield Bond |                       | European Sustainable Equity |                       |
|---|--------------------------|-----------------------|-----------------------------|-----------------------|
|   | Zum 31. Dezember 2024    | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024       | Zum 31. Dezember 2023 |
|   | Zeitwert<br>EUR          | Zeitwert<br>EUR       | Zeitwert<br>EUR             | Zeitwert<br>EUR       |
| <b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>                     |                          |                       |                             |                       |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)   | 4.796.698                | 2.425.341             | –                           | –                     |
| Unternehmensanleihen  | 529.414.084              | 384.433.736           | –                           | –                     |
| Aktien  | –                        | –                     | 147.238.159                 | 171.225.790           |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen  | –                        | 114.727               | –                           | –                     |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten   | 2.677.489                | 643.091               | –                           | –                     |
| Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten  | –                        | 18.355                | –                           | –                     |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>    | <b>536.888.271</b>       | <b>387.635.250</b>    | <b>147.238.159</b>          | <b>171.225.790</b>    |
| <b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>                  |                          |                       |                             |                       |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten  | (2.086.588)              | (1.281.452)           | –                           | –                     |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(2.086.588)</b>       | <b>(1.281.452)</b>    | <b>–</b>                    | <b>–</b>              |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

|   | Event Driven          |                       | Global Bond           |                       |
|---|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
|   | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 |
|   | Zeitwert              | Zeitwert              | Zeitwert              | Zeitwert              |
|   | US\$                  | US\$                  | US\$                  | US\$                  |
| <b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>                     |                       |                       |                       |                       |
| Agency Bonds  | –                     | –                     | 882.160               | 1.146.538             |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)   | –                     | –                     | 13.298.144            | 10.864.506            |
| Unternehmensanleihen  | 195.788.600           | –                     | 31.448.688            | 28.855.602            |
| Staatsanleihen  | –                     | –                     | 32.141.381            | 42.481.574            |
| Kommunalanleihen  | –                     | –                     | 1.123.978             | 1.278.776             |
| Mortgage-Backed Securities  | –                     | –                     | 18.149.436            | 22.645.649            |
| Schatzwechsel   | 81.352.423            | 115.039.719           | –                     | –                     |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten  | –                     | –                     | 214.164               | 440.690               |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten   | 136.424               | 4.057.943             | 4.327.396             | 3.337.129             |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten  | –                     | –                     | 63.983                | 124.708               |
| Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten  | 139.204               | 959.529               | –                     | –                     |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>    | <b>277.416.651</b>    | <b>120.057.191</b>    | <b>101.649.330</b>    | <b>111.175.172</b>    |
| <b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>                  |                       |                       |                       |                       |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten   | –                     | –                     | (173.617)             | (622.972)             |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten  | (10.107.971)          | (155.365)             | (4.564.309)           | (3.195.228)           |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten   | –                     | –                     | –                     | (72.291)              |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten   | –                     | –                     | (16.224)              | –                     |
| Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten   | (527.124)             | –                     | –                     | –                     |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(10.635.095)</b>   | <b>(155.365)</b>      | <b>(4.754.150)</b>    | <b>(3.890.491)</b>    |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

|   | Global Diversified Income FMP – 2024* |                       | Global Equity Megatrends |                       |
|---|---------------------------------------|-----------------------|--------------------------|-----------------------|
|   | Zum 31. Dezember 2024                 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024    | Zum 31. Dezember 2023 |
|   | Zeitwert<br>US\$                      | Zeitwert<br>US\$      | Zeitwert<br>US\$         | Zeitwert<br>US\$      |
| <b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>                     |                                       |                       |                          |                       |
| Unternehmensanleihen  | –                                     | 123.463.985           | –                        | –                     |
| Aktien  | –                                     | –                     | 493.457.264              | 141.492.601           |
| Staatsanleihen  | –                                     | 1.727.993             | –                        | –                     |
| Schatzwechsel   | –                                     | 18.765.889            | –                        | –                     |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten   | –                                     | 281.732               | 33.919                   | 444                   |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>    | –                                     | 144.239.599           | 493.491.183              | 141.493.045           |
| <b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>                  |                                       |                       |                          |                       |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten  | –                                     | –                     | (249.051)                | –                     |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | –                                     | –                     | (249.051)                | –                     |

\* Das Portfolio wurde am 28. Juni 2024 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

|   | Global Flexible Credit Income |                       | Global High Yield Engagement |                       |
|---|-------------------------------|-----------------------|------------------------------|-----------------------|
|   | Zum 31. Dezember 2024         | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024        | Zum 31. Dezember 2023 |
|   | Zeitwert<br>US\$              | Zeitwert<br>US\$      | Zeitwert<br>US\$             | Zeitwert<br>US\$      |
| <b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>                     |                               |                       |                              |                       |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)   | 65.219.905                    | 23.118.219            | –                            | –                     |
| Unternehmensanleihen  | 318.686.087                   | 296.273.462           | 584.788.441                  | 532.499.481           |
| Aktien  | 6.584.306                     | 6.022.083             | –                            | –                     |
| Staatsanleihen  | 9.614.540                     | 15.379.748            | –                            | –                     |
| Investmentfonds   | 6.944                         | 66.832                | –                            | –                     |
| Pensionsgeschäfte   | –                             | –                     | 15.500.000                   | –                     |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen  | 37.505.823                    | 15.105.874            | 6.832.101                    | 4.933                 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten  | 1.115.433                     | 3.733.739             | –                            | –                     |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten   | 8.877.042                     | 8.130.820             | 15.450.103                   | 11.935.674            |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten   | 333.841                       | –                     | –                            | –                     |
| Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten  | –                             | 268.263               | –                            | –                     |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>    | <b>447.943.921</b>            | <b>368.099.040</b>    | <b>622.570.645</b>           | <b>544.440.088</b>    |
| <b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>                  |                               |                       |                              |                       |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte  | –                             | –                     | (999.796)                    | –                     |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten   | (1.308.502)                   | (5.173.223)           | (69.709)                     | –                     |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten  | (11.858.313)                  | (3.447.658)           | (17.319.842)                 | (6.738.234)           |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(13.166.815)</b>           | <b>(8.620.881)</b>    | <b>(18.389.347)</b>          | <b>(6.738.234)</b>    |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

|   | Global Investment Grade Credit |                       | Global Opportunistic Bond |                       |
|---|--------------------------------|-----------------------|---------------------------|-----------------------|
|   | Zum 31. Dezember 2024          | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024     | Zum 31. Dezember 2023 |
|   | Zeitwert<br>US\$               | Zeitwert<br>US\$      | Zeitwert<br>US\$          | Zeitwert<br>US\$      |
| <b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>                     |                                |                       |                           |                       |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)   | –                              | –                     | 354.846                   | 1.817.743             |
| Unternehmensanleihen  | 172.176.706                    | 81.376.321            | 26.885.560                | 27.412.055            |
| Staatsanleihen  | –                              | 2.082.454             | 20.058.262                | 21.133.383            |
| Investmentfonds   | –                              | –                     | 2.199                     | 21.165                |
| Mortgage-Backed Securities  | –                              | –                     | 11.517.944                | 14.565.802            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten  | –                              | –                     | 159.212                   | 839.044               |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten   | 3.851.457                      | 1.115                 | 6.280.307                 | 4.673.609             |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten   | –                              | –                     | 160.073                   | 193.716               |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten  | –                              | –                     | 102.409                   | 76                    |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>    | <b>176.028.163</b>             | <b>83.459.890</b>     | <b>65.520.812</b>         | <b>70.656.593</b>     |
| <b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>                  |                                |                       |                           |                       |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten   | –                              | –                     | (313.243)                 | (356.573)             |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten  | (3.686.902)                    | (1.107.450)           | (3.105.825)               | (6.577.836)           |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten   | –                              | –                     | (858.585)                 | (821.571)             |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten   | –                              | –                     | (28.308)                  | (27)                  |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(3.686.902)</b>             | <b>(1.107.450)</b>    | <b>(4.305.961)</b>        | <b>(7.756.007)</b>    |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

|   | Global Real Estate Securities* |                       | Global Sustainable Equity |                       |
|---|--------------------------------|-----------------------|---------------------------|-----------------------|
|   | Zum 31. Dezember 2024          | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024     | Zum 31. Dezember 2023 |
|   | Zeitwert<br>US\$               | Zeitwert<br>US\$      | Zeitwert<br>US\$          | Zeitwert<br>US\$      |
| <b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>                     |                                |                       |                           |                       |
| Aktien  | –                              | 3.015.990             | 139.635.830               | 153.603.419           |
| Immobilienaktiengesellschaften  | –                              | 17.071.668            | –                         | –                     |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten   | 7.820                          | 422.478               | –                         | –                     |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>    | <b>7.820</b>                   | <b>20.510.136</b>     | <b>139.635.830</b>        | <b>153.603.419</b>    |
| <b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>                  |                                |                       |                           |                       |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten  | (65.379)                       | (250.684)             | –                         | –                     |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(65.379)</b>                | <b>(250.684)</b>      | <b>–</b>                  | <b>–</b>              |

\* Das Portfolio wurde am 31. Dezember 2024 aufgelöst.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

|   | Global Value          |                       | High Yield Bond       |                       |
|---|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
|   | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 |
|   | Zeitwert              | Zeitwert              | Zeitwert              | Zeitwert              |
|   | US\$                  | US\$                  | US\$                  | US\$                  |
| <b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>                     |                       |                       |                       |                       |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)   | –                     | –                     | 29.468.224            | 10.897.982            |
| Unternehmensanleihen  | –                     | –                     | 1.753.492.450         | 1.999.177.351         |
| Aktien  | 45.875.559            | 53.809.071            | –                     | –                     |
| Staatsanleihen  | –                     | –                     | –                     | 36.225.768            |
| Investmentfonds   | –                     | –                     | 375.146               | 3.611.285             |
| Immobilienaktiengesellschaften  | 791.293               | 1.116.404             | –                     | –                     |
| Pensionsgeschäfte   | –                     | –                     | 66.000.000            | –                     |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen  | –                     | –                     | 65.626.148            | 43.084.058            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten   | 77.347                | 66.448                | 20.418.669            | 40.709.223            |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>    | <b>46.744.199</b>     | <b>54.991.923</b>     | <b>1.935.380.637</b>  | <b>2.133.705.667</b>  |
| <b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>                  |                       |                       |                       |                       |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte  | –                     | –                     | (3.063.764)           | –                     |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten  | (106.217)             | (46.897)              | (61.211.609)          | (15.391.406)          |
| Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten   | –                     | –                     | –                     | (51.928)              |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(106.217)</b>      | <b>(46.897)</b>       | <b>(64.275.373)</b>   | <b>(15.443.334)</b>   |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

|   | InnovAsia             |                       | Japan Equity Engagement |                       |
|---|-----------------------|-----------------------|-------------------------|-----------------------|
|   | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024   | Zum 31. Dezember 2023 |
|   | Zeitwert              | Zeitwert              | Zeitwert                | Zeitwert              |
|   | US\$                  | US\$                  | JPY                     | JPY                   |
| <b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>                     |                       |                       |                         |                       |
| Aktien  | 14.184.289            | 22.524.887            | 24.001.431.600          | 15.961.893.000        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten   | 46.906                | 299.135               | 860.770                 | 128.484.079           |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>    | <b>14.231.195</b>     | <b>22.824.022</b>     | <b>24.002.292.370</b>   | <b>16.090.377.079</b> |
| <b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>                  |                       |                       |                         |                       |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten  | (452.531)             | (60.136)              | (132.669)               | (42.002.252)          |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(452.531)</b>      | <b>(60.136)</b>       | <b>(132.669)</b>        | <b>(42.002.252)</b>   |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

|   | Macro Opportunities FX* |                       | Next Generation Connectivity |                       |
|---|-------------------------|-----------------------|------------------------------|-----------------------|
|   | Zum 31. Dezember 2024   | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024        | Zum 31. Dezember 2023 |
|   | Zeitwert<br>EUR         | Zeitwert<br>EUR       | Zeitwert<br>US\$             | Zeitwert<br>US\$      |
| <b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>                     |                         |                       |                              |                       |
| Aktien  | –                       | –                     | 1.039.929.740                | 990.515.308           |
| Staatsanleihen  | –                       | 347.166               | –                            | –                     |
| Schatzwechsel   | –                       | 2.407.376             | –                            | –                     |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten   | –                       | 4.627.295             | 2.683.376                    | 6.342.222             |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>    | –                       | 7.381.837             | 1.042.613.116                | 996.857.530           |
| <b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>                  |                         |                       |                              |                       |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten  | –                       | (4.613.695)           | (12.934.421)                 | (1.033.321)           |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | –                       | (4.613.695)           | (12.934.421)                 | (1.033.321)           |

\* Das Portfolio wurde am 8. Februar 2024 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

|   | Next Generation Mobility |                       | Next Generation Space Economy |                       |
|---|--------------------------|-----------------------|-------------------------------|-----------------------|
|   | Zum 31. Dezember 2024    | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024         | Zum 31. Dezember 2023 |
|   | Zeitwert<br>US\$         | Zeitwert<br>US\$      | Zeitwert<br>US\$              | Zeitwert<br>US\$      |
| <b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>                     |                          |                       |                               |                       |
| Aktien  | 121.437.560              | 151.194.636           | 55.202.739                    | 18.674.716            |
| Immobilienaktiengesellschaften  | –                        | 1.619.728             | –                             | –                     |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten   | 1.574                    | 20.789                | –                             | –                     |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>    | <b>121.439.134</b>       | <b>152.835.153</b>    | <b>55.202.739</b>             | <b>18.674.716</b>     |
| <b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>                  |                          |                       |                               |                       |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten  | (12.261)                 | (10.365)              | –                             | –                     |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(12.261)</b>          | <b>(10.365)</b>       | <b>–</b>                      | <b>–</b>              |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

|   | Short Duration Emerging Market Debt |                       | Short Duration Euro Bond |                       |
|---|-------------------------------------|-----------------------|--------------------------|-----------------------|
|   | Zum 31. Dezember 2024               | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024    | Zum 31. Dezember 2023 |
|   | Zeitwert<br>US\$                    | Zeitwert<br>US\$      | Zeitwert<br>EUR          | Zeitwert<br>EUR       |
| <b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>                     |                                     |                       |                          |                       |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)   | –                                   | –                     | 276.388.490              | 90.687.160            |
| Unternehmensanleihen  | 2.430.571.401                       | 2.406.487.373         | 1.372.639.876            | 789.167.617           |
| Staatsanleihen  | 1.320.118.061                       | 1.307.631.941         | 93.624.597               | 75.386.047            |
| Investmentfonds   | –                                   | 49.810.000            | 33.954.800               | –                     |
| Pensionsgeschäfte   | 9.000.000                           | –                     | –                        | –                     |
| Schatzwechsel   | –                                   | 53.894.704            | –                        | 8.960.964             |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten  | –                                   | –                     | 2.541.820                | 509.420               |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten   | 9.042.854                           | 64.552.046            | 1.543.824                | 235.719               |
| Nicht realisierter Gewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten   | –                                   | –                     | –                        | 531.378               |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>    | <b>3.768.732.316</b>                | <b>3.882.376.064</b>  | <b>1.780.693.407</b>     | <b>965.478.305</b>    |
| <b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>                  |                                     |                       |                          |                       |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten   | –                                   | –                     | (996.740)                | (2.783.686)           |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten  | (68.781.224)                        | (9.131.675)           | (1.449.270)              | (2.512.078)           |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten   | –                                   | –                     | (2.448.213)              | (2.179.454)           |
| Nicht realisierter Verlust aus Inflation-Swap-Kontrakten  | –                                   | –                     | –                        | (293.227)             |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten   | –                                   | –                     | (97.029)                 | (248.422)             |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(68.781.224)</b>                 | <b>(9.131.675)</b>    | <b>(4.991.252)</b>       | <b>(8.016.867)</b>    |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                         | Short Duration High Yield Engagement |                       | Strategic Income      |                       |
|--|--------------------------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
|  | Zum 31. Dezember 2024                | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 |
|  | Zeitwert<br>US\$                     | Zeitwert<br>US\$      | Zeitwert<br>US\$      | Zeitwert<br>US\$      |
| Agency Bonds   | –                                    | –                     | 739.410               | 781.434               |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)  | –                                    | –                     | 1.185.508.405         | 211.031.917           |
| Unternehmensanleihen   | 490.955.600                          | 664.013.737           | 1.159.321.497         | 535.844.310           |
| Aktien   | –                                    | –                     | –                     | 22.512                |
| Staatsanleihen   | –                                    | –                     | 317.221.334           | 175.669.880           |
| Investmentfonds  | 5.111.662                            | 241.028               | 56.497.686            | 60.766.454            |
| Mortgage-Backed Securities   | –                                    | –                     | 1.530.842.706         | 918.338.562           |
| Kommunalanleihen   | –                                    | –                     | 12.931.828            | 12.918.823            |
| Gekaufte Swaptions   | –                                    | –                     | –                     | 15.122                |
| Pensionsgeschäfte  | 16.000.000                           | –                     | 82.500.000            | –                     |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen   | 42.984.223                           | 13.420.047            | 253.734.800           | 429.819               |
| Schatzwechsel  | –                                    | –                     | –                     | 221.166.130           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten   | –                                    | –                     | 7.236.409             | 3.637.375             |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten  | 5.924.937                            | 15.254.920            | 39.661.388            | 20.251.351            |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten  | –                                    | –                     | 3.617.045             | 905.422               |
| Nicht realisierter Gewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten  | –                                    | –                     | 6.683                 | –                     |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten   | –                                    | –                     | –                     | 834.927               |
| Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten   | –                                    | –                     | –                     | 461.585               |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> | <b>560.976.422</b>                   | <b>692.929.732</b>    | <b>4.649.819.191</b>  | <b>2.163.075.623</b>  |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

|   | Short Duration High Yield Engagement (Fortsetzung) |                       | Strategic Income (Fortsetzung) |                       |
|---|--|-----------------------|--------------------------------|-----------------------|
|   | Zum 31. Dezember 2024                              | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024          | Zum 31. Dezember 2023 |
|   | Zeitwert<br>US\$                                   | Zeitwert<br>US\$      | Zeitwert<br>US\$               | Zeitwert<br>US\$      |
| <b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>                  |  |                       |                                |                       |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten   | –  | –                     | (4.577.032)                    | (18.576.468)          |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten  | (22.583.571)                                       | (3.114.085)           | (78.113.648)                   | (5.513.615)           |
| Nicht realisierter Verlust aus Inflation-Swap-Kontrakten  | –  | –                     | (4.523)                        | –                     |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten   | –  | –                     | (764.076)                      | (1.085.681)           |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(22.583.571)</b>                                | <b>(3.114.085)</b>    | <b>(83.459.279)</b>            | <b>(25.175.764)</b>   |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

|   | Sustainable Asia High Yield |                       | Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency |                       |
|---|-----------------------------|-----------------------|--|-----------------------|
|   | Zum 31. Dezember 2024       | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024                            | Zum 31. Dezember 2023 |
|   | Zeitwert<br>US\$            | Zeitwert<br>US\$      | Zeitwert<br>US\$                                 | Zeitwert<br>US\$      |
| <b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>                     |                             |                       |  |                       |
| Unternehmensanleihen  | 25.362.503                  | 24.364.117            | 62.183.538                                       | 28.120.429            |
| Staatsanleihen  | 4.024.917                   | 2.505.094             | 506.955.192                                      | 387.681.779           |
| Pensionsgeschäfte   | –                           | –                     | 13.000.000                                       | –                     |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten  | –                           | 23.897                | 3.868.256  | 7.590.987             |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten   | –                           | 16.926                | 3.522.333  | 8.781.301             |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten   | –                           | –                     | 836.491  | –                     |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>    | <b>29.387.420</b>           | <b>26.910.034</b>     | <b>590.365.810</b>                               | <b>432.174.496</b>    |
| <b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>                  |                             |                       |  |                       |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten   | (14.055)                    | (58.271)              | (2.827.620)                                      | (3.655.629)           |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten  | –                           | (496)                 | (12.284.478)                                     | (2.051.066)           |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(14.055)</b>             | <b>(58.767)</b>       | <b>(15.112.098)</b>                              | <b>(5.706.695)</b>    |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet                         | Tactical Macro <sup>1</sup> |                       | Uncorrelated Strategies |                       |
|--|-----------------------------|-----------------------|-------------------------|-----------------------|
|  | Zum 31. Dezember 2024       | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024   | Zum 31. Dezember 2023 |
|  | Zeitwert<br>US\$            | Zeitwert<br>US\$      | Zeitwert<br>US\$        | Zeitwert<br>US\$      |
| Unternehmensanleihen   | –                           | –                     | 63.149.917              | 120.618.827           |
| Aktien   | –                           | –                     | 16.585.832              | 77.292.452            |
| Immobilienaktiengesellschaften   | –                           | –                     | 498.501                 | 1.217.656             |
| Participatory Notes  | –                           | –                     | 161.034                 | 37.045                |
| Staatsanleihen   | –                           | –                     | 10.311.805              | 38.964.571            |
| Schatzwechsel  | 33.319.914                  | 22.994.103            | 308.758.915             | 707.195.701           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Differenzkontrakten  | –                           | –                     | 19.759.075              | 106.923.561           |
| Gekaufte Optionskontrakte  | 294.752                     | 359.299               | 97.381.861              | 283.236.382           |
| Gekaufte Swaptions   | –                           | –                     | 9.599                   | 40.202                |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten   | –                           | 8.973                 | 18.747.279              | 18.420.818            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten  | 67.183                      | 67.331                | 25.462.747              | 91.871.867            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten   | 21.388                      | –                     | 2.665.711               | 3.395.463             |
| Nicht realisierter Gewinn aus Correlation-Swap-Kontrakten  | –                           | –                     | –                       | 379.911               |
| Nicht realisierter Gewinn aus Variance-Swap-Kontrakten   | –                           | –                     | 1.981.004               | 3.828.212             |
| Nicht realisierter Gewinn aus Volatility-Swap-Kontrakten   | –                           | –                     | 7.374.211               | 18.426.175            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten   | –                           | –                     | –                       | 3.727.082             |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten  | –                           | –                     | –                       | 686.246               |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> | <b>33.703.237</b>           | <b>23.429.706</b>     | <b>572.847.491</b>      | <b>1.476.262.171</b>  |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

|   | Tactical Macro <sup>1</sup> (Fortsetzung) |                       | Uncorrelated Strategies (Fortsetzung) |                       |
|---|---|-----------------------|---------------------------------------|-----------------------|
|   | Zum 31. Dezember 2024                     | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024                 | Zum 31. Dezember 2023 |
|   | Zeitwert<br>US\$                          | Zeitwert<br>US\$      | Zeitwert<br>US\$                      | Zeitwert<br>US\$      |
| <b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>                  |   |                       |                                       |                       |
| Nicht realisierter Verlust aus Differenzkontrakten  | –   | –                     | (13.402.670)                          | (20.691.238)          |
| Verkaufte Optionskontrakte  | (294.752)                                 | (197.253)             | (71.822.543)                          | (378.717.224)         |
| Verkaufte Swaptionen  | –   | –                     | –                                     | (29.043)              |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten   | –   | (28.337)              | (11.482.072)                          | (24.593.398)          |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten  | (296.634)                                 | (36.811)              | (45.926.653)                          | (53.084.382)          |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten   | –   | –                     | –                                     | (9.089.737)           |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten   | –   | –                     | (96.227)                              | (1.305.860)           |
| Nicht realisierter Verlust aus Variance-Swap-Kontrakten   | –   | –                     | (560.959)                             | (514.676)             |
| Nicht realisierter Verlust aus Volatility-Swap-Kontrakten   | –   | –                     | (2.943.689)                           | (8.911.489)           |
| Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten   | (39.190)                                  | –                     | (1.197.807)                           | (3.021.166)           |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(630.576)</b>                          | <b>(262.401)</b>      | <b>(147.432.620)</b>                  | <b>(499.958.213)</b>  |

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

|   | US Equity             |                       | US Equity Premium     |                       |
|---|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
|   | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 |
|   | Zeitwert              | Zeitwert              | Zeitwert              | Zeitwert              |
|   | US\$                  | US\$                  | US\$                  | US\$                  |
| <b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>                     |                       |                       |                       |                       |
| Aktien  | 106.233.762           | 45.872.647            | –                     | –                     |
| Staatsanleihen  | –                     | –                     | 634.072.321           | 663.357.136           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten   | 490.960               | 1.253.492             | 541.191               | 12.128.805            |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>    | <b>106.724.722</b>    | <b>47.126.139</b>     | <b>634.613.512</b>    | <b>675.485.941</b>    |
| <b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>                  |                       |                       |                       |                       |
| Verkaufte Optionskontrakte  | –                     | –                     | (13.165.220)          | (5.251.795)           |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten  | (1.588.964)           | (118.963)             | (8.824.034)           | (538.104)             |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(1.588.964)</b>    | <b>(118.963)</b>      | <b>(21.989.254)</b>   | <b>(5.789.899)</b>    |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

|   | US Large Cap Value    |                       | US Long Short Equity  |                       |
|---|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
|   | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 |
|   | Zeitwert<br>US\$      | Zeitwert<br>US\$      | Zeitwert<br>US\$      | Zeitwert<br>US\$      |
| <b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>                     |                       |                       |                       |                       |
| Unternehmensanleihen  | –                     | –                     | 0                     | 7.670.535             |
| Aktien  | 957.724.430           | 1.847.675.317         | 192.325.812           | 166.583.403           |
| Immobilienaktiengesellschaften  | 39.459.548            | 3.901.309             | 2.971.995             | 3.534.047             |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen  | –                     | –                     | 497.587               | 487.831               |
| Gekaufte Optionskontrakte   | –                     | –                     | 23.868                | –                     |
| Nicht realisierter Gewinn aus Differenzkontrakten   | –                     | –                     | 961.594               | 624.429               |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten  | –                     | –                     | 2.592.720             | –                     |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten   | 163.005               | 1.119.012             | 460.982               | 3.283.704             |
| Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten  | –                     | –                     | 9.764                 | –                     |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>    | <b>997.346.983</b>    | <b>1.852.695.638</b>  | <b>199.844.322</b>    | <b>182.183.949</b>    |
| <b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>                  |                       |                       |                       |                       |
| Verkaufte Optionskontrakte  | –                     | –                     | (18.180)              | (15.714)              |
| Nicht realisierter Verlust aus Differenzkontrakten  | –                     | –                     | (149.241)             | (2.740.096)           |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten   | –                     | –                     | –                     | (1.003.428)           |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten  | (1.856.005)           | (115.827)             | (5.681.909)           | (342.870)             |
| Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten   | –                     | –                     | (882.248)             | (4.635.993)           |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(1.856.005)</b>    | <b>(115.827)</b>      | <b>(6.731.578)</b>    | <b>(8.738.101)</b>    |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

|   | US Multi Cap Opportunities |                       | US Real Estate Securities |                       |
|---|----------------------------|-----------------------|---------------------------|-----------------------|
|   | Zum 31. Dezember 2024      | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024     | Zum 31. Dezember 2023 |
|   | Zeitwert<br>US\$           | Zeitwert<br>US\$      | Zeitwert<br>US\$          | Zeitwert<br>US\$      |
| <b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>                     |                            |                       |                           |                       |
| Aktien  | 387.941.733                | 396.982.739           | 9.235.982                 | –                     |
| Immobilienaktiengesellschaften  | –                          | –                     | 423.305.104               | 519.992.632           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten   | 500.460                    | 1.843.892             | 1.269.806                 | 2.358.847             |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>    | <b>388.442.193</b>         | <b>398.826.631</b>    | <b>433.810.892</b>        | <b>522.351.479</b>    |
| <b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>                  |                            |                       |                           |                       |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten  | (3.544.061)                | (325.170)             | (4.322.763)               | (441.683)             |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(3.544.061)</b>         | <b>(325.170)</b>      | <b>(4.322.763)</b>        | <b>(441.683)</b>      |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

|   | US Small Cap          |                       | US Small Cap Intrinsic Value |                       |
|---|-----------------------|-----------------------|------------------------------|-----------------------|
|   | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024        | Zum 31. Dezember 2023 |
|   | Zeitwert<br>US\$      | Zeitwert<br>US\$      | Zeitwert<br>US\$             | Zeitwert<br>US\$      |
| <b>Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>                     |                       |                       |                              |                       |
| Aktien  | 874.911.622           | 622.291.910           | 395.261.275                  | 299.826.372           |
| Immobilienaktiengesellschaften  | –                     | –                     | –                            | 1.910.421             |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten   | 281.334               | 747.370               | 42.287                       | –                     |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>    | <b>875.192.956</b>    | <b>623.039.280</b>    | <b>395.303.562</b>           | <b>301.736.793</b>    |
| <b>Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b>                  |                       |                       |                              |                       |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten  | (1.942.634)           | (137.144)             | (547.761)                    | (398)                 |
| <b>Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> | <b>(1.942.634)</b>    | <b>(137.144)</b>      | <b>(547.761)</b>             | <b>(398)</b>          |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE

Alle Kassenbestände werden bei Brown Brothers Harriman & Co. oder bei vom Fonds genehmigten Drittinstituten als Tagesgeldeinlagen oder direkt bei einer Unterdepotbank gehalten. In den nachfolgenden Tabellen ist das Risiko aufgeführt, dem der Fonds durch die aufgeführten Institute mit seinen Bareinlagen am 31. Dezember 2024 und am 31. Dezember 2023 ausgesetzt war.

|   | Absolute Return Multi Strategy* |                       | Asia Responsible Transition Bond |                       | China A-Share Equity  |                       |
|---|---------------------------------|-----------------------|----------------------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
|   | Zum 31. Dezember 2024           | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024            | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 |
|   | US\$                            | US\$                  | US\$                             | US\$                  | CNY                   | CNY                   |
| ANZ Bank, Hong Kong                         | -                               | -                     | -                                | -                     | -                     | 10.286                |
| ANZ Bank, London                            | 4.928                           | 7.009                 | -                                | -                     | -                     | -                     |
| Bank of Montreal, London                    | -                               | 7.012                 | -                                | -                     | -                     | -                     |
| Bank of Nova Scotia, Toronto                | 4.928                           | 7.009                 | -                                | -                     | -                     | -                     |
| BBH, New York                               | 40.361                          | 42.344                | -                                | -                     | 7                     | -                     |
| BNP Paribas, Paris                          | -                               | -                     | 552                              | -                     | 1.608                 | -                     |
| Brown Brothers Harriman & Co                | 101.159                         | 425                   | 77.989                           | 85.097                | 196.426               | 1.064.042             |
| Canadian Imperial Bank of Commerce, Toronto | 4.928                           | -                     | -                                | -                     | -                     | -                     |
| Citibank, New York                          | 4.928                           | 7.012                 | -                                | 2.623.771             | -                     | -                     |
| DNB, Oslo                                   | 2.087                           | 6                     | -                                | -                     | -                     | -                     |
| JPMorgan Chase, New York                    | 4.928                           | 7.009                 | 1.755.367                        | -                     | -                     | -                     |
| Royal Bank of Canada, Toronto               | 4.928                           | 7.012                 | -                                | -                     | -                     | -                     |
| Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm    | 4.928                           | 7.009                 | -                                | -                     | -                     | -                     |
| Sumitomo, Tokyo                             | 4.928                           | 7.012                 | 438                              | -                     | -                     | 517                   |
| <b>Insgesamt</b>                            | <b>183.031</b>                  | <b>98.859</b>         | <b>1.834.346</b>                 | <b>2.708.868</b>      | <b>198.041</b>        | <b>1.074.845</b>      |

\* Das Portfolio wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

|  | China Bond            |                       | China Equity          |                       | Climate Innovation <sup>1</sup> |                       |
|--|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|---------------------------------|-----------------------|
|  | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024           | Zum 31. Dezember 2023 |
|  | CNY                   | CNY                   | US\$                  | US\$                  | US\$                            | US\$                  |
| ANZ Bank, Hong Kong                      | -                     | -                     | -                     | -                     | -                               | 2                     |
| Bank of Montreal, London                 | -                     | 4.780.550             | -                     | -                     | -                               | -                     |
| BBH, New York                            | 4                     | 4                     | -                     | -                     | -                               | -                     |
| BNP Paribas, Paris                       | -                     | -                     | 4.063.658             | -                     | 3                               | -                     |
| Brown Brothers Harriman & Co             | 5.465.161             | 4.665.103             | 290.669               | 2.865.781             | 386                             | 364                   |
| Citibank, New York                       | -                     | -                     | 34.373                | -                     | -                               | 83.482                |
| DNB, Oslo                                | -                     | -                     | -                     | -                     | -                               | 27                    |
| HSBC Bank Plc, Hong Kong                 | -                     | -                     | -                     | 2.907.393             | -                               | -                     |
| JPMorgan Chase, New York                 | 2.090.685             | -                     | -                     | -                     | -                               | -                     |
| Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm | -                     | 954                   | -                     | 244.016               | -                               | -                     |
| Sumitomo, Tokyo                          | 949                   | -                     | -                     | -                     | 121.437                         | -                     |
| <b>Insgesamt</b>                         | <b>7.556.799</b>      | <b>9.446.611</b>      | <b>4.388.700</b>      | <b>6.017.190</b>      | <b>121.826</b>                  | <b>83.875</b>         |

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

|   | CLO Income            |                       | Commodities           |                       | Corporate Hybrid Bond |                       |
|---|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
|   | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 |
|   | US\$                  | US\$                  | US\$                  | US\$                  | EUR                   | EUR                   |
| Bank of Montreal, London                    | -                     | -                     | -                     | 684.552               | -                     | -                     |
| BNP Paribas, Paris                          | -                     | -                     | -                     | -                     | 2                     | -                     |
| Brown Brothers Harriman & Co                | 181.961               | 51.817                | 74.439                | 92.067                | 247.601               | 342.084               |
| Canadian Imperial Bank of Commerce, Toronto | -                     | -                     | 10.831.021            | -                     | -                     | -                     |
| Citibank, New York                          | -                     | 12.233.975            | -                     | 10.810.004            | -                     | 39.076.989            |
| DNB, Oslo                                   | -                     | -                     | -                     | -                     | -                     | 1.341.143             |
| HSBC Bank Plc, London                       | -                     | -                     | -                     | -                     | 34.508.250            | 38.663.608            |
| JPMorgan Chase, New York                    | 6.261.172             | -                     | -                     | 10.810.004            | 10.682.574            | -                     |
| Royal Bank of Canada, Toronto               | -                     | -                     | 969.910               | -                     | -                     | -                     |
| Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm    | 7.166.576             | -                     | -                     | -                     | 67.137.912            | -                     |
| Sumitomo, Tokyo                             | -                     | 1.418                 | 10.831.021            | 10.810.004            | -                     | -                     |
| <b>Insgesamt</b>                            | <b>13.609.709</b>     | <b>12.287.210</b>     | <b>22.706.391</b>     | <b>33.206.631</b>     | <b>112.576.339</b>    | <b>79.423.824</b>     |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

|  | Developed Market FMP – 2027 <sup>1</sup> |                       | EMD Corporate – Social and Environmental Transition |                       | Emerging Market Debt - Hard Currency |                       |
|--|--|-----------------------|---|-----------------------|--------------------------------------|-----------------------|
|  | Zum 31. Dezember 2024                    | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024                               | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024                | Zum 31. Dezember 2023 |
|  | US\$                                     | US\$                  | US\$  | US\$                  | US\$                                 | US\$                  |
| Barclays Bank, London                    | -  | -                     | -   | -                     | -                                    | 29                    |
| BBH, New York                            | -  | -                     | -   | -                     | 1                                    | -                     |
| BNP Paribas, Paris                       | -  | -                     | -   | -                     | 19                                   | 16                    |
| Brown Brothers Harriman & Co             | 1.201                                    | 1.653                 | 118.330   | 131.390               | 90.168                               | 8.540                 |
| Citibank, New York                       | -  | -                     | 1.382.896   | -                     | -                                    | -                     |
| DNB, Oslo                                | -  | -                     | -   | -                     | -                                    | 2.297.690             |
| HSBC Bank Plc, London                    | -  | -                     | 6   | -                     | 29                                   | -                     |
| JPMorgan Chase, New York                 | -  | 501.784               | -   | -                     | -                                    | -                     |
| Royal Bank of Canada, London             | -  | -                     | 497.918   | -                     | -                                    | -                     |
| Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm | -  | -                     | -   | 6                     | -                                    | -                     |
| Sumitomo, Tokyo                          | 562.576                                  | -                     | -   | 3.844.875             | 39.788.818                           | -                     |
| <b>Insgesamt</b>                         | <b>563.777</b>                           | <b>503.437</b>        | <b>1.999.150</b>                                    | <b>3.976.271</b>      | <b>39.879.035</b>                    | <b>2.306.275</b>      |

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

|  | Emerging Market Debt - Local Currency |                       | Emerging Market Debt Blend |                       | Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend |                       |
|--|---------------------------------------|-----------------------|----------------------------|-----------------------|---|-----------------------|
|  | Zum 31. Dezember 2024                 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024      | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024                                   | Zum 31. Dezember 2023 |
|  | US\$                                  | US\$                  | US\$                       | US\$                  | US\$  | US\$                  |
| Bank of Nova Scotia, Toronto             | 797                                   | 839                   | 265                        | 279                   | 1   | 2                     |
| BNP Paribas, Paris                       | -                                     | -                     | 28                         | 28                    | 7   | -                     |
| Brown Brothers Harriman & Co             | 5.604.954                             | 1.021.127             | 5.899.044                  | 412.150               | 388.124   | 33.259                |
| Citibank, New York                       | -                                     | -                     | -                          | -                     | 46.451  | -                     |
| DNB, Oslo                                | -                                     | 2                     | -                          | -                     | -   | -                     |
| HSBC Bank Plc, Hong Kong                 | -                                     | 2                     | -                          | 2                     | -   | -                     |
| JPMorgan Chase, New York                 | 7.301.682                             | -                     | 36.234.355                 | -                     | -   | -                     |
| Nordea Bank, Oslo                        | -                                     | -                     | -                          | -                     | -   | 7                     |
| Royal Bank of Canada, Toronto            | -                                     | -                     | -                          | 14.175.872            | -   | -                     |
| Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm | -                                     | 4                     | 4.036                      | 3.946                 | -   | 2.600.660             |
| Sumitomo, Tokyo                          | 2.414                                 | 33.877.656            | 3.114.575                  | 503.538               | 4.027.559   | 120.150               |
| <b>Insgesamt</b>                         | <b>12.909.847</b>                     | <b>34.899.630</b>     | <b>45.252.303</b>          | <b>15.095.815</b>     | <b>4.462.142</b>  | <b>2.754.078</b>      |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

|  | Emerging Markets Equity |                       | Emerging Markets Select Equity* |                       | Euro Bond             |                       |
|--|-------------------------|-----------------------|---------------------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
|  | Zum 31. Dezember 2024   | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024           | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 |
|  | US\$                    | US\$                  | US\$                            | US\$                  | EUR                   | EUR                   |
| ANZ Bank, London                         | 2                       | -                     | -                               | 7.479                 | -                     | -                     |
| ANZ Bank, Hong Kong                      | -                       | 571                   | -                               | -                     | -                     | -                     |
| Bank of Montreal, London                 | -                       | -                     | -                               | 7.479                 | -                     | -                     |
| Bank of Nova Scotia, Toronto             | -                       | 6.154                 | -                               | 7.479                 | -                     | -                     |
| BBH, New York                            | -                       | -                     | -                               | 99.428                | -                     | -                     |
| BNP Paribas, Paris                       | 385                     | 267                   | -                               | -                     | -                     | -                     |
| Brown Brothers Harriman & Co             | 1.100.630               | 375.937               | -                               | 4.706                 | 2.081                 | 447                   |
| Citibank, New York                       | -                       | -                     | -                               | 7.479                 | -                     | -                     |
| DNB, Oslo                                | -                       | 3                     | -                               | -                     | 408.266               | -                     |
| HSBC Bank Plc, Hong Kong                 | -                       | 2                     | -                               | 6                     | -                     | -                     |
| JPMorgan Chase, New York                 | -                       | -                     | -                               | 7.479                 | -                     | -                     |
| Royal Bank of Canada, Toronto            | -                       | -                     | -                               | 7.479                 | -                     | -                     |
| Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm | -                       | 2.913.245             | -                               | 7.479                 | -                     | -                     |
| Sumitomo, Tokyo                          | 1.788.397               | 3                     | -                               | 7.479                 | -                     | 127.229               |
| <b>Insgesamt</b>                         | <b>2.889.414</b>        | <b>3.296.182</b>      | <b>-</b>                        | <b>163.972</b>        | <b>410.347</b>        | <b>127.676</b>        |

\* Das Portfolio wurde am 7. September 2023 aufgelöst.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

|  | Euro Bond Absolute Return    |                              | European High Yield Bond     |                              | European Sustainable Equity  |                              |
|--|------------------------------|------------------------------|------------------------------|------------------------------|------------------------------|------------------------------|
|  | Zum 31. Dezember 2024<br>EUR | Zum 31. Dezember 2023<br>EUR | Zum 31. Dezember 2024<br>EUR | Zum 31. Dezember 2023<br>EUR | Zum 31. Dezember 2024<br>EUR | Zum 31. Dezember 2023<br>EUR |
| BBH, New York                              | -                            | -                            | -                            | -                            | 122                          | -                            |
| BNP Paribas, Paris                         | -                            | -                            | 3                            | -                            | 53                           | 121                          |
| Brown Brothers Harriman & Co               | 1.559                        | 1.384                        | 27.706                       | 56.985                       | 2.695                        | 2.807                        |
| Canadian Imperial Bank of Commerce, London | -                            | -                            | 596.165                      | -                            | -                            | -                            |
| Citibank, London                           | -                            | 72.050                       | -                            | -                            | -                            | -                            |
| Citibank, New York                         | -                            | 27.840                       | -                            | -                            | -                            | -                            |
| DNB, Oslo                                  | -                            | -                            | 16.981.008                   | -                            | 151                          | 101                          |
| HSBC Bank Plc, Hong Kong                   | -                            | -                            | -                            | 1                            | -                            | -                            |
| HSBC Bank Plc, London                      | -                            | -                            | -                            | -                            | 400                          | -                            |
| JPMorgan Chase, New York                   | -                            | -                            | 351.898                      | -                            | -                            | -                            |
| MUFG Bank, Tokyo                           | 2.366                        | -                            | -                            | -                            | -                            | -                            |
| Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm   | 1.854.139                    | 359.043                      | -                            | -                            | 1.331.940                    | 143                          |
| Sumitomo, Tokyo                            | 17.809                       | -                            | -                            | 16.567.542                   | -                            | 1.124.096                    |
| <b>Insgesamt</b>                           | <b>1.875.873</b>             | <b>460.317</b>               | <b>17.956.780</b>            | <b>16.624.528</b>            | <b>1.335.361</b>             | <b>1.127.268</b>             |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

|  | Event Driven          |                       | Global Bond           |                       | Global Diversified Income FMP – 2024* |                       |
|--|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|---------------------------------------|-----------------------|
|  | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024                 | Zum 31. Dezember 2023 |
|  | US\$                  | US\$                  | US\$                  | US\$                  | US\$                                  | US\$                  |
| ANZ Bank, Hong Kong                      | -                     | -                     | 139.462               | 5.105                 | -                                     | -                     |
| Bank of Nova Scotia, Toronto             | -                     | -                     | 1.998.577             | 292.499               | -                                     | -                     |
| BBH, New York                            | -                     | -                     | 13.123                | -                     | -                                     | -                     |
| BNP Paribas, Paris                       | -                     | -                     | 3.679                 | 720                   | -                                     | -                     |
| Brown Brothers Harriman & Co             | 54.370                | 46.874                | 78.522                | 11.337                | 48.338                                | 24.299                |
| Citibank, New York                       | -                     | 8.836.292             | -                     | -                     | -                                     | 10.930.286            |
| DNB, Oslo                                | -                     | -                     | 119                   | 4.233                 | -                                     | -                     |
| HSBC Bank Plc, London                    | -                     | 2.014                 | 1.421.218             | -                     | -                                     | -                     |
| JPMorgan Chase, New York                 | 4.743.085             | 4.614.996             | -                     | 737.217               | -                                     | 72.364                |
| MUFG Bank, Tokyo                         | -                     | -                     | 6.499                 | 6.259                 | -                                     | -                     |
| Nordea Bank, Oslo                        | -                     | -                     | -                     | 35                    | -                                     | -                     |
| Royal Bank of Canada, London             | 9                     | -                     | -                     | -                     | -                                     | -                     |
| Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm | 2.048                 | -                     | -                     | 25.934                | -                                     | -                     |
| Sumitomo, Tokyo                          | 19.810.670            | -                     | 1.080.597             | 78.733                | -                                     | -                     |
| <b>Insgesamt</b>                         | <b>24.610.182</b>     | <b>13.500.176</b>     | <b>4.741.796</b>      | <b>1.162.072</b>      | <b>48.338</b>                         | <b>11.026.949</b>     |

\* Das Portfolio wurde am 28. Juni 2024 aufgelöst.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

|  | Global Equity Megatrends |                       | Global Flexible Credit Income |                       | Global High Yield Engagement |                       |
|--|--------------------------|-----------------------|-------------------------------|-----------------------|------------------------------|-----------------------|
|  | Zum 31. Dezember 2024    | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024         | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024        | Zum 31. Dezember 2023 |
|  | US\$                     | US\$                  | US\$                          | US\$                  | US\$                         | US\$                  |
| ANZ Bank, London                           | 25.010.275               | -                     | -                             | -                     | -                            | -                     |
| Bank of Nova Scotia, Toronto               | 23                       | 31                    | 753                           | 792                   | -                            | -                     |
| Barclays Bank, London                      | -                        | -                     | 125.848                       | -                     | -                            | -                     |
| BNP Paribas, Paris                         | 3                        | -                     | -                             | -                     | 1.099                        | 1.176                 |
| Brown Brothers Harriman & Co               | 57.490                   | 10.664                | 54.131                        | 53.406                | 24.526                       | 48.339                |
| Canadian Imperial Bank of Commerce, London | -                        | -                     | -                             | -                     | 125.886                      | -                     |
| Citibank, London                           | -                        | -                     | 1.543.247                     | -                     | -                            | -                     |
| DNB, Oslo                                  | -                        | -                     | -                             | -                     | 181.938                      | -                     |
| HSBC Bank Plc, London                      | 259                      | 54                    | -                             | -                     | -                            | -                     |
| Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm   | -                        | -                     | -                             | 327.014               | -                            | 394.203               |
| Sumitomo, Tokyo                            | -                        | 5.251.653             | 4.915.709                     | 25.100.882            | 6.653.705                    | 10.265.487            |
| <b>Insgesamt</b>                           | <b>25.068.050</b>        | <b>5.262.402</b>      | <b>6.639.688</b>              | <b>25.482.094</b>     | <b>6.987.154</b>             | <b>10.709.205</b>     |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

|   | Global High Yield Sustainable Action* |                       | Global Investment Grade Credit |                       | Global Opportunistic Bond |                       |
|---|---------------------------------------|-----------------------|--------------------------------|-----------------------|---------------------------|-----------------------|
|   | Zum 31. Dezember 2024                 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024          | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024     | Zum 31. Dezember 2023 |
|   | US\$                                  | US\$                  | US\$                           | US\$                  | US\$                      | US\$                  |
| ANZ Bank, Hong Kong                         | -                                     | -                     | -                              | -                     | 1.638.135                 | -                     |
| ANZ Bank, London                            | -                                     | 1.059                 | -                              | -                     | -                         | 15.142                |
| Bank of Montreal, London                    | -                                     | 1.060                 | -                              | -                     | -                         | -                     |
| Bank of Nova Scotia, Toronto                | -                                     | 1.060                 | 79                             | 69                    | 13.033                    | 3.929                 |
| Barclays Bank, London                       | -                                     | 220                   | -                              | -                     | -                         | -                     |
| BBH, New York                               | -                                     | 42.897                | -                              | -                     | -                         | -                     |
| BNP Paribas, Paris                          | -                                     | -                     | -                              | -                     | 2.722                     | 5.414                 |
| Brown Brothers Harriman & Co                | -                                     | 222                   | 17.976                         | 12.902                | 246.260                   | 214.704               |
| Canadian Imperial Bank of Commerce, Toronto | -                                     | -                     | -                              | -                     | -                         | -                     |
| Citibank, New York                          | -                                     | 1.060                 | -                              | -                     | -                         | -                     |
| DNB, Oslo                                   | -                                     | 500                   | -                              | -                     | -                         | 5.788                 |
| HSBC Bank Plc, London                       | -                                     | -                     | -                              | 1.198.923             | 383.299                   | -                     |
| JPMorgan Chase, New York                    | -                                     | 1.060                 | -                              | -                     | -                         | -                     |
| MUFG Bank, Tokyo                            | -                                     | -                     | -                              | -                     | 11.663                    | 26.850                |
| Royal Bank of Canada, Toronto               | -                                     | 1.060                 | -                              | 2.075.370             | 1.885.167                 | -                     |
| Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm    | -                                     | 1.060                 | 1.098.449                      | -                     | 5.412                     | 147.654               |
| Sumitomo, Tokyo                             | -                                     | 1.060                 | 3.890.761                      | 114.199               | 1.103.802                 | 1.109.973             |
| <b>Insgesamt</b>                            | <b>-</b>                              | <b>52.318</b>         | <b>5.007.265</b>               | <b>3.401.463</b>      | <b>5.289.493</b>          | <b>1.529.454</b>      |

\* Das Portfolio wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

|   | Global Real Estate Securities* |                       | Global Sustainable Equity |                       | Global Value          |                       |
|---|--------------------------------|-----------------------|---------------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
|   | Zum 31. Dezember 2024          | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024     | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 |
|   | US\$                           | US\$                  | US\$                      | US\$                  | US\$                  | US\$                  |
| ANZ Bank, Hong Kong                         | -                              | 5.841                 | -                         | -                     | 3                     | 36                    |
| ANZ Bank, London                            | 1.014.234                      | -                     | 1.156.289                 | -                     | -                     | 26                    |
| Bank of Nova Scotia, Toronto                | 1.014.234                      | 195                   | -                         | -                     | 564                   | 1.931                 |
| Barclays Bank, London                       | -                              | -                     | -                         | 90                    | -                     | -                     |
| BBH, New York                               | 6.508.541                      | -                     | 15                        | -                     | 210                   | -                     |
| BNP Paribas, Paris                          | 32                             | 26                    | 931                       | 17                    | 310                   | 222                   |
| Brown Brothers Harriman & Co                | 13.744                         | 1.744                 | 4.328                     | 4.806                 | 2.745                 | 7.891                 |
| Canadian Imperial Bank of Commerce, Toronto | 1.014.234                      | -                     | -                         | -                     | -                     | -                     |
| Citibank, London                            | -                              | -                     | -                         | -                     | -                     | -                     |
| Citibank, New York                          | 1.014.234                      | -                     | -                         | 775.000               | 814.586               | -                     |
| DNB, Oslo                                   | -                              | 2.409                 | 97                        | 85                    | 5                     | 2                     |
| HSBC Bank Plc, London                       | -                              | -                     | -                         | -                     | 1.401                 | -                     |
| JPMorgan Chase, New York                    | 1.014.234                      | -                     | -                         | -                     | -                     | -                     |
| Nordea Bank, Oslo                           | -                              | -                     | -                         | 946                   | -                     | 100                   |
| Royal Bank of Canada, London                | 1.014.234                      | -                     | 312                       | -                     | -                     | -                     |
| Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm    | 1.014.234                      | 67                    | 154                       | -                     | 442                   | 534.728               |
| Sumitomo, Tokyo                             | 1.014.234                      | 201.367               | -                         | 226                   | -                     | -                     |
| <b>Insgesamt</b>                            | <b>14.636.189</b>              | <b>211.649</b>        | <b>1.162.126</b>          | <b>781.170</b>        | <b>820.266</b>        | <b>544.936</b>        |

\* Das Portfolio wurde am 31. Dezember 2024 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

|                              | High Yield Bond       |                       | InnovAsia             |                       | Japan Equity Engagement |                       |
|------------------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-------------------------|-----------------------|
|                              | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024   | Zum 31. Dezember 2023 |
|                              | US\$                  | US\$                  | US\$                  | US\$                  | JPY                     | JPY                   |
| BNP Paribas, Paris           | -                     | -                     | -                     | 6                     | -                       | -                     |
| Brown Brothers Harriman & Co | 36.448                | 158.989               | 736                   | 10.719                | 4.466                   | -                     |
| Citibank, New York           | -                     | -                     | -                     | 1.118.218             | -                       | -                     |
| HSBC Bank Plc, London        | 364.849               | -                     | -                     | -                     | -                       | -                     |
| JPMorgan Chase, New York     | -                     | 73.453.680            | 476.751               | -                     | -                       | -                     |
| MUFG Bank, Tokyo             | -                     | -                     | -                     | -                     | 92.225.599              | 90.965.141            |
| Sumitomo, Tokyo              | 10.878.610            | 5.263                 | -                     | -                     | -                       | -                     |
| <b>Insgesamt</b>             | <b>11.279.907</b>     | <b>73.617.932</b>     | <b>477.487</b>        | <b>1.128.943</b>      | <b>92.230.065</b>       | <b>90.965.141</b>     |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

|  | Macro Opportunities FX* |                       | Multi-Asset Income**  |                       | Next Generation Connectivity |                       |
|--|-------------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|------------------------------|-----------------------|
|  | Zum 31. Dezember 2024   | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024        | Zum 31. Dezember 2023 |
|  | EUR                     | EUR                   | US\$                  | US\$                  | US\$                         | US\$                  |
| Bank of Montreal, London                 | -                       | 32.952                | -                     | -                     | -                            | -                     |
| Barclays Bank, London                    | -                       | 21                    | -                     | -                     | -                            | -                     |
| Brown Brothers Harriman & Co             | 35.694                  | 242                   | -                     | 58.916                | 136.251                      | 194.032               |
| Citibank, New York                       | -                       | -                     | -                     | -                     | -                            | 43.447.745            |
| HSBC Bank Plc, Hong Kong                 | -                       | -                     | -                     | -                     | -                            | 601                   |
| HSBC Bank Plc, London                    | -                       | -                     | -                     | -                     | -                            | 5                     |
| Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm | -                       | 93.660                | -                     | -                     | 7                            | -                     |
| Sumitomo, Tokyo                          | -                       | -                     | -                     | -                     | 36.869.131                   | 1.479                 |
| <b>Insgesamt</b>                         | <b>35.694</b>           | <b>126.875</b>        | <b>-</b>              | <b>58.916</b>         | <b>37.005.389</b>            | <b>43.643.862</b>     |

\* Das Portfolio wurde am 8. Februar 2024 aufgelöst.

\*\* Das Portfolio wurde am 6. Juli 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

|  | Next Generation Mobility |                       | Next Generation Space Economy |                       | Short Duration Emerging Market Debt |                       |
|--|--------------------------|-----------------------|-------------------------------|-----------------------|-------------------------------------|-----------------------|
|  | Zum 31. Dezember 2024    | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024         | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024               | Zum 31. Dezember 2023 |
|  | US\$                     | US\$                  | US\$                          | US\$                  | US\$                                | US\$                  |
| ANZ Bank, London                         | -                        | 2                     | -                             | -                     | -                                   | -                     |
| Bank of Nova Scotia, Toronto             | 2.085.407                | 58.961                | -                             | -                     | -                                   | -                     |
| BNP Paribas, Paris                       | -                        | -                     | 9                             | 3                     | -                                   | -                     |
| Brown Brothers Harriman & Co             | 8.820                    | 44.850                | 8.717                         | 2.565                 | 48.636                              | 76.426                |
| Citibank, New York                       | -                        | 11.585.167            | 3.098.207                     | 940.668               | -                                   | 9.105.400             |
| DNB, Oslo                                | -                        | 9                     | -                             | -                     | -                                   | -                     |
| HSBC Bank Plc, Hong Kong                 | 33                       | 12                    | -                             | -                     | -                                   | -                     |
| HSBC Bank Plc, London                    | -                        | -                     | -                             | 6                     | -                                   | -                     |
| JPMorgan Chase, New York                 | -                        | -                     | -                             | -                     | 17.771.653                          | -                     |
| MUFG Bank, Tokyo                         | -                        | -                     | -                             | -                     | -                                   | 4                     |
| Royal Bank of Canada, London             | -                        | 57                    | -                             | -                     | -                                   | -                     |
| Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm | -                        | 2                     | -                             | -                     | 215                                 | -                     |
| Sumitomo, Tokyo                          | 356                      | -                     | -                             | 46                    | 3.596.557                           | 5.076.125             |
| <b>Insgesamt</b>                         | <b>2.094.616</b>         | <b>11.689.060</b>     | <b>3.106.933</b>              | <b>943.288</b>        | <b>21.417.061</b>                   | <b>14.257.955</b>     |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

|  | Short Duration Euro Bond |                       | Short Duration High Yield Engagement |                       | Strategic Income      |                       |
|--|--------------------------|-----------------------|--------------------------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
|  | Zum 31. Dezember 2024    | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024                | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 |
|  | EUR                      | EUR                   | US\$                                 | US\$                  | US\$                  | US\$                  |
| ANZ Bank, Hong Kong                        | -                        | -                     | -                                    | -                     | 160                   | 134                   |
| Bank of Nova Scotia, Toronto               | -                        | -                     | -                                    | -                     | -                     | 51.500.431            |
| Barclays Bank, London                      | 7.946                    | -                     | -                                    | 2.665.526             | -                     | -                     |
| BNP Paribas, Paris                         | 2                        | -                     | 410                                  | 395                   | 1.881.556             | 1.815.812             |
| Brown Brothers Harriman & Co               | 166.294                  | 26.934                | 38.098                               | 151.589               | 201.794               | 342.923               |
| Canadian Imperial Bank of Commerce, London | -                        | -                     | -                                    | -                     | 5.024.685             | -                     |
| Citibank, London                           | 79.261.898               | -                     | -                                    | -                     | -                     | -                     |
| Citibank, New York                         | -                        | 94.551                | -                                    | 41.651.733            | -                     | -                     |
| DNB, Oslo                                  | -                        | -                     | -                                    | -                     | 2.910.448             | 41                    |
| HSBC Bank Plc, Hong Kong                   | -                        | -                     | -                                    | 3                     | -                     | -                     |
| HSBC Bank Plc, London                      | -                        | -                     | -                                    | -                     | -                     | 216.020               |
| JPMorgan Chase, New York                   | 105.809                  | -                     | -                                    | -                     | 139.343.873           | -                     |
| MUFG Bank, Tokyo                           | -                        | -                     | 9                                    | 10                    | 6.114.876             | -                     |
| Nordea Bank, Oslo                          | -                        | -                     | -                                    | -                     | -                     | 5.343                 |
| Royal Bank of Canada, London               | -                        | 11.093.807            | -                                    | -                     | -                     | -                     |
| Royal Bank of Canada, Toronto              | -                        | -                     | 2.678.476                            | -                     | 344.808               | -                     |
| Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm   | -                        | 7.280                 | -                                    | -                     | -                     | -                     |
| Sumitomo, Tokyo                            | -                        | -                     | 29.511                               | -                     | -                     | 1.324.930             |
| <b>Insgesamt</b>                           | <b>79.541.949</b>        | <b>11.222.572</b>     | <b>2.746.504</b>                     | <b>44.469.256</b>     | <b>155.822.200</b>    | <b>55.205.634</b>     |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

|  | Sustainable Asia High Yield |                       | Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency |                       | Tactical Macro <sup>1</sup> |                       |
|--|-----------------------------|-----------------------|--|-----------------------|-----------------------------|-----------------------|
|  | Zum 31. Dezember 2024       | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024                            | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024       | Zum 31. Dezember 2023 |
|  | US\$                        | US\$                  | US\$   | US\$                  | US\$                        | US\$                  |
| Bank of Nova Scotia, Toronto             | -                           | -                     | -  | 4.604.889             | -                           | -                     |
| Barclays Bank, London                    | -                           | -                     | -  | -                     | 1.493                       | -                     |
| BNP Paribas, Paris                       | -                           | -                     | -  | -                     | 157                         | 148                   |
| Brown Brothers Harriman & Co             | 2.230                       | 5.263                 | 21.527   | -                     | 11.882                      | 37.013                |
| Citibank, New York                       | -                           | 1.155.619             | -  | 1.117                 | 2.520.798                   | 1.541.601             |
| JPMorgan Chase, New York                 | -                           | -                     | -  | -                     | -                           | 1.893.496             |
| MUFG Bank, Tokyo                         | -                           | -                     | -  | -                     | -                           | 753                   |
| Nordea Bank, Oslo                        | -                           | -                     | -  | -                     | -                           | 4                     |
| Royal Bank of Canada, London             | -                           | -                     | -  | -                     | 1.049                       | 43.619                |
| Royal Bank of Canada, Toronto            | 2.027.907                   | -                     | -  | -                     | -                           | -                     |
| Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm | -                           | -                     | 4.390.051  | -                     | -                           | 37.666                |
| Sumitomo, Tokyo                          | 2.064                       | 2.195                 | 2.636.882  | 2.436.526             | 268.796                     | -                     |
| <b>Insgesamt</b>                         | <b>2.032.201</b>            | <b>1.163.077</b>      | <b>7.048.460</b>                                 | <b>7.042.532</b>      | <b>2.804.175</b>            | <b>3.554.300</b>      |

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

|   | Uncorrelated Strategies       |                               | Uncorrelated Trading*         |                               | US Equity                     |                               |
|---|-------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|
|   | Zum 31. Dezember 2024<br>US\$ | Zum 31. Dezember 2023<br>US\$ | Zum 31. Dezember 2024<br>US\$ | Zum 31. Dezember 2023<br>US\$ | Zum 31. Dezember 2024<br>US\$ | Zum 31. Dezember 2023<br>US\$ |
| ANZ Bank, Hong Kong                         | 4.700                         | 218.464                       | -                             | -                             | -                             | -                             |
| ANZ Bank, London                            | 20.872.745                    | 952.642                       | -                             | -                             | -                             | -                             |
| Bank of Montreal, London                    | -                             | 8.552.039                     | -                             | -                             | -                             | -                             |
| Bank of Nova Scotia, Toronto                | 4.013.679                     | 4.626.950                     | -                             | -                             | -                             | -                             |
| Barclays Bank, London                       | 1.639                         | 92.899                        | -                             | -                             | -                             | -                             |
| BBH, New York                               | 3.901.530                     | 92.993                        | -                             | -                             | -                             | -                             |
| BNP Paribas, Paris                          | 3.719.488                     | 3.060.417                     | -                             | -                             | -                             | -                             |
| Brown Brothers Harriman & Co                | 2.445.901                     | 2.270.350                     | -                             | 198.922                       | 5.649                         | 9.332                         |
| Canadian Imperial Bank of Commerce, London  | 252.773                       | -                             | -                             | -                             | -                             | -                             |
| Canadian Imperial Bank of Commerce, Toronto | 237.468                       | -                             | -                             | -                             | -                             | -                             |
| Citibank, London                            | 168.225                       | 2.621.204                     | -                             | -                             | -                             | -                             |
| Citibank, New York                          | 8.723.181                     | 92.203.361                    | -                             | -                             | -                             | -                             |
| DNB, Oslo                                   | 629.705                       | 4.926.275                     | -                             | -                             | -                             | -                             |
| HSBC Bank Plc, Hong Kong                    | 314.809                       | 1.359.612                     | -                             | -                             | -                             | -                             |
| HSBC Bank Plc, London                       | 1.649.120                     | 1.282.249                     | -                             | -                             | -                             | -                             |
| JPMorgan Chase, New York                    | 68.667.672                    | 40.362.701                    | -                             | -                             | -                             | -                             |
| MUFG Bank, Tokyo                            | 129.218                       | 110.182                       | -                             | -                             | -                             | -                             |
| Nordea Bank, Oslo                           | -                             | 151.618                       | -                             | -                             | -                             | -                             |
| Royal Bank of Canada, London                | -                             | 618.592                       | -                             | -                             | -                             | -                             |
| Royal Bank of Canada, Toronto               | 9.683.107                     | 15.475.809                    | -                             | -                             | -                             | -                             |
| Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm    | 1.156.779                     | 11.432.447                    | -                             | -                             | 2.208.091                     | 2.307.738                     |
| Sumitomo, Tokyo                             | 21.677.338                    | 25.584.764                    | -                             | -                             | -                             | -                             |
| <b>Insgesamt</b>                            | <b>148.249.077</b>            | <b>215.995.568</b>            | <b>-</b>                      | <b>198.922</b>                | <b>2.213.740</b>              | <b>2.317.070</b>              |

\* Das Portfolio wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

|  | US Equity Premium     |                       | US Large Cap Value    |                       | US Long Short Equity  |                       |
|--|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
|  | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 |
|  | US\$                  | US\$                  | US\$                  | US\$                  | US\$                  | US\$                  |
| Bank of Montreal, London                 | -                     | -                     | -                     | -                     | -                     | 4.906.575             |
| Barclays Bank, London                    | -                     | -                     | 1                     | -                     | -                     | -                     |
| BBH, New York                            | -                     | -                     | -                     | -                     | -                     | 1                     |
| BNP Paribas, Paris                       | 142                   | -                     | -                     | -                     | 14                    | 14                    |
| Brown Brothers Harriman & Co             | 144.634               | 269.501               | 117.745               | 366.677               | 69.771                | 16.317                |
| Citibank, New York                       | -                     | -                     | -                     | 122.081.772           | -                     | -                     |
| HSBC Bank Plc, Hong Kong                 | -                     | 147                   | -                     | -                     | -                     | -                     |
| JPMorgan Chase, New York                 | -                     | -                     | 17.922.866            | -                     | -                     | -                     |
| Royal Bank of Canada, London             | -                     | -                     | -                     | -                     | -                     | 3.995                 |
| Royal Bank of Canada, Toronto            | 44.380.614            | 4.824.800             | -                     | -                     | 10.686.883            | -                     |
| Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm | -                     | 3                     | -                     | 7.038.957             | -                     | -                     |
| Sumitomo, Tokyo                          | -                     | 51.076.090            | 6                     | 6                     | 15.825.301            | -                     |
| <b>Insgesamt</b>                         | <b>44.525.390</b>     | <b>56.170.541</b>     | <b>18.040.618</b>     | <b>129.487.412</b>    | <b>26.581.969</b>     | <b>4.926.902</b>      |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

|  | US Multi Cap Opportunities |                       | US Real Estate Securities |                       | US Small Cap          |                       |
|--|----------------------------|-----------------------|---------------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
|  | Zum 31. Dezember 2024      | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024     | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 |
|  | US\$                       | US\$                  | US\$                      | US\$                  | US\$                  | US\$                  |
| ANZ Bank, Hong Kong                      | 5                          | -                     | -                         | -                     | -                     | -                     |
| ANZ Bank, London                         | -                          | -                     | 787                       | 847                   | -                     | 3                     |
| Bank of Montreal, London                 | -                          | -                     | -                         | 12.777.934            | -                     | -                     |
| Bank of Nova Scotia, Toronto             | -                          | -                     | -                         | -                     | 12.491                | 13.163                |
| Barclays Bank, London                    | -                          | -                     | -                         | -                     | -                     | 28.653                |
| BBH, New York                            | -                          | -                     | 1                         | -                     | -                     | -                     |
| BNP Paribas, Paris                       | 10                         | 5                     | 2                         | -                     | -                     | -                     |
| Brown Brothers Harriman & Co             | -                          | 6.078                 | 29.979                    | 45.962                | 55.123                | 28.003                |
| DNB, Oslo                                | -                          | 6                     | 5                         | -                     | 2                     | -                     |
| HSBC Bank Plc, Hong Kong                 | -                          | 2                     | -                         | -                     | -                     | -                     |
| HSBC Bank Plc, London                    | -                          | -                     | 1                         | -                     | 29.317                | -                     |
| Royal Bank of Canada, London             | -                          | -                     | -                         | -                     | 3                     | -                     |
| Royal Bank of Canada, Toronto            | -                          | 2.014.851             | -                         | -                     | -                     | -                     |
| Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm | -                          | -                     | -                         | 6                     | -                     | 12.674.878            |
| Sumitomo, Tokyo                          | 806.590                    | -                     | 8.930.292                 | -                     | 12.476.865            | 3                     |
| <b>Insgesamt</b>                         | <b>806.605</b>             | <b>2.020.942</b>      | <b>8.961.067</b>          | <b>12.824.749</b>     | <b>12.573.801</b>     | <b>12.744.703</b>     |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

|                              | US Small Cap Intrinsic Value |                       |
|------------------------------|------------------------------|-----------------------|
|                              | Zum 31. Dezember 2024        | Zum 31. Dezember 2023 |
|                              | US\$                         | US\$                  |
| Brown Brothers Harriman & Co | 38.777                       | 92.397                |
| JPMorgan Chase, New York     | 5.989.527                    | -                     |
| Sumitomo, Tokyo              | -                            | 18.206.721            |
| <b>Insgesamt</b>             | <b>6.028.304</b>             | <b>18.299.118</b>     |

Entsprechend den Leitlinien der Central Bank of Ireland mit dem Titel „Umbrella Funds – Cash Accounts Holding Subscription, Redemption and Dividend Monies“ (Kassenbestände mit Zeichnungs-, Rücknahme- und Ausschüttungsgeldern), die im März 2016 herausgegeben wurden, werden eines oder mehrere Konten für die Kassenbestände des Fonds in Übereinstimmung mit den Anforderungen der CBI von der Verwaltungsstelle im Auftrag des Fonds gehalten. Derlei Konten für Kassenbestände sind dazu gedacht, nicht abgewickelte Zeichnungsgelder von Anlegern, an Anleger zahlbare Rücknahmegelder und/oder sonstige an Anleger fällige Beträge zu halten. Zum 31. Dezember 2024 beliefen sich die Gelder in diesen Konten auf 12.185.928 US\$ (31. Dezember 2023: 331.887 US\$). Jegliche zum Ende des Geschäftsjahres auf diesen Barkonten gehaltenen Gelder werden in den Gesamtbilanzen des Fonds ausgewiesen.

**FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR****4. KONTENÜBERZIEHUNG**

Per 31. Dezember 2024 und 31. Dezember 2023 werden alle in der Bilanz ausgewiesenen Überziehungskredite bei Brown Brothers Harriman & Co. gehalten.

**5. ANTEILKAPITAL**

Das genehmigte Anteilkapital des Fonds beträgt 500.000.040.000 nennwertlose Anteile und besteht aus 40.000 Zeichneranteilen ohne Nennwert sowie 500.000.000.000 gewinnberechtigten Anteilen ohne Nennwert. Die Direktoren sind befugt, bis zu 500.000.000.000 nennwertlose Anteile des Fonds zu den von ihnen für geeignet erachteten Konditionen auszugeben.

Der Fonds ist aufgrund seiner Fähigkeit, Anteile auf Aufforderung auszugeben und zurückzunehmen, eine Investmentgesellschaft mit variablem Kapital. Das Anteilskapital des Fonds ist in verschiedene Anteilsserien aufgeteilt, wobei jede Anteilsserie ein separates Investmentportfolio mit Vermögenswerten darstellt. Die Portfolios verwalten Kapital in Übereinstimmung mit den OGAW-Vorschriften und den Anlagezielen und der Anlagepolitik, die für solch ein Portfolio gelten und im vorliegenden Prospekt und jeweiligen Nachtrag des Portfolios festgelegt sind. Die Portfolios unterliegen keinen extern vorgeschriebenen Kapitalerfordernissen. Während die Portfolios in übertragbare Wertpapiere und andere liquide Finanzanlagen investieren, verfolgt der Manager auch einen angemessenen Prozess zur Überwachung des Liquiditätsrisikos, der die von den Portfolios eingesetzten Transaktionen für ein effizientes Portfoliomanagement berücksichtigt, um sicherzustellen, dass jedes Portfolio in der Lage ist, die angegebenen Bedingungen bei Anteilsrücknahmen zu erfüllen.

Um potenzielle Liquiditätsrisiken zu mindern, passt der Manager seine Kontrollen an die verschiedenen Anlagestrategien, Liquiditätsbedingungen und das Kundenverhalten in der Vergangenheit an. Als Teil der Risikoüberwachung kann der Manager auf verschiedene Liquiditätstests zurückgreifen, deren Ergebnisse zahlreiche Lösungen bedingen können, darunter eine Anpassung der Zusammensetzung der Vermögenswerte, die Inanspruchnahme von Überziehungs- oder Kreditfazilitäten oder anderer geeigneter Maßnahmen, um ein hinlängliches Liquiditätsniveau sicherzustellen. Alle Vereinbarungen auf Portfolioebene werden von der Risikofunktion des Managers, den Portfoliomanagern des betreffenden Portfolios, dem Chief Investment Officer des Managers sowie den Direktoren des Managers und den Direktoren der Gesellschaft überprüft. Das Risikoteam des Managers führt regelmäßig Portfoliostresstests im Kontext der Zusammensetzung des jeweiligen Portfolios und der aktuellen/potenziellen Marktbedingungen durch. Dabei werden Stressszenarien mit verschiedenen hypothetischen Rücknahmeniveaus durchgespielt und die Fähigkeit der Portfolios bewertet, Rücknahmeanträge auf diesen Niveaus auf ordnungsgemäße Weise zu erfüllen. Sollte die Analyse ergeben, dass eines der Portfolios eine niedrige Liquiditätsdeckungsquote aufweist, werden Rücksprachen seitens des Risikoteams des Managers und des Portfolioteams gehalten und relevante Schritte unternommen, um die damit verbundenen Risiken zu bewerten und auf bestmögliche Weise zu verringern. Ferner werden auf Tagesbasis die Liquiditätspuffer im Rahmen der Berichterstattung überwacht, um das Liquiditätsrisiko eines jeden Portfolios zu erfassen. Abgesehen davon werden die Marktliquidität betreffende Faktoren überwacht, um diesbezügliche potenzielle Anomalien zu erfassen.

Am 31. Dezember 2024 und 31. Dezember 2023 waren 2 Zeichneranteile ausgegeben. Die Zeichneranteile berechtigen die Inhaber zur Teilnahme und Abstimmung auf Hauptversammlungen des Fonds, berechtigen die Inhaber jedoch nicht am Gewinn oder am Vermögen des Fonds zu partizipieren, mit Ausnahme einer Kapitalrückzahlung im Falle einer Liquidation. Die gewinnberechtigten Anteile ermächtigen die Inhaber zur Teilnahme und Stimmabgabe bei Hauptversammlungen des Fonds sowie zur Beteiligung an den Gewinnen und den Vermögenswerten des Fonds.

Die Zeichneranteile werden wie folgt gehalten:

| <b>Name des Anteilinhabers</b>  | <b>Anzahl der Anteile</b> |
|---------------------------------|---------------------------|
| Matsack Nominees Limited        | 1                         |
| Neuberger Berman Europe Limited | 1                         |

Die Mindestzeichnungs- und Rücknahmegrenzen für jeden Teilfonds finden sich im Verkaufsprospekt des Fonds.

Das Kapital der Portfolios wird durch das auf die Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen repräsentiert. Der Betrag des den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens kann sich auf Monatsbasis erheblich ändern, da die Portfolios monatlichen Zeichnungen und Rücknahmen nach Ermessen der Anteilinhaber unterliegen.

Die Ziele der Portfolios für die Verwaltung des Kapitals sind:

- Das Kapital in Anlagen zu investieren, die den Anlagezielen, den Anlagepolitiken, dem Risiko und der erwarteten Rendite gemäß den Angaben im Verkaufsprospekt entsprechen;
- Erzielung von Renditen bei gleichzeitigem Kapitalschutz durch Anwendung der im Verkaufsprospekt angegebenen Anlagestrategien;
- Aufrechterhaltung einer ausreichenden Liquidität zur Begleichung der Ausgaben der Portfolios und um Rücknahmeanträge zu erfüllen, wenn sie entstehen; und
- Aufrechterhaltung einer ausreichenden Größe, um den Betrieb der Portfolios kosteneffizient zu gestalten.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Veränderung der Anzahl rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile im Geschäftsjahr:

Asia Responsible Transition Bond

|  | Ausschüttende |                |                |                | Ausschüttende |             |                |                | Ausschüttende |                |  |
|--|---------------|----------------|----------------|----------------|---------------|-------------|----------------|----------------|---------------|----------------|--|
|  | Klasse        | Thesaurierende | Thesaurierende | Thesaurierende | Ausschüttende | Klasse      | Thesaurierende | Thesaurierende | Klasse        | Thesaurierende |  |
|  | USD A         | Klasse         | Klasse         | Klasse         | Klasse        | USD I4      | Klasse         | Klasse         | USD X         | Klasse         |  |
|  | (Monatlich)   | USD A          | USD C1         | USD I          | USD I         | (Monatlich) | USD I4         | USD M          | (Monatlich)   | USD X          |  |
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |               |                |                |                |               |             |                |                |               |                |  |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |               |                |                |                |               |             |                |                |               |                |  |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 33.329        | 103.056        | 16.174         | 29.051         | 8.249         | 1.000       | 1.000          | 33.392         | 1.000         | 2.193          |  |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 332           | 283            | –              | –              | –             | –           | 1.800          | 3.368          | –             | –              |  |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (23.753)      | (34.896)       | (11.374)       | (311)          | –             | –           | –              | (18.999)       | –             | –              |  |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 9.908         | 68.443         | 4.800          | 28.740         | 8.249         | 1.000       | 2.800          | 17.761         | 1.000         | 2.193          |  |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |               |                |                |                |               |             |                |                |               |                |  |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |               |                |                |                |               |             |                |                |               |                |  |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 35.120        | 119.210        | 19.456         | 30.051         | 1.171.040     | 1.000       | 1.000          | 55.388         | 1.000         | 2.193          |  |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 321           | 2.725          | –              | –              | –             | –           | –              | –              | –             | –              |  |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (2.112)       | (18.879)       | (3.282)        | (1.000)        | (1.162.791)   | –           | –              | (21.996)       | –             | –              |  |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 33.329        | 103.056        | 16.174         | 29.051         | 8.249         | 1.000       | 1.000          | 33.392         | 1.000         | 2.193          |  |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Asia Responsible Transition Bond (Fortsetzung)

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z |
|--|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 5.739.751                         |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 848.201                           |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (4.223.914)                       |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 2.364.038                         |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 848.201                           |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 4.891.550                         |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –                                 |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 5.739.751                         |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

China A-Share Equity

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>CNY I | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I (nicht<br>währungs-<br>gesichert) | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I (nicht<br>währungs-<br>gesichert) |
|--|-----------------------------------|---|--|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |   |  |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |   |  |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 1.461                             | 2.934   | 250.091  |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                                 | –   | –  |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –                                 | (1.934)   | –  |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 1.461                             | 1.000   | 250.091  |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |   |  |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |   |  |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 1.461                             | 2.934   | 250.091  |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                                 | –   | –  |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –                                 | –   | –  |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 1.461                             | 2.934   | 250.091  |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## China Bond

|  | Ausschüttende<br>Klasse<br>CNY A<br>(Monatlich) | Ausschüttende<br>Klasse<br>CNY I | Thesaurierende<br>Klasse<br>CNY Z | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I2* | Ausschüttende<br>Klasse<br>SGD A<br>(Monatlich)<br>(nicht<br>währungs-<br>gesichert) | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I (nicht<br>währungs-<br>gesichert) | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z (nicht<br>währungs-<br>gesichert) |
|--|---|----------------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------|--|---|-----------------------------------|---|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |   |                                  |                                   |                                     |  |   |                                   |   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |   |                                  |                                   |                                     |  |   |                                   |   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 1.993   | 2.348                            | 1.832                             | 2.176                               | 51.347   | 290.549   | 4.818.803                         | 1.208.309   |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –   | –                                | –                                 | –                                   | 22.025   | 1   | –                                 | –   |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –   | –                                | (614)                             | (2.176)                             | (44.509)   | (222.629)   | (3.698.190)                       | (824.298)   |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 1.993   | 2.348                            | 1.218                             | –                                   | 28.863   | 67.921  | 1.120.613                         | 384.011   |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |   |                                  |                                   |                                     |  |   |                                   |   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |   |                                  |                                   |                                     |  |   |                                   |   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 1.993   | 2.348                            | 1.832                             | 2.176                               | 68.293   | 563.515   | 4.953.693                         | 1.215.396   |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –   | –                                | –                                 | –                                   | 10.621   | 10  | –                                 | –   |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –   | –                                | –                                 | –                                   | (27.567)   | (272.976)   | (134.890)                         | (7.087)   |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 1.993   | 2.348                            | 1.832                             | 2.176                               | 51.347   | 290.549   | 4.818.803                         | 1.208.309   |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

China Equity

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF I | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR Z | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP A* | Thesaurierende<br>Klasse<br>SGD A | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD A | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I2 |
|--|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|----------------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                   |                                   |                                   |                                   |                                   |                                   |                                  |                                   |                                    |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                   |                                   |                                   |                                   |                                   |                                   |                                  |                                   |                                    |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 18.100                            | 54.033                            | 50.117                            | 891                               | 1.270                             | 64.463                            | 837.894                           | 48.558                           | 5.553.171                         | 1.562.496                          |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                                 | –                                 | –                                 | –                                 | –                                 | –                                 | –                                 | –                                | –                                 | 30.277                             |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (13.700)                          | (4.070)                           | (3.686)                           | –                                 | (1.270)                           | (31.563)                          | (167.299)                         | –                                | (2.299.881)                       | (272.075)                          |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 4.400                             | 49.963                            | 46.431                            | 891                               | –                                 | 32.900                            | 670.595                           | 48.558                           | 3.253.290                         | 1.320.698                          |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                   |                                   |                                   |                                   |                                   |                                   |                                  |                                   |                                    |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                   |                                   |                                   |                                   |                                   |                                   |                                  |                                   |                                    |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 29.100                            | 69.274                            | 53.783                            | 891                               | 1.265                             | 72.240                            | 1.123.752                         | 49.808                           | 8.620.770                         | 882.670                            |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                                 | –                                 | –                                 | –                                 | 5                                 | –                                 | –                                 | –                                | 113                               | 984.661                            |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (11.000)                          | (15.241)                          | (3.666)                           | –                                 | –                                 | (7.777)                           | (285.858)                         | (1.250)                          | (3.067.712)                       | (304.835)                          |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 18.100                            | 54.033                            | 50.117                            | 891                               | 1.270                             | 64.463                            | 837.894                           | 48.558                           | 5.553.171                         | 1.562.496                          |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## China Equity (Fortsetzung)

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD U | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z |
|--|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 1.356                             | 1.131.486                         | 16.176                            |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                                 | –                                 | –                                 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (60)                              | (321.878)                         | –                                 |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 1.296                             | 809.608                           | 16.176                            |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 1.356                             | 1.464.746                         | 16.176                            |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                                 | –                                 | –                                 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –                                 | (333.260)                         | –                                 |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 1.356                             | 1.131.486                         | 16.176                            |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Climate Innovation<sup>1</sup>

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I5* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z* |
|--|------------------------------------|------------------------------------|-------------------------------------|------------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                    |                                    |                                     |                                    |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                    |                                    |                                     |                                    |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 1.000                              | 1.000                              | 1.000                               | 300.000                            |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                                  | –                                  | –                                   | –                                  |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –                                  | –                                  | –                                   | –                                  |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 1.000                              | 1.000                              | 1.000                               | 300.000                            |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                    |                                    |                                     |                                    |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                    |                                    |                                     |                                    |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | –                                  | –                                  | –                                   | –                                  |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 1.000                              | 1.000                              | 1.000                               | 300.000                            |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –                                  | –                                  | –                                   | –                                  |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 1.000                              | 1.000                              | 1.000                               | 300.000                            |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## CLO Income

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I2 | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR X* | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR X* | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP I2* | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP Z | Ausschüttende<br>Klasse<br>JPY I* | Ausschüttende<br>Klasse<br>JPY I (nicht<br>währungs-<br>gesichert)* | Thesaurierende<br>Klasse<br>SEK I |
|--|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|---|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                   |                                   |                                    |                                   |                                    |                                   |                                   |   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                   |                                   |                                    |                                   |                                    |                                   |                                   |   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 2.824                             | 2.590.103                         | 1.198.295                         | –                                  | –                                 | –                                  | 4.854                             | –                                 | –   | 244.064                           |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 26.742                            | 3.494.540                         | 314.931                           | 2.955.806                          | 76.500                            | –                                  | 3.262                             | 1.181.417                         | 10.151.961  | –                                 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –                                 | (2.628.596)                       | –                                 | –                                  | –                                 | –                                  | (6.485)                           | (20.234)                          | –   | (126.303)                         |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 29.566                            | 3.456.047                         | 1.513.226                         | 2.955.806                          | 76.500                            | –                                  | 1.631                             | 1.161.183                         | 10.151.961  | 117.761                           |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                   |                                   |                                    |                                   |                                    |                                   |                                   |   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                   |                                   |                                    |                                   |                                    |                                   |                                   |   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 6.454                             | 1.114.755                         | 1.593.672                         | –                                  | –                                 | 2.711.194                          | 4.854                             | –                                 | –   | 279.735                           |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                                 | 1.552.035                         | 482.891                           | –                                  | –                                 | 3.123                              | –                                 | –                                 | –   | –                                 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (3.630)                           | (76.687)                          | (878.268)                         | –                                  | –                                 | (2.714.317)                        | –                                 | –                                 | –   | (35.671)                          |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 2.824                             | 2.590.103                         | 1.198.295                         | –                                  | –                                 | –                                  | 4.854                             | –                                 | –   | 244.064                           |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

CLO Income (Fortsetzung)

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I* | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I2 | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I4* | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I5 | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD U* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z |
|--|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                   |                                   |                                   |                                     |                                   |                                    |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                   |                                   |                                   |                                     |                                   |                                    |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 3.544                             | 4.327.521                         | 251.228                           | 4.216.396                         | –                                   | 3.345.732                         | –                                  | 51.167                            |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 341.025                           | 27.883.091                        | 3.469.742                         | 13.464.699                        | 6.000.000                           | 10.955.995                        | 96.297                             | 346.165                           |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (62.588)                          | (665.485)                         | (258.746)                         | (1.849.000)                       | –                                   | (4.254.001)                       | –                                  | (6.700)                           |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 281.981                           | 31.545.127                        | 3.462.224                         | 15.832.095                        | 6.000.000                           | 10.047.726                        | 96.297                             | 390.632                           |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                   |                                   |                                   |                                     |                                   |                                    |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                   |                                   |                                   |                                     |                                   |                                    |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 6.339                             | 1.278.134                         | –                                 | 3.310.195                         | –                                   | 4.382.421                         | –                                  | 42.619                            |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 937                               | 3.511.722                         | 251.228                           | 1.293.641                         | –                                   | 423.722                           | –                                  | 9.365                             |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (3.732)                           | (462.335)                         | –                                 | (387.440)                         | –                                   | (1.460.411)                       | –                                  | (817)                             |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 3.544                             | 4.327.521                         | 251.228                           | 4.216.396                         | –                                   | 3.345.732                         | –                                  | 51.167                            |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Commodities

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I (nicht<br>währungs-<br>gesichert) | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I2* | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I3 (nicht<br>währungs-<br>gesichert)* | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I5 | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP P* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I3* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I5 | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M |
|--|---|-------------------------------------|---|------------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |   |                                     |   |                                    |                                    |                                   |                                   |                                     |                                    |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |   |                                     |   |                                    |                                    |                                   |                                   |                                     |                                    |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 4.588.391   | –                                   | –   | 3.444.743                          | –                                  | 126.701                           | 166.638                           | –                                   | 6.069.791                          | 46.258                            |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 2.018.285   | 2.363                               | 2.223.946   | 1.846.508                          | 2.383                              | 114.673                           | 102.747                           | 1.000                               | 2.656.009                          | 64.870                            |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (1.656.089)   | –                                   | (2.284)   | (2.914.866)                        | –                                  | (84.476)                          | (112.234)                         | –                                   | (5.785.542)                        | (41.421)                          |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 4.950.587   | 2.363                               | 2.221.662   | 2.376.385                          | 2.383                              | 156.898                           | 157.151                           | 1.000                               | 2.940.258                          | 69.707                            |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |   |                                     |   |                                    |                                    |                                   |                                   |                                     |                                    |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |   |                                     |   |                                    |                                    |                                   |                                   |                                     |                                    |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 806   | –                                   | –   | 1.725.093                          | –                                  | 300.455                           | 41.114                            | –                                   | 6.131.791                          | 48.584                            |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 4.674.061   | –                                   | –   | 2.389.727                          | –                                  | 16.070                            | 170.210                           | –                                   | 912.952                            | –                                 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (86.476)  | –                                   | –   | (670.077)                          | –                                  | (189.824)                         | (44.686)                          | –                                   | (974.952)                          | (2.326)                           |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 4.588.391   | –                                   | –   | 3.444.743                          | –                                  | 126.701                           | 166.638                           | –                                   | 6.069.791                          | 46.258                            |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Commodities (Fortsetzung)

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z |
|--|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 229.100                           |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 89.771                            |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (45.282)                          |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 273.589                           |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 234.681                           |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 11.719                            |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (17.300)                          |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 229.100                           |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Corporate Hybrid Bond

|  | Ausschüttende                  |                                   |                                     |                                   | Ausschüttende                    |                                |                                   |                                   |                                  |                                    |
|--|--------------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------|-----------------------------------|----------------------------------|--------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|----------------------------------|------------------------------------|
|  | Klasse<br>AUD A<br>(Monatlich) | Ausschüttende<br>Klasse<br>CHF A* | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF I3* | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF P | Ausschüttende<br>Klasse<br>CHF P | Klasse<br>EUR A<br>(Monatlich) | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I2 |
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                |                                   |                                     |                                   |                                  |                                |                                   |                                   |                                  |                                    |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                |                                   |                                     |                                   |                                  |                                |                                   |                                   |                                  |                                    |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 635.236                        | –                                 | –                                   | 465.567                           | 181.104                          | 4.860.824                      | 13.482.192                        | 72.062.741                        | 16.771.460                       | 23.411.797                         |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 643.814                        | 471.943                           | 1.562.770                           | 149.235                           | 3.004.238                        | 4.427.648                      | 8.081.385                         | 18.838.120                        | 9.576.612                        | 13.419.808                         |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (180.272)                      | (18.026)                          | –                                   | (240.195)                         | (231.505)                        | (609.578)                      | (2.993.065)                       | (26.962.149)                      | (2.237.552)                      | (16.411.761)                       |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 1.098.778                      | 453.917                           | 1.562.770                           | 374.607                           | 2.953.837                        | 8.678.894                      | 18.570.512                        | 63.938.712                        | 24.110.520                       | 20.419.844                         |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                |                                   |                                     |                                   |                                  |                                |                                   |                                   |                                  |                                    |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                |                                   |                                     |                                   |                                  |                                |                                   |                                   |                                  |                                    |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 611.478                        | –                                 | –                                   | 2.376.179                         | 175.980                          | 4.852.015                      | 12.011.204                        | 59.251.810                        | 10.344.724                       | 18.775.751                         |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 51.225                         | –                                 | –                                   | 74.865                            | 16.077                           | 495.060                        | 3.923.047                         | 33.509.401                        | 9.941.754                        | 7.714.386                          |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (27.467)                       | –                                 | –                                   | (1.985.477)                       | (10.953)                         | (486.251)                      | (2.452.059)                       | (20.698.470)                      | (3.515.018)                      | (3.078.340)                        |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 635.236                        | –                                 | –                                   | 465.567                           | 181.104                          | 4.860.824                      | 13.482.192                        | 72.062.741                        | 16.771.460                       | 23.411.797                         |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

|  | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I2 | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I3 | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I5 | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR M | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR P | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR P | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I2 | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP I2 |
|--|-----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|----------------------------------|-----------------------------------|----------------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                    |                                    |                                   |                                  |                                   |                                  |                                   |                                    |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                    |                                    |                                   |                                  |                                   |                                  |                                   |                                    |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 6.380.279                         | 404.222                            | 9.172.685                          | 955.524                           | 428.286                          | 848.185                           | 2.046.019                        | 197.433                           | 153.108                            | 2.504                             |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 118.000                           | 8.244.426                          | 1.530.223                          | 543.533                           | 287.564                          | 199.920                           | 140.170                          | 235.047                           | 117.790                            | 19.936                            |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (333.602)                         | (237.164)                          | (414.476)                          | (267.123)                         | (52.662)                         | (230.672)                         | (687.654)                        | (123.734)                         | (49.043)                           | (535)                             |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 6.164.677                         | 8.411.484                          | 10.288.432                         | 1.231.934                         | 663.188                          | 817.433                           | 1.498.535                        | 308.746                           | 221.855                            | 21.905                            |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                    |                                    |                                   |                                  |                                   |                                  |                                   |                                    |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                    |                                    |                                   |                                  |                                   |                                  |                                   |                                    |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 21.723.355                        | 696.618                            | 16.332.716                         | 1.064.639                         | 467.056                          | 3.826.066                         | 503.225                          | 516.297                           | 944.439                            | 44.753                            |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 1.339.335                         | 35.760                             | 59.423                             | 254.592                           | 97.607                           | 113.944                           | 1.670.754                        | 48.015                            | 7.783                              | 87                                |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (16.682.411)                      | (328.156)                          | (7.219.454)                        | (363.707)                         | (136.377)                        | (3.091.825)                       | (127.960)                        | (366.879)                         | (799.114)                          | (42.336)                          |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 6.380.279                         | 404.222                            | 9.172.685                          | 955.524                           | 428.286                          | 848.185                           | 2.046.019                        | 197.433                           | 153.108                            | 2.504                             |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP P | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP P | Ausschüttende<br>Klasse<br>SGD A<br>(Monatlich) | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD A<br>(Monatlich) | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD A | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD C1 | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I<br>(Monatlich)* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I |
|--|-----------------------------------|----------------------------------|---|---|-----------------------------------|----------------------------------|------------------------------------|--|-----------------------------------|----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                  |   |   |                                   |                                  |                                    |  |                                   |                                  |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                  |   |   |                                   |                                  |                                    |  |                                   |                                  |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 146.164                           | 739.736                          | 107.086   | 5.799.369                                       | 4.026.220                         | 7.910                            | 325.651                            | –  | 3.486.228                         | 108.827                          |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 260.549                           | 128.403                          | 374.341   | 3.788.115                                       | 1.764.763                         | 6.726                            | –                                  | 105.127  | 5.412.164                         | 1.145.292                        |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (96.299)                          | (481.643)                        | (74.206)  | (1.795.102)                                     | (927.417)                         | (9.181)                          | (124.229)                          | –  | (2.354.327)                       | (30.586)                         |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 310.414                           | 386.496                          | 407.221   | 7.792.382                                       | 4.863.566                         | 5.455                            | 201.422                            | 105.127  | 6.544.065                         | 1.223.533                        |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                  |   |   |                                   |                                  |                                    |  |                                   |                                  |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                  |   |   |                                   |                                  |                                    |  |                                   |                                  |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 638.477                           | 846.035                          | 87.891  | 6.691.421                                       | 4.384.732                         | 7.910                            | 611.702                            | –  | 4.388.388                         | 166.429                          |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 73.518                            | 154.561                          | 19.551  | 428.125   | 665.491                           | –                                | –                                  | –  | 1.071.125                         | 7.892                            |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (565.831)                         | (260.860)                        | (356)   | (1.320.177)                                     | (1.024.003)                       | –                                | (286.051)                          | –  | (1.973.285)                       | (65.494)                         |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 146.164                           | 739.736                          | 107.086   | 5.799.369                                       | 4.026.220                         | 7.910                            | 325.651                            | –  | 3.486.228                         | 108.827                          |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I2 | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I2 | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD M | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD P | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z |
|--|------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                    |                                   |                                   |                                  |                                   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                    |                                   |                                   |                                  |                                   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 466.092                            | 499.424                           | 688.527                           | 237.937                          | 634.499                           | 33.730                            |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 600.333                            | 3.040.744                         | 359.295                           | 39.091                           | 6.935                             | 1.080                             |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –                                  | (302.115)                         | (148.420)                         | (53.281)                         | (254.685)                         | –                                 |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 1.066.425                          | 3.238.053                         | 899.402                           | 223.747                          | 386.749                           | 34.810                            |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                    |                                   |                                   |                                  |                                   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                    |                                   |                                   |                                  |                                   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 582.240                            | 525.564                           | 826.171                           | 269.098                          | 1.406.289                         | 33.730                            |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 41.876                             | –                                 | 54.287                            | 24.175                           | 36.223                            | –                                 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (158.024)                          | (26.140)                          | (191.931)                         | (55.336)                         | (808.013)                         | –                                 |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 466.092                            | 499.424                           | 688.527                           | 237.937                          | 634.499                           | 33.730                            |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Developed Market FMP – 2027<sup>1</sup>

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A* | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A* | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD A* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I* | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD X* | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD X* |
|--|------------------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                    |                                   |                                    |                                   |                                    |                                   |                                    |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                    |                                   |                                    |                                   |                                    |                                   |                                    |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 67.923                             | 29.700                            | 6.693.273                          | 2.598.732                         | 94.000                             | 208.269                           | 3.452.985                          | 84.042                            |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                                  | –                                 | –                                  | –                                 | –                                  | –                                 | –                                  | –                                 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –                                  | –                                 | (520.937)                          | (471.089)                         | –                                  | –                                 | (366.422)                          | (84.042)                          |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 67.923                             | 29.700                            | 6.172.336                          | 2.127.643                         | 94.000                             | 208.269                           | 3.086.563                          | –                                 |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                    |                                   |                                    |                                   |                                    |                                   |                                    |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                    |                                   |                                    |                                   |                                    |                                   |                                    |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | –                                  | –                                 | –                                  | –                                 | –                                  | –                                 | –                                  | –                                 |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 67.923                             | 29.700                            | 6.693.273                          | 2.841.848                         | 94.000                             | 208.269                           | 3.753.888                          | 200.000                           |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –                                  | –                                 | –                                  | (243.116)                         | –                                  | –                                 | (300.903)                          | (115.958)                         |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 67.923                             | 29.700                            | 6.693.273                          | 2.598.732                         | 94.000                             | 208.269                           | 3.452.985                          | 84.042                            |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

EMD Corporate – Social and Environmental Transition

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF I | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF I4* | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I3 | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR M | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR X | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I | Thesaurierende<br>Klasse<br>SEK A |
|--|-----------------------------------|-------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                     |                                   |                                   |                                    |                                   |                                  |                                   |                                   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                     |                                   |                                   |                                    |                                   |                                  |                                   |                                   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 1.247.420                         | –                                   | 7.351                             | 26.662                            | 22.707                             | 55.135                            | 68.096                           | 4.068.252                         | 787                               | 22.966                            |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 605.059                           | –                                   | 722                               | 11                                | 4.010                              | 7.685                             | 22.401                           | 975.000                           | –                                 | 113                               |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (8.500)                           | –                                   | (2.772)                           | (22.192)                          | (1.586)                            | (5.235)                           | (7.142)                          | (154.800)                         | –                                 | (2.767)                           |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 1.843.979                         | –                                   | 5.301                             | 4.481                             | 25.131                             | 57.585                            | 83.355                           | 4.888.452                         | 787                               | 20.312                            |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                     |                                   |                                   |                                    |                                   |                                  |                                   |                                   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                     |                                   |                                   |                                    |                                   |                                  |                                   |                                   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 1.034.420                         | 456.611                             | 63.496                            | 45.983                            | 24.272                             | 56.094                            | 57.553                           | 4.068.252                         | 2.158                             | 33.205                            |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 215.000                           | –                                   | 1.263                             | 19                                | 2.844                              | 1.565                             | 14.313                           | –                                 | –                                 | 1.522                             |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (2.000)                           | (456.611)                           | (57.408)                          | (19.340)                          | (4.409)                            | (2.524)                           | (3.770)                          | –                                 | (1.371)                           | (11.761)                          |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 1.247.420                         | –                                   | 7.351                             | 26.662                            | 22.707                             | 55.135                            | 68.096                           | 4.068.252                         | 787                               | 22.966                            |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## EMD Corporate – Social and Environmental Transition (Fortsetzung)

|  | Ausschüttende                  |                                   |                                    |                                   |                                  |                                    |                                     |                                   |                                  |  |
|--|--------------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|----------------------------------|------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------------------|----------------------------------|--|
|  | Klasse<br>USD A<br>(Monatlich) | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD C1 | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I2 | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I5* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD M |  |
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                |                                   |                                    |                                   |                                  |                                    |                                     |                                   |                                  |  |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                |                                   |                                    |                                   |                                  |                                    |                                     |                                   |                                  |  |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 93.211                         | 387.016                           | 67.573                             | 1.309.085                         | 263.449                          | 40.000                             | –                                   | 86.812                            | 95.622                           |  |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 39.712                         | 196.210                           | –                                  | 661.208                           | –                                | –                                  | –                                   | 35.055                            | 366                              |  |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (29.232)                       | (102.904)                         | (9.532)                            | (948.152)                         | (8.898)                          | –                                  | –                                   | (47.320)                          | (24.341)                         |  |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 103.691                        | 480.322                           | 58.041                             | 1.022.141                         | 254.551                          | 40.000                             | –                                   | 74.547                            | 71.647                           |  |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                |                                   |                                    |                                   |                                  |                                    |                                     |                                   |                                  |  |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                |                                   |                                    |                                   |                                  |                                    |                                     |                                   |                                  |  |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 85.553                         | 518.363                           | 69.555                             | 1.594.074                         | 301.029                          | 65.000                             | 27.458                              | 80.293                            | 91.458                           |  |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 27.479                         | 22.132                            | –                                  | 139.711                           | –                                | –                                  | –                                   | 70.559                            | 4.164                            |  |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (19.821)                       | (153.479)                         | (1.982)                            | (424.700)                         | (37.580)                         | (25.000)                           | (27.458)                            | (64.040)                          | –                                |  |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 93.211                         | 387.016                           | 67.573                             | 1.309.085                         | 263.449                          | 40.000                             | –                                   | 86.812                            | 95.622                           |  |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Hard Currency

|  | Ausschüttende<br>Klasse<br>AUD A<br>(Monatlich) | Ausschüttende<br>Klasse<br>AUD I | Thesaurierende<br>Klasse<br>CAD I3 (nicht<br>währungs-<br>gesichert) | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF I2 | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF P | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR A<br>(Monatlich) | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I (nicht<br>währungs-<br>gesichert) | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I |
|--|---|----------------------------------|--|------------------------------------|-----------------------------------|---|-----------------------------------|-----------------------------------|---|----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |   |                                  |  |                                    |                                   |   |                                   |                                   |   |                                  |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |   |                                  |  |                                    |                                   |   |                                   |                                   |   |                                  |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 274.683   | 2.792.223                        | 4.300.000  | 15.883.806                         | 2.976.879                         | 1.205.704                                       | 4.859.022                         | 7.808.562                         | 1.775.261   | 25.544.490                       |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 143.499   | 82.843                           | –  | 1.548.740                          | 337.013                           | 20.943  | 880.882                           | 4.563.815                         | 2.648.901   | 2.202.795                        |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (340.478)                                       | (2.872.815)                      | –  | (7.717.526)                        | (1.586.919)                       | (238.190)                                       | (1.648.330)                       | (2.544.902)                       | (2.673.153)   | (6.154.411)                      |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 77.704  | 2.251                            | 4.300.000  | 9.715.020                          | 1.726.973                         | 988.457   | 4.091.574                         | 9.827.475                         | 1.751.009   | 21.592.874                       |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |   |                                  |  |                                    |                                   |   |                                   |                                   |   |                                  |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |   |                                  |  |                                    |                                   |   |                                   |                                   |   |                                  |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 310.297   | 2.773.139                        | 4.300.000  | 20.893.906                         | 2.782.320                         | 1.188.410                                       | 3.418.120                         | 11.499.248                        | 1.959.764   | 27.569.346                       |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 47.366  | 3.831.153                        | –  | 1.897.886                          | 463.983                           | 204.834   | 1.810.788                         | 1.950.853                         | 312.490   | 2.152.511                        |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (82.980)  | (3.812.069)                      | –  | (6.907.986)                        | (269.424)                         | (187.540)                                       | (369.886)                         | (5.641.539)                       | (496.993)   | (4.177.367)                      |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 274.683   | 2.792.223                        | 4.300.000  | 15.883.806                         | 2.976.879                         | 1.205.704                                       | 4.859.022                         | 7.808.562                         | 1.775.261   | 25.544.490                       |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I2 | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I2 | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I3 | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I3 (nicht<br>währungs-<br>gesichert)* | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I4 | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I5 (nicht<br>währungs-<br>gesichert) | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR M | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR P | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR Z |
|--|------------------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|---|------------------------------------|--|-----------------------------------|----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                    |                                   |                                    |   |                                    |  |                                   |                                  |                                   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                    |                                   |                                    |   |                                    |  |                                   |                                  |                                   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 5.223.565                          | 4.936.081                         | 7.005.689                          | –   | 3.967.815                          | 8.129.156  | 53.626                            | 21.845                           | 1.178.285                         | 59.505                            |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 438.129                            | 76.237                            | 3.450.715                          | –   | 6.465.289                          | 4.019.888  | –                                 | 2                                | 115.583                           | 11.774                            |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (3.337.436)                        | (128.141)                         | (3.719.787)                        | –   | (185.311)                          | (6.583.587)  | (4.867)                           | (5.991)                          | (81.774)                          | –                                 |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 2.324.258                          | 4.884.177                         | 6.736.617                          | –   | 10.247.793                         | 5.565.457  | 48.759                            | 15.856                           | 1.212.094                         | 71.279                            |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                    |                                   |                                    |   |                                    |  |                                   |                                  |                                   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                    |                                   |                                    |   |                                    |  |                                   |                                  |                                   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 7.800.989                          | 4.735.609                         | 11.460.021                         | 3.314.347   | 10.690.026                         | 6.860.859  | 69.876                            | 22.186                           | 1.210.699                         | 36.061                            |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 3.942.146                          | 278.590                           | 5.492.556                          | –   | 4.194.833                          | 6.067.456  | –                                 | 2                                | 70.412                            | 23.444                            |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (6.519.570)                        | (78.118)                          | (9.946.888)                        | (3.314.347)   | (10.917.044)                       | (4.799.159)  | (16.250)                          | (343)                            | (102.826)                         | –                                 |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 5.223.565                          | 4.936.081                         | 7.005.689                          | –   | 3.967.815                          | 8.129.156  | 53.626                            | 21.845                           | 1.178.285                         | 59.505                            |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP I | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I2 | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP I2 | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP P | Ausschüttende<br>Klasse<br>HKD A<br>(Monatlich) | Thesaurierende<br>Klasse<br>JPY I | Thesaurierende<br>Klasse<br>SEK A | Thesaurierende<br>Klasse<br>SEK I2 | Ausschüttende<br>Klasse<br>SGD A<br>(Monatlich) |
|--|-----------------------------------|----------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|---|-----------------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|---|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                  |                                    |                                   |                                   |   |                                   |                                   |                                    |   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                  |                                    |                                   |                                   |   |                                   |                                   |                                    |   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 1.327.743                         | 141.113                          | 5.486.177                          | 1.881.397                         | 650.333                           | 198.997   | 2.000.000                         | 6.177.940                         | 774.453                            | 1.394.522                                       |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 206.678                           | 56.936                           | 236.547                            | 136.141                           | 210.132                           | 558.207   | –                                 | 1.162.299                         | 86.507                             | 5.497.829                                       |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (1.050.678)                       | (77.912)                         | (5.029.220)                        | (652.432)                         | (601.047)                         | (255.091)                                       | (222.455)                         | (6.261.527)                       | (238.604)                          | (3.497.754)                                     |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 483.743                           | 120.137                          | 693.504                            | 1.365.106                         | 259.418                           | 502.113   | 1.777.545                         | 1.078.712                         | 622.356                            | 3.394.597                                       |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                  |                                    |                                   |                                   |   |                                   |                                   |                                    |   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                  |                                    |                                   |                                   |   |                                   |                                   |                                    |   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 1.714.081                         | 269.731                          | 3.773.875                          | 1.643.379                         | 881.407                           | 170.604   | 2.000.000                         | 12.436.581                        | 1.745.948                          | 1.211.426                                       |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 688.135                           | 39.346                           | 2.737.197                          | 1.447.188                         | 315.611                           | 91.300  | –                                 | 3.347.211                         | 1.593.887                          | 927.916   |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (1.074.473)                       | (167.964)                        | (1.024.895)                        | (1.209.170)                       | (546.685)                         | (62.907)  | –                                 | (9.605.852)                       | (2.565.382)                        | (744.820)                                       |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 1.327.743                         | 141.113                          | 5.486.177                          | 1.881.397                         | 650.333                           | 198.997   | 2.000.000                         | 6.177.940                         | 774.453                            | 1.394.522                                       |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

|  | Ausschüttende                  |                                   |                                  |                                    |                                   |                                  |                                    |                                   |                                   |                                   |
|--|--------------------------------|-----------------------------------|----------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|----------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
|  | Klasse<br>USD A<br>(Monatlich) | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD A | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD C1 | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I2 | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I2 | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I3 | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M |
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                |                                   |                                  |                                    |                                   |                                  |                                    |                                   |                                   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                |                                   |                                  |                                    |                                   |                                  |                                    |                                   |                                   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 19.219.288                     | 9.486.132                         | 45.109                           | 1.051.348                          | 41.677.438                        | 8.826.700                        | 22.930.739                         | 2.418.325                         | 10.754.897                        | 1.746.810                         |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 8.684.919                      | 2.899.898                         | 71.638                           | –                                  | 21.466.698                        | 913.290                          | 5.396.280                          | 1.718.845                         | 207.244                           | 1.027.616                         |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (9.507.450)                    | (3.469.159)                       | (3.406)                          | (171.180)                          | (17.343.163)                      | (419.758)                        | (8.973.791)                        | (983.892)                         | (222.558)                         | (548.709)                         |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 18.396.757                     | 8.916.871                         | 113.341                          | 880.168                            | 45.800.973                        | 9.320.232                        | 19.353.228                         | 3.153.278                         | 10.739.583                        | 2.225.717                         |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                |                                   |                                  |                                    |                                   |                                  |                                    |                                   |                                   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                |                                   |                                  |                                    |                                   |                                  |                                    |                                   |                                   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 21.006.868                     | 9.982.109                         | 5.499                            | 1.198.416                          | 48.424.011                        | 10.480.066                       | 3.229.040                          | 1.755.587                         | 10.702.171                        | 1.893.262                         |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 8.540.687                      | 2.088.892                         | 39.610                           | –                                  | 15.910.168                        | 254.203                          | 25.524.047                         | 2.423.190                         | 115.144                           | 206.826                           |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (10.328.267)                   | (2.584.869)                       | –                                | (147.068)                          | (22.656.741)                      | (1.907.569)                      | (5.822.348)                        | (1.760.452)                       | (62.418)                          | (353.278)                         |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 19.219.288                     | 9.486.132                         | 45.109                           | 1.051.348                          | 41.677.438                        | 8.826.700                        | 22.930.739                         | 2.418.325                         | 10.754.897                        | 1.746.810                         |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

|  | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD M | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD P | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD X | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z |
|--|----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                  |                                   |                                   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                  |                                   |                                   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 536.735                          | 6.086.666                         | 12.069.574                        | 9.753                             |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 232.341                          | 286.578                           | 3.403.650                         | –                                 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (125.770)                        | (509.608)                         | –                                 | (4.434)                           |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 643.306                          | 5.863.636                         | 15.473.224                        | 5.319                             |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                  |                                   |                                   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                  |                                   |                                   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 486.711                          | 1.966.497                         | 12.069.574                        | 9.753                             |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 76.873                           | 4.914.966                         | –                                 | 250                               |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (26.849)                         | (794.797)                         | –                                 | (250)                             |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 536.735                          | 6.086.666                         | 12.069.574                        | 9.753                             |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt - Local Currency

|  | Ausschüttende<br>Klasse Thesaurierende<br>AUD B<br>(Monatlich) |          | Ausschüttende<br>Klasse Thesaurierende<br>AUD C2<br>(Monatlich)* |         | Ausschüttende<br>Klasse Thesaurierende<br>AUD E<br>(Monatlich) |         | Ausschüttende<br>Klasse Thesaurierende<br>AUD T<br>(Monatlich) |          | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I |
|--|--|----------|--|---------|--|---------|--|----------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |  |          |  |         |  |         |  |          |                                   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |  |          |  |         |  |         |  |          |                                   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 479.029  | 34.644   | –  | 926     | 144.768  | 8.263   | 6.780.513  | 236.350  | 274.687                           | 3.468.980                         |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 80.091   | 3.793    | –  | –       | 45.280   | 527     | 344.047  | 18.949   | 830.064                           | 126.468                           |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (273.013)  | (15.163) | –  | (926)   | (131.430)  | (7.296) | (1.035.328)  | (29.369) | (1.037.645)                       | (1.457.208)                       |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 286.107  | 23.274   | –  | –       | 58.618   | 1.494   | 6.089.232  | 225.930  | 67.106                            | 2.138.240                         |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |  |          |  |         |  |         |  |          |                                   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |  |          |  |         |  |         |  |          |                                   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 1.011.815  | 36.723   | 19.109   | 1.035   | 113.572  | 5.703   | 7.223.444  | 266.766  | 416.611                           | 1.814.361                         |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 157.199  | 13.139   | –  | 925     | 95.750   | 6.521   | 873.320  | 12.401   | 251.037                           | 2.675.328                         |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (689.985)  | (15.218) | (19.109)   | (1.034) | (64.554)   | (3.961) | (1.316.251)  | (42.817) | (392.961)                         | (1.020.709)                       |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 479.029  | 34.644   | –  | 926     | 144.768  | 8.263   | 6.780.513  | 236.350  | 274.687                           | 3.468.980                         |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I (nicht<br>währungs-<br>gesichert) | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I2 (nicht<br>währungs-<br>gesichert) | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I4 (nicht<br>währungs-<br>gesichert) | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR Y (nicht<br>währungs-<br>gesichert) | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I4 (nicht<br>währungs-<br>gesichert) | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP I4 (nicht<br>währungs-<br>gesichert) | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP Y (nicht<br>währungs-<br>gesichert) | Thesaurierende<br>Klasse<br>SEK A | Ausschüttende<br>Klasse<br>SGD A<br>(Monatlich) |
|--|---|--|---|---|-----------------------------------|--|---|---|-----------------------------------|---|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |   |  |   |   |                                   |  |   |   |                                   |   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |   |  |   |   |                                   |  |   |   |                                   |   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 15.860.488  | 1.291.690  | 2.575.012   | 7.746.250   | 43.107                            | 7.679.529  | 5.447.629   | 3.722.197   | 85.203                            | 64.900  |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 2.058.861   | –  | 2.782   | 798.309   | 7.805                             | 2.885.792  | 1.645.672   | 479.828   | 1.070                             | 54.214  |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (3.015.795)   | (763.690)  | –   | (256.167)   | (400)                             | (2.028.222)  | (7.064.141)   | (1.465.384)   | (29.931)                          | (61.725)  |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 14.903.554  | 528.000  | 2.577.794   | 8.288.392   | 50.512                            | 8.537.099  | 29.160  | 2.736.641   | 56.342                            | 57.389  |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |   |  |   |   |                                   |  |   |   |                                   |   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |   |  |   |   |                                   |  |   |   |                                   |   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 16.617.422  | 1.203.690  | 2.575.012   | 8.570.577   | 9.350                             | 5.761.938  | 4.826.229   | 5.545.152   | 102.692                           | 40.442  |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 613.431   | 88.000   | –   | 262.605   | 35.152                            | 3.670.139  | 3.177.866   | 299.059   | 26.432                            | 72.846  |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (1.370.365)   | –  | –   | (1.086.932)   | (1.395)                           | (1.752.548)  | (2.556.466)   | (2.122.014)   | (43.921)                          | (48.388)  |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 15.860.488  | 1.291.690  | 2.575.012   | 7.746.250   | 43.107                            | 7.679.529  | 5.447.629   | 3.722.197   | 85.203                            | 64.900  |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

|  | Ausschüttende<br>Klasse Thesaurierende<br>USD A<br>Klasse<br>(Monatlich) |           | Ausschüttende<br>Klasse Thesaurierende<br>USD B<br>Klasse<br>(Monatlich) |           | Ausschüttende<br>Klasse Thesaurierende<br>USD C2<br>Klasse<br>(Monatlich)* |         | Ausschüttende<br>Klasse Thesaurierende<br>USD E<br>Klasse<br>(Monatlich) |          | Ausschüttende<br>Klasse Thesaurierende<br>USD I<br>Klasse<br>(Monatlich) |              |
|--|--|-----------|--|-----------|--|---------|--|----------|--|--------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |  |           |  |           |  |         |  |          |  |              |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |  |           |  |           |  |         |  |          |  |              |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 769.347  | 1.544.950 | 2.846.192  | 57.942    | 902  | –       | 435.137  | 29.051   | 4.532.971  | 20.414.165   |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 2.609  | 69.667    | 942.284  | 148.988   | –  | –       | 559.036  | 6.549    | 392.961  | 2.158.043    |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (18.995)   | (505.504) | (2.050.228)  | (159.655) | (902)  | –       | (632.657)  | (33.086) | (3.563.935)  | (6.158.491)  |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 752.961  | 1.109.113 | 1.738.248  | 47.275    | –  | –       | 361.516  | 2.514    | 1.361.997  | 16.413.717   |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |  |           |  |           |  |         |  |          |  |              |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |  |           |  |           |  |         |  |          |  |              |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 584.118  | 1.720.702 | 2.987.299  | 69.674    | 131.749  | 2.864   | 827.707  | 39.193   | 5.289.657  | 44.694.639   |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 224.429  | 155.635   | 2.535.938  | 128.492   | –  | –       | 544.831  | 37.046   | 419.314  | 6.030.817    |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (39.200)   | (331.387) | (2.677.045)  | (140.224) | (130.847)  | (2.864) | (937.401)  | (47.188) | (1.176.000)  | (30.311.291) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 769.347  | 1.544.950 | 2.846.192  | 57.942    | 902  | –       | 435.137  | 29.051   | 4.532.971  | 20.414.165   |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

|  | Ausschüttende   |                                    |                                    | Ausschüttende                  |                                   |                                   |                                   | Ausschüttende                  |                                   |                                  |
|--|-----------------|------------------------------------|------------------------------------|--------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|--------------------------------|-----------------------------------|----------------------------------|
|  | Klasse<br>USD I | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I2 | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I5 | Klasse<br>USD T<br>(Monatlich) | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD T | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD X | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Y | Klasse<br>ZAR B<br>(Monatlich) | Thesaurierende<br>Klasse<br>ZAR B | Klasse<br>ZAR C2<br>(Monatlich)* |
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                 |                                    |                                    |                                |                                   |                                   |                                   |                                |                                   |                                  |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                 |                                    |                                    |                                |                                   |                                   |                                   |                                |                                   |                                  |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 157.014         | 7.614.505                          | 1.581                              | 11.489.702                     | 450.200                           | 15.025.502                        | 17.252.142                        | 1.261.389                      | 94.669                            | 1.865                            |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 27.361          | 578.230                            | –                                  | 2.030.071                      | 51.312                            | –                                 | 1.731.449                         | 353.380                        | 38.717                            | 113                              |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (17.400)        | (400.301)                          | –                                  | (3.019.940)                    | (131.866)                         | (845.852)                         | (154.707)                         | (812.165)                      | (82.903)                          | (1.978)                          |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 166.975         | 7.792.434                          | 1.581                              | 10.499.833                     | 369.646                           | 14.179.650                        | 18.828.884                        | 802.604                        | 50.483                            | –                                |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                 |                                    |                                    |                                |                                   |                                   |                                   |                                |                                   |                                  |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                 |                                    |                                    |                                |                                   |                                   |                                   |                                |                                   |                                  |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 77.414          | 6.703.311                          | 2                                  | 11.229.883                     | 472.178                           | 17.117.475                        | 19.204.022                        | 3.381.337                      | 61.413                            | 79.825                           |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 90.800          | 2.144.542                          | 1.579                              | 2.428.036                      | 105.832                           | –                                 | 314.212                           | 627.026                        | 82.750                            | 2.171                            |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (11.200)        | (1.233.348)                        | –                                  | (2.168.217)                    | (127.810)                         | (2.091.973)                       | (2.266.092)                       | (2.746.974)                    | (49.494)                          | (80.131)                         |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 157.014         | 7.614.505                          | 1.581                              | 11.489.702                     | 450.200                           | 15.025.502                        | 17.252.142                        | 1.261.389                      | 94.669                            | 1.865                            |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>ZAR C2* | Ausschüttende<br>Klasse<br>ZAR E<br>(Monatlich) | Thesaurierende<br>Klasse<br>ZAR E | Ausschüttende<br>Klasse<br>ZAR T<br>(Monatlich) | Thesaurierende<br>Klasse<br>ZAR T |
|--|-------------------------------------|---|-----------------------------------|---|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                     |   |                                   |   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                     |   |                                   |   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 1.596                               | 390.469   | 1.815                             | 14.096.306                                      | 364.474                           |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                                   | 493.415   | 15.869                            | 1.267.696                                       | 31.318                            |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (1.596)                             | (448.717)                                       | (16.667)                          | (2.621.195)                                     | (150.974)                         |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | –                                   | 435.167   | 1.017                             | 12.742.807                                      | 244.818                           |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                     |   |                                   |   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                     |   |                                   |   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 918                                 | 565.614   | 7.324                             | 13.901.287                                      | 350.741                           |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 1.596                               | 286.872   | 39.298                            | 2.870.617                                       | 54.777                            |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (918)                               | (462.017)                                       | (44.807)                          | (2.675.598)                                     | (41.044)                          |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 1.596                               | 390.469   | 1.815                             | 14.096.306                                      | 364.474                           |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend

|  | Ausschüttende<br>Klasse<br>AUD I3 | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I2 | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I2 | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I3 | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I4 (nicht<br>währungs-<br>gesichert) | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I5 | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M |
|--|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|----------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|--|------------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                   |                                   |                                  |                                    |                                   |                                   |  |                                    |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                   |                                   |                                  |                                    |                                   |                                   |  |                                    |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 1.014.761                         | 1.037.361                         | 22.162.212                        | 3.178.610                        | 1.246.486                          | 1.234.076                         | 4.741.000                         | 180.172  | 1.763.677                          | 52.222                            |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 132.073                           | 132.162                           | 3.962.120                         | 350.946                          | 41.889                             | 199.620                           | –                                 | 16.778   | 131.931                            | 40.921                            |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (59.790)                          | (333.866)                         | (2.160.517)                       | (866.042)                        | (484.868)                          | (243.675)                         | (700.000)                         | (7.210)  | (151.238)                          | (9.124)                           |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 1.087.044                         | 835.657                           | 23.963.815                        | 2.663.514                        | 803.507                            | 1.190.021                         | 4.041.000                         | 189.740  | 1.744.370                          | 84.019                            |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                   |                                   |                                  |                                    |                                   |                                   |  |                                    |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                   |                                   |                                  |                                    |                                   |                                   |  |                                    |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 1.104.926                         | 1.087.375                         | 20.867.944                        | 3.568.511                        | 1.904.679                          | 1.433.425                         | 3.000                             | 59.066   | 1.963.354                          | 53.295                            |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 39.376                            | 154.942                           | 2.618.624                         | 342.925                          | 34.771                             | 168.899                           | 4.738.000                         | 121.106  | 104.206                            | 6.388                             |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (129.541)                         | (204.956)                         | (1.324.356)                       | (732.826)                        | (692.964)                          | (368.248)                         | –                                 | –  | (303.883)                          | (7.461)                           |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 1.014.761                         | 1.037.361                         | 22.162.212                        | 3.178.610                        | 1.246.486                          | 1.234.076                         | 4.741.000                         | 180.172  | 1.763.677                          | 52.222                            |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

|  | Ausschüttende Klasse<br>EUR M | Thesaurierende Klasse<br>EUR Z | Thesaurierende Klasse<br>GBP I | Thesaurierende Klasse<br>GBP I (nicht währungs-<br>gesichert) | Ausschüttende Klasse<br>GBP I | Ausschüttende Klasse<br>GBP I (nicht währungs-<br>gesichert) | Thesaurierende Klasse<br>GBP P | Thesaurierende Klasse<br>GBP P (nicht währungs-<br>gesichert) | Thesaurierende Klasse<br>GBP Z | Thesaurierende Klasse<br>NOK U |
|--|-------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|---|-------------------------------|--|--------------------------------|---|--------------------------------|--------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                               |                                |                                |   |                               |  |                                |   |                                |                                |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                               |                                |                                |   |                               |  |                                |   |                                |                                |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 174.419                       | 13.085                         | 38.665                         | 537   | 1.210.149                     | 67.448   | 306.710                        | 88.659  | 16.888                         | 2.285                          |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 462.637                       | 5.459                          | 5.133                          | –   | 43.052                        | 399.030  | 30.567                         | 3   | 1.876                          | –                              |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (142.621)                     | –                              | (16.601)                       | (30)  | (1.174.288)                   | (227.966)  | (274.681)                      | (59.662)  | (16.888)                       | –                              |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 494.435                       | 18.544                         | 27.197                         | 507   | 78.913                        | 238.512  | 62.596                         | 29.000  | 1.876                          | 2.285                          |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                               |                                |                                |   |                               |  |                                |   |                                |                                |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                               |                                |                                |   |                               |  |                                |   |                                |                                |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 39.883                        | 9.487                          | 32.887                         | 539   | 1.454.417                     | 66.844   | 723.194                        | 97.670  | 16.888                         | 2.285                          |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 141.769                       | 4.348                          | 19.482                         | –   | 183.622                       | 29.269   | 73.965                         | 2.017   | –                              | –                              |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (7.233)                       | (750)                          | (13.704)                       | (2)   | (427.890)                     | (28.665)   | (490.449)                      | (11.028)  | –                              | –                              |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 174.419                       | 13.085                         | 38.665                         | 537   | 1.210.149                     | 67.448   | 306.710                        | 88.659  | 16.888                         | 2.285                          |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>SEK A | Ausschüttende<br>Klasse<br>SGD A<br>(Monatlich) | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD A<br>(Monatlich) | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD C1 | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I2 | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I3* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I5* |
|--|-----------------------------------|---|---|-----------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|----------------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |   |   |                                   |                                    |                                   |                                  |                                   |                                     |                                     |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |   |   |                                   |                                    |                                   |                                  |                                   |                                     |                                     |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 236.965                           | 329.995   | 50.374  | 575.323                           | 91.052                             | 1.519.219                         | 46.026                           | 5.415.546                         | –                                   | 3.262.906                           |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 59.265                            | 33.174  | 95.503  | 74.803                            | –                                  | 473.019                           | 8.801                            | 988.677                           | –                                   | 489                                 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (94.814)                          | (12.305)  | (40.125)  | (72.205)                          | (15.320)                           | (365.921)                         | (13.683)                         | (353.264)                         | –                                   | –                                   |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 201.416                           | 350.864   | 105.752   | 577.921                           | 75.732                             | 1.626.317                         | 41.144                           | 6.050.959                         | –                                   | 3.263.395                           |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |   |   |                                   |                                    |                                   |                                  |                                   |                                     |                                     |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |   |   |                                   |                                    |                                   |                                  |                                   |                                     |                                     |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 265.050                           | 327.916   | 54.657  | 981.528                           | 128.728                            | 2.807.500                         | 54.262                           | 5.530.120                         | 4.576.696                           | –                                   |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 152.562                           | 7.429   | 2.385   | 13.304                            | –                                  | 449.658                           | –                                | 586.697                           | –                                   | 3.262.906                           |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (180.647)                         | (5.350)   | (6.668)   | (419.509)                         | (37.676)                           | (1.737.939)                       | (8.236)                          | (701.271)                         | (4.576.696)                         | –                                   |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 236.965                           | 329.995   | 50.374  | 575.323                           | 91.052                             | 1.519.219                         | 46.026                           | 5.415.546                         | –                                   | 3.262.906                           |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD M | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z |
|--|-----------------------------------|----------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                  |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                  |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 79.800                            | 94.509                           | 9.459                             |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 1.774                             | 404                              | –                                 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (34.460)                          | (46.263)                         | (632)                             |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 47.114                            | 48.650                           | 8.827                             |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                  |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                  |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 88.987                            | 81.894                           | 9.459                             |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                                 | 23.358                           | –                                 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (9.187)                           | (10.743)                         | –                                 |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 79.800                            | 94.509                           | 9.459                             |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>AUD I2 | Thesaurierende<br>Klasse<br>NOK I | Thesaurierende<br>Klasse<br>NOK I3* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I2* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z |
|--|------------------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                    |                                   |                                     |                                   |                                     |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                    |                                   |                                     |                                   |                                     |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 2.533.722                          | 28.727                            | 3.680.483                           | 3.680                             | 470.000                             | 610.088                           |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                                  | 5.580                             | 614.990                             | 2.648                             | –                                   | –                                 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –                                  | (17.607)                          | (175.496)                           | (3.680)                           | (470.000)                           | (266.657)                         |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 2.533.722                          | 16.700                            | 4.119.977                           | 2.648                             | –                                   | 343.431                           |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                    |                                   |                                     |                                   |                                     |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                    |                                   |                                     |                                   |                                     |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 2.533.722                          | 2.885.428                         | –                                   | 3.680                             | 470.000                             | 492.314                           |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                                  | 1.792.862                         | 3.694.799                           | –                                 | –                                   | 212.458                           |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –                                  | (4.649.563)                       | (14.316)                            | –                                 | –                                   | (94.684)                          |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 2.533.722                          | 28.727                            | 3.680.483                           | 3.680                             | 470.000                             | 610.088                           |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Emerging Markets Equity

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>AUD B | Thesaurierende<br>Klasse<br>AUD C2* | Thesaurierende<br>Klasse<br>AUD E | Thesaurierende<br>Klasse<br>AUD T | Ausschüttende<br>Klasse<br>CAD I (nicht<br>währungs-<br>gesichert) | Ausschüttende<br>Klasse<br>CAD I2 | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR Z | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I |
|--|-----------------------------------|-------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|--|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                     |                                   |                                   |  |                                   |                                   |                                   |                                   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                     |                                   |                                   |  |                                   |                                   |                                   |                                   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 29.260                            | 1.575                               | 4.517                             | 175.274                           | 8.285  | 1.492.500                         | 78.471                            | 40.124                            | 22.279                            | 38.984                            |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 9.599                             | –                                   | 13.171                            | 30.715                            | –  | –                                 | 285.639                           | 809                               | –                                 | 3.561                             |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (15.068)                          | (1.575)                             | (14.034)                          | (30.631)                          | –  | –                                 | (87.337)                          | (6.483)                           | –                                 | (41.014)                          |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 23.791                            | –                                   | 3.654                             | 175.358                           | 8.285  | 1.492.500                         | 276.773                           | 34.450                            | 22.279                            | 1.531                             |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                     |                                   |                                   |  |                                   |                                   |                                   |                                   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                     |                                   |                                   |  |                                   |                                   |                                   |                                   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 42.721                            | 1.253                               | 13.736                            | 179.662                           | 8.285  | 1.492.500                         | 158.403                           | 43.504                            | 22.279                            | 39.061                            |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 4.713                             | 1.575                               | –                                 | 17.318                            | –  | –                                 | 18.826                            | 1.105                             | –                                 | 970                               |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (18.174)                          | (1.253)                             | (9.219)                           | (21.706)                          | –  | –                                 | (98.758)                          | (4.485)                           | –                                 | (1.047)                           |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 29.260                            | 1.575                               | 4.517                             | 175.274                           | 8.285  | 1.492.500                         | 78.471                            | 40.124                            | 22.279                            | 38.984                            |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Markets Equity (Fortsetzung)

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP Z | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD B | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD C2* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD E | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD T | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z | Thesaurierende<br>Klasse<br>ZAR B |
|--|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                   |                                   |                                     |                                   |                                   |                                   |                                   |                                   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                   |                                   |                                     |                                   |                                   |                                   |                                   |                                   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 6.841                             | 519.979                           | 81.428                            | 967                                 | 13.159                            | 3.640.974                         | 39.239                            | 352.277                           | 2.003.166                         | 37.769                            |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                                 | 39.306                            | 540.936                           | –                                   | 102.343                           | 405.566                           | 253.108                           | 1.041.775                         | 985.584                           | 202.145                           |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (800)                             | (355.070)                         | (539.949)                         | (967)                               | (110.242)                         | (1.083.039)                       | (1.357)                           | (1.177.064)                       | (466.356)                         | (204.253)                         |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 6.041                             | 204.215                           | 82.415                            | –                                   | 5.260                             | 2.963.501                         | 290.990                           | 216.988                           | 2.522.394                         | 35.661                            |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                   |                                   |                                     |                                   |                                   |                                   |                                   |                                   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                   |                                   |                                     |                                   |                                   |                                   |                                   |                                   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 6.841                             | 510.968                           | 142.250                           | 12.018                              | 26.692                            | 14.554.442                        | 37.562                            | 354.357                           | 1.020.891                         | 51.412                            |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                                 | 49.332                            | 147.850                           | 8.954                               | 132.366                           | 2.460.892                         | 56.218                            | 3.658.770                         | 1.313.056                         | 36.066                            |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –                                 | (40.321)                          | (208.672)                         | (20.005)                            | (145.899)                         | (13.374.360)                      | (54.541)                          | (3.660.850)                       | (330.781)                         | (49.709)                          |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 6.841                             | 519.979                           | 81.428                            | 967                                 | 13.159                            | 3.640.974                         | 39.239                            | 352.277                           | 2.003.166                         | 37.769                            |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Emerging Markets Equity (Fortsetzung)

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>ZAR C2* | Thesaurierende<br>Klasse<br>ZAR E | Thesaurierende<br>Klasse<br>ZAR T |
|--|-------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                     |                                   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                     |                                   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 362                                 | 28.996                            | 169.991                           |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 22                                  | 37.365                            | 74.948                            |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (384)                               | (54.004)                          | (108.032)                         |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | –                                   | 12.357                            | 136.907                           |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                     |                                   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                     |                                   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 9.331                               | 32.536                            | 186.675                           |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 179                                 | 11.109                            | 43.286                            |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (9.148)                             | (14.649)                          | (59.970)                          |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 362                                 | 28.996                            | 169.991                           |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Markets Select Equity\*\*

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I (nicht<br>währungs-<br>gesichert)* | Thesaurierende<br>Klasse<br>JPY I (nicht<br>währungs-<br>gesichert)* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I* | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I5* |
|--|--|--|------------------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |  |  |                                    |                                   |                                     |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |  |  |                                    |                                   |                                     |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | –  | –  | –                                  | –                                 | –                                   |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –  | –  | –                                  | –                                 | –                                   |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –  | –  | –                                  | –                                 | –                                   |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | –  | –  | –                                  | –                                 | –                                   |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |  |  |                                    |                                   |                                     |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |  |  |                                    |                                   |                                     |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 230.967  | 1.141.036  | 9.264.115                          | –                                 | 8.000                               |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 89.745   | –  | 6.235                              | –                                 | –                                   |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (320.712)  | (1.141.036)  | (9.270.350)                        | –                                 | (8.000)                             |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | –  | –  | –                                  | –                                 | –                                   |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

\*\* Das Portfolio wurde am 7. September 2023 aufgelöst.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Euro Bond

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A* | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M* | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR Z* |
|--|------------------------------------|-----------------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                    |                                   |                                  |                                    |                                    |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                    |                                   |                                  |                                    |                                    |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | –                                  | 59.663                            | 978.926                          | –                                  | –                                  |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 24.157                             | 4.142.419                         | 11.934                           | 963                                | 1.484.000                          |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –                                  | (385.016)                         | –                                | –                                  | –                                  |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 24.157                             | 3.817.066                         | 990.860                          | 963                                | 1.484.000                          |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                    |                                   |                                  |                                    |                                    |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                    |                                   |                                  |                                    |                                    |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | –                                  | 7.902                             | 978.926                          | –                                  | –                                  |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                                  | 51.761                            | –                                | –                                  | –                                  |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –                                  | –                                 | –                                | –                                  | –                                  |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | –                                  | 59.663                            | 978.926                          | –                                  | –                                  |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Euro Bond Absolute Return

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A* | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I2* | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I5 | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR Z* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z |
|--|------------------------------------|-----------------------------------|----------------------------------|-------------------------------------|------------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                    |                                   |                                  |                                     |                                    |                                    |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                    |                                   |                                  |                                     |                                    |                                    |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | –                                  | 89.678                            | 930                              | –                                   | 483.875                            | –                                  | 2.523.212                         |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 962                                | 1.476.845                         | –                                | 400.000                             | 555.889                            | 1.963.000                          | –                                 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –                                  | (66.026)                          | –                                | –                                   | –                                  | –                                  | –                                 |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 962                                | 1.500.497                         | 930                              | 400.000                             | 1.039.764                          | 1.963.000                          | 2.523.212                         |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                    |                                   |                                  |                                     |                                    |                                    |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                    |                                   |                                  |                                     |                                    |                                    |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | –                                  | 215.032                           | 930                              | –                                   | 1.768.586                          | –                                  | 2.708.212                         |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                                  | 3.788                             | –                                | –                                   | 60.992                             | –                                  | –                                 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –                                  | (129.142)                         | –                                | –                                   | (1.345.703)                        | –                                  | (185.000)                         |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | –                                  | 89.678                            | 930                              | –                                   | 483.875                            | –                                  | 2.523.212                         |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## European High Yield Bond

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF I* | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I2* | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I5* | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I5* | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR X | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR Y* | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR Y* | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD A<br>(Monatlich) |
|--|------------------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|---|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                    |                                   |                                     |                                     |                                    |                                   |                                   |                                    |                                   |   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                    |                                   |                                     |                                     |                                    |                                   |                                   |                                    |                                   |   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 167.120                            | 3.369.635                         | 19.772                              | 599.602                             | –                                  | 62.706                            | 3.967.989                         | 24.912.632                         | 273.800                           | 38.924  |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 168.328                            | 5.945.230                         | 466.946                             | –                                   | 270.000                            | 51.511                            | 1.092.511                         | 14.185.424                         | 454.086                           | 153.352   |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (65.613)                           | (2.888.243)                       | (18.297)                            | (599.602)                           | –                                  | (20.138)                          | (554.302)                         | (11.033.429)                       | –                                 | (49.789)  |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 269.835                            | 6.426.622                         | 468.421                             | –                                   | 270.000                            | 94.079                            | 4.506.198                         | 28.064.627                         | 727.886                           | 142.487   |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                    |                                   |                                     |                                     |                                    |                                   |                                   |                                    |                                   |   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                    |                                   |                                     |                                     |                                    |                                   |                                   |                                    |                                   |   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | –                                  | 70.978                            | –                                   | –                                   | –                                  | 46.402                            | 484.244                           | –                                  | –                                 | 39.764  |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 169.131                            | 3.345.324                         | 19.772                              | 599.602                             | –                                  | 39.741                            | 3.578.268                         | 25.017.638                         | 273.800                           | 10.696  |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (2.011)                            | (46.667)                          | –                                   | –                                   | –                                  | (23.437)                          | (94.523)                          | (105.006)                          | –                                 | (11.536)  |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 167.120                            | 3.369.635                         | 19.772                              | 599.602                             | –                                  | 62.706                            | 3.967.989                         | 24.912.632                         | 273.800                           | 38.924  |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

European High Yield Bond (Fortsetzung)

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD X | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z |
|--|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 13.855                            | 42.152                            | 1.488.265                         |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 360.150                           | –                                 | 171.858                           |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (13.856)                          | (211)                             | (386)                             |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 360.149                           | 41.941                            | 1.659.737                         |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 16.131                            | 222.524                           | 2.161.439                         |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                                 | 38.512                            | 626.959                           |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (2.276)                           | (218.884)                         | (1.300.133)                       |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 13.855                            | 42.152                            | 1.488.265                         |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## European Sustainable Equity

|  | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR A | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I3 | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I5 | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR Z | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A (nicht<br>währungs-<br>gesichert) | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I (nicht<br>währungs-<br>gesichert) | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M (nicht<br>währungs-<br>gesichert) |
|--|----------------------------------|-----------------------------------|----------------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|---|---|---|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                  |                                   |                                  |                                   |                                    |                                   |                                   |   |   |   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                  |                                   |                                  |                                   |                                    |                                   |                                   |   |   |   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 2.627                            | 3.190                             | 1.027                            | 12.257.986                        | 219.236                            | 3.837                             | 5.217.098                         | 1.000   | 1.000   | 1.000   |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                                | –                                 | –                                | 444.399                           | 4.433                              | 2.414                             | –                                 | –   | –   | –   |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –                                | (1.250)                           | –                                | (3.746.893)                       | (59.407)                           | (1.230)                           | (7.632)                           | –   | –   | –   |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 2.627                            | 1.940                             | 1.027                            | 8.955.492                         | 164.262                            | 5.021                             | 5.209.466                         | 1.000   | 1.000   | 1.000   |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                  |                                   |                                  |                                   |                                    |                                   |                                   |   |   |   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                  |                                   |                                  |                                   |                                    |                                   |                                   |   |   |   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 2.627                            | 3.190                             | 1.027                            | 16.220.988                        | 212.473                            | 2.396                             | 3.569.643                         | 1.000   | 1.971.793   | 1.000   |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 1.090                            | –                                 | –                                | 1.308.425                         | 24.661                             | 1.825                             | 1.647.905                         | –   | –   | –   |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (1.090)                          | –                                 | –                                | (5.271.427)                       | (17.898)                           | (384)                             | (450)                             | –   | (1.970.793)   | –   |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 2.627                            | 3.190                             | 1.027                            | 12.257.986                        | 219.236                            | 3.837                             | 5.217.098                         | 1.000   | 1.000   | 1.000   |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Event Driven

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I* | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I5* | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I5 | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP I5 | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP P | Thesaurierende<br>Klasse<br>JPY I* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I5 |
|--|------------------------------------|------------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                    |                                    |                                    |                                   |                                   |                                    |                                   |                                    |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                    |                                    |                                    |                                   |                                   |                                    |                                   |                                    |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 923                                | –                                  | 7.222.358                          | 1.149.534                         | 2.584                             | –                                  | 1.000                             | 1.304.597                          |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 45.999                             | 113.761                            | 7.396.854                          | 4.345.795                         | 3.509                             | 3.578.529                          | –                                 | 2.447.123                          |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –                                  | –                                  | (3.453.829)                        | (1.108.382)                       | (358)                             | –                                  | –                                 | (462.073)                          |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 46.922                             | 113.761                            | 11.165.383                         | 4.386.947                         | 5.735                             | 3.578.529                          | 1.000                             | 3.289.647                          |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                    |                                    |                                    |                                   |                                   |                                    |                                   |                                    |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                    |                                    |                                    |                                   |                                   |                                    |                                   |                                    |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | –                                  | –                                  | 2.369.000                          | 2.584                             | 2.584                             | –                                  | 1.001.000                         | 242.352                            |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 39.011                             | –                                  | 5.976.587                          | 1.354.344                         | –                                 | –                                  | –                                 | 1.198.538                          |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (38.088)                           | –                                  | (1.123.229)                        | (207.394)                         | –                                 | –                                  | (1.000.000)                       | (136.293)                          |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 923                                | –                                  | 7.222.358                          | 1.149.534                         | 2.584                             | –                                  | 1.000                             | 1.304.597                          |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Global Bond

|  | Ausschüttende<br>Klasse<br>AUD T<br>(Monatlich)* | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I<br>Benchmark<br>Währungs-<br>gesicherte* | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP P* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD C1 | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>Benchmark | Währungsgesicherte<br>Klasse | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD T<br>(Monatlich)* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z | Ausschüttende<br>Klasse<br>ZAR T<br>(Monatlich)* |
|--|--|--|-----------------------------------|------------------------------------|--|------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|--|-----------------------------------|--|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |  |  |                                   |                                    |  |                              |                                   |                                   |  |                                   |  |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |  |  |                                   |                                    |  |                              |                                   |                                   |  |                                   |  |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 3.937  | 2.766  | –                                 | 37.741                             | 3.000  | 313.181                      | 44.082                            | 3.000                             | 9.704.719  | 4.481                             |  |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –  | 750.000  | 2.331                             | –                                  | 2.405  | 105.138                      | 116.761                           | –                                 | 229.847  | –                                 |  |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (3.937)  | –  | –                                 | (9.505)                            | –  | (170.952)                    | (32.331)                          | (3.000)                           | (1.546.847)                                      | (4.481)                           |  |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | –  | 752.766  | 2.331                             | 28.236                             | 5.405  | 247.367                      | 128.512                           | –                                 | 8.387.719  | –                                 |  |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |  |  |                                   |                                    |  |                              |                                   |                                   |  |                                   |  |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |  |  |                                   |                                    |  |                              |                                   |                                   |  |                                   |  |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 3.937  | –  | –                                 | 48.437                             | 3.000  | 148.271                      | 28.428                            | 3.000                             | 13.134.827                                       | 4.481                             |  |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –  | 2.766  | –                                 | –                                  | –  | 468.227                      | 56.948                            | –                                 | 688.840  | –                                 |  |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –  | –  | –                                 | (10.696)                           | –  | (303.317)                    | (41.294)                          | –                                 | (4.118.948)                                      | –                                 |  |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 3.937  | 2.766  | –                                 | 37.741                             | 3.000  | 313.181                      | 44.082                            | 3.000                             | 9.704.719  | 4.481                             |  |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Global Diversified Income FMP – 2024\*\*

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A* | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR A* | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I* | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP I* | Ausschüttende<br>Klasse<br>HKD A* | Ausschüttende<br>Klasse<br>SGD A* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A* | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD A* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I* | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I* |
|--|------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                    |                                   |                                   |                                   |                                   |                                   |                                    |                                   |                                    |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                    |                                   |                                   |                                   |                                   |                                   |                                    |                                   |                                    |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 122.227                            | 25.000                            | 100.000                           | 204.999                           | 750.000                           | 237.720                           | 2.590.528                          | 4.026.477                         | 253.567                            | 224.117                           |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                                  | –                                 | –                                 | –                                 | –                                 | –                                 | –                                  | 1.572                             | –                                  | –                                 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (122.227)                          | (25.000)                          | (100.000)                         | (204.999)                         | (750.000)                         | (237.720)                         | (2.590.528)                        | (4.028.049)                       | (253.567)                          | (224.117)                         |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | –                                  | –                                 | –                                 | –                                 | –                                 | –                                 | –                                  | –                                 | –                                  | –                                 |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                    |                                   |                                   |                                   |                                   |                                   |                                    |                                   |                                    |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                    |                                   |                                   |                                   |                                   |                                   |                                    |                                   |                                    |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 122.227                            | 25.000                            | 100.000                           | 214.842                           | 750.000                           | 262.720                           | 2.950.200                          | 4.579.424                         | 253.567                            | 224.117                           |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                                  | –                                 | –                                 | –                                 | –                                 | –                                 | –                                  | 3.995                             | –                                  | –                                 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –                                  | –                                 | –                                 | (9.843)                           | –                                 | (25.000)                          | (359.672)                          | (556.942)                         | –                                  | –                                 |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 122.227                            | 25.000                            | 100.000                           | 204.999                           | 750.000                           | 237.720                           | 2.590.528                          | 4.026.477                         | 253.567                            | 224.117                           |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

\*\* Das Portfolio wurde am 28. Juni 2024 aufgelöst.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Global Diversified Income FMP – 2024\*\* (Fortsetzung)

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD X* | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD X* |
|--|------------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                    |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                    |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 2.104.508                          | 5.781.902                         |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                                  | –                                 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (2.104.508)                        | (5.781.902)                       |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | –                                  | –                                 |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                    |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                    |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 2.104.508                          | 5.781.902                         |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                                  | –                                 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –                                  | –                                 |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 2.104.508                          | 5.781.902                         |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

\*\* Das Portfolio wurde am 28. Juni 2024 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Global Equity Megatrends

|  | Thesaurierende Klasse<br>EUR A (nicht währungs-<br>gesichert)* | Thesaurierende Klasse<br>EUR I* | Thesaurierende Klasse<br>EUR M (nicht währungs-<br>gesichert) | Thesaurierende Klasse<br>GBP I4 (nicht währungs-<br>gesichert)* | Ausschüttende Klasse<br>GBP I4 (nicht währungs-<br>gesichert)* | Thesaurierende Klasse<br>GBP P (nicht währungs-<br>gesichert)* | Thesaurierende Klasse<br>HKD A* | Thesaurierende Klasse<br>SGD A* | Thesaurierende Klasse<br>USD A | Thesaurierende Klasse<br>USD C1 |
|--|--|---------------------------------|---|---|--|--|---------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |  |                                 |   |   |  |  |                                 |                                 |                                |                                 |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |  |                                 |   |   |  |  |                                 |                                 |                                |                                 |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | –  | 756.031                         | 487.728   | –   | –  | 786  | –                               | 2.010                           | 2.891.227                      | 257.418                         |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 6.538  | 1.626.630                       | 1.056.456   | 4.361.940   | 312.856  | 33.704   | 23.311                          | 618.872                         | 6.805.738                      | –                               |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –  | (646.687)                       | (94.328)  | (206.759)   | –  | (2.611)  | –                               | (105.703)                       | (974.136)                      | (58.970)                        |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 6.538  | 1.735.974                       | 1.449.856   | 4.155.181   | 312.856  | 31.879   | 23.311                          | 515.179                         | 8.722.829                      | 198.448                         |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |  |                                 |   |   |  |  |                                 |                                 |                                |                                 |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |  |                                 |   |   |  |  |                                 |                                 |                                |                                 |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | –  | –                               | 392.901   | –   | –  | –  | –                               | –                               | 2.717.651                      | 302.253                         |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –  | 757.848                         | 152.789   | –   | –  | 786  | –                               | 2.010                           | 1.009.129                      | –                               |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –  | (1.817)                         | (57.962)  | –   | –  | –  | –                               | –                               | (835.553)                      | (44.835)                        |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | –  | 756.031                         | 487.728   | –   | –  | 786  | –                               | 2.010                           | 2.891.227                      | 257.418                         |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Global Equity Megatrends (Fortsetzung)

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I4* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD U* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z |
|--|-----------------------------------|-------------------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                     |                                   |                                    |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                     |                                   |                                    |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 2.198.918                         | –                                   | 1.520.838                         | –                                  | 2.111.021                         |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 4.352.771                         | 425.380                             | 2.673.365                         | 18.052                             | 2.282.915                         |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (1.295.372)                       | (35.056)                            | (400.865)                         | –                                  | (507.483)                         |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 5.256.317                         | 390.324                             | 3.793.338                         | 18.052                             | 3.886.453                         |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                     |                                   |                                    |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                     |                                   |                                    |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 747.642                           | –                                   | 1.482.972                         | –                                  | 1.012.699                         |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 2.092.148                         | –                                   | 488.858                           | –                                  | 1.098.322                         |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (640.872)                         | –                                   | (450.992)                         | –                                  | –                                 |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 2.198.918                         | –                                   | 1.520.838                         | –                                  | 2.111.021                         |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Global Flexible Credit Income

|  | Thesaurierende   |                 |                 |                  |                  | Ausschüttende                   |                 |                 |                 |                 |
|--|------------------|-----------------|-----------------|------------------|------------------|---------------------------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
|  | Klasse<br>CAD I5 | Klasse<br>EUR I | Klasse<br>EUR M | Klasse<br>GBP I5 | Klasse<br>GBP P* | Klasse<br>USD A<br>(Monatlich)* | Klasse<br>USD A | Klasse<br>USD I | Klasse<br>USD I | Klasse<br>USD M |
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                  |                 |                 |                  |                  |                                 |                 |                 |                 |                 |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                  |                 |                 |                  |                  |                                 |                 |                 |                 |                 |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 1.396.587        | 405.625         | 44.344          | 12.916.811       | –                | –                               | 915.023         | 13.310.830      | 34.986          | 604.292         |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                | 445.612         | 118.773         | 1.816.692        | 2.331            | 450.653                         | 1.610.030       | 796.560         | 54.425          | 756.001         |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (181.488)        | (578.078)       | (6.511)         | (2.400.590)      | –                | (14.231)                        | (180.019)       | (114.254)       | (11.905)        | (146.307)       |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 1.215.099        | 273.159         | 156.606         | 12.332.913       | 2.331            | 436.422                         | 2.345.034       | 13.993.136      | 77.506          | 1.213.986       |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                  |                 |                 |                  |                  |                                 |                 |                 |                 |                 |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                  |                 |                 |                  |                  |                                 |                 |                 |                 |                 |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 1.500.000        | 376.242         | 42.202          | 18.706.078       | –                | –                               | 937.398         | 11.735.927      | 34.986          | 580.784         |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                | 399.091         | 8.248           | 1.524.684        | –                | –                               | 166.296         | 2.115.137       | –               | 85.523          |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (103.413)        | (369.708)       | (6.106)         | (7.313.951)      | –                | –                               | (188.671)       | (540.234)       | –               | (62.015)        |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 1.396.587        | 405.625         | 44.344          | 12.916.811       | –                | –                               | 915.023         | 13.310.830      | 34.986          | 604.292         |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Global Flexible Credit Income (Fortsetzung)

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD U* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z |
|--|------------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                    |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                    |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | –                                  | 495.794                           |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 20.000                             | 15.122                            |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –                                  | (2.876)                           |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 20.000                             | 508.040                           |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                    |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                    |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | –                                  | 485.090                           |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                                  | 10.704                            |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –                                  | –                                 |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | –                                  | 495.794                           |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Global High Yield Engagement

|  | Ausschüttende<br>Klasse<br>AUD I | Thesaurierende<br>Klasse<br>AUD I4* | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF I4 | Ausschüttende<br>Klasse<br>CHF I4 | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF X | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I4 | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I4 | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR X | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR Z (PF) | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I4 |
|--|----------------------------------|-------------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|--|------------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                  |                                     |                                    |                                   |                                   |                                    |                                   |                                   |  |                                    |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                  |                                     |                                    |                                   |                                   |                                    |                                   |                                   |  |                                    |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 4.223                            | –                                   | 7.400.811                          | 512.402                           | 2.931                             | 6.255.476                          | 115.676                           | 2.846                             | 2.065.762                              | 1.715.074                          |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                                | 464.202                             | 1.434.061                          | 21.636                            | –                                 | 703.106                            | 11.700                            | 5.000                             | 883.488                                | 124.429                            |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –                                | (21.656)                            | (1.651.731)                        | (45.476)                          | –                                 | (1.664.987)                        | (19.655)                          | –                                 | (325.339)                              | (272.299)                          |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 4.223                            | 442.546                             | 7.183.141                          | 488.562                           | 2.931                             | 5.293.595                          | 107.721                           | 7.846                             | 2.623.911                              | 1.567.204                          |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                  |                                     |                                    |                                   |                                   |                                    |                                   |                                   |  |                                    |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                  |                                     |                                    |                                   |                                   |                                    |                                   |                                   |  |                                    |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 4.223                            | –                                   | 3.658.671                          | 226.381                           | 2.931                             | 3.611.348                          | 96.247                            | 2.846                             | 2.044.067                              | 833.380                            |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                                | –                                   | 4.875.169                          | 343.161                           | –                                 | 4.502.144                          | 55.133                            | –                                 | 255.131                                | 1.182.689                          |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –                                | –                                   | (1.133.029)                        | (57.140)                          | –                                 | (1.858.016)                        | (35.704)                          | –                                 | (233.436)                              | (300.995)                          |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 4.223                            | –                                   | 7.400.811                          | 512.402                           | 2.931                             | 6.255.476                          | 115.676                           | 2.846                             | 2.065.762                              | 1.715.074                          |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Global High Yield Engagement (Fortsetzung)

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP X | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I4 | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD M | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD X | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z |
|--|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                   |                                   |                                    |                                  |                                   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                   |                                   |                                    |                                  |                                   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 2.398                             | 50.218                            | 414.972                           | 30.315.811                         | 157.952                          | 2.013                             | 657.453                           |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                                 | 76.914                            | 38.385                            | 10.489.356                         | 3.882                            | –                                 | –                                 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –                                 | (3.740)                           | (452.382)                         | (7.281.973)                        | (3.091)                          | –                                 | (2.226)                           |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 2.398                             | 123.392                           | 975                               | 33.523.194                         | 158.743                          | 2.013                             | 655.227                           |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                   |                                   |                                    |                                  |                                   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                   |                                   |                                    |                                  |                                   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 2.398                             | 53.218                            | 6.992                             | 22.306.996                         | 157.097                          | 2.013                             | 657.453                           |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                                 | –                                 | 414.155                           | 11.989.848                         | 3.718                            | –                                 | –                                 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –                                 | (3.000)                           | (6.175)                           | (3.981.033)                        | (2.863)                          | –                                 | –                                 |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 2.398                             | 50.218                            | 414.972                           | 30.315.811                         | 157.952                          | 2.013                             | 657.453                           |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Global High Yield Sustainable Action\*\*

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I* | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD X* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Y* |
|--|------------------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                    |                                   |                                    |                                    |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                    |                                   |                                    |                                    |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | –                                  | –                                 | –                                  | –                                  |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                                  | –                                 | –                                  | –                                  |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –                                  | –                                 | –                                  | –                                  |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | –                                  | –                                 | –                                  | –                                  |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                    |                                   |                                    |                                    |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                    |                                   |                                    |                                    |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 1.000                              | 1.458.132                         | 1.000                              | 300.000                            |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                                  | –                                 | –                                  | –                                  |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (1.000)                            | (1.458.132)                       | (1.000)                            | (300.000)                          |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | –                                  | –                                 | –                                  | –                                  |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

\*\* Das Portfolio wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Global Investment Grade Credit

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I* | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP P* | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP X* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD X | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z |
|--|------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                    |                                   |                                   |                                   |                                   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                    |                                   |                                   |                                   |                                   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 2.730                              | –                                 | –                                 | 192.205                           | 4.334.117                         | 4.798.535                         |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                                  | 2.330                             | 7.470.894                         | 966.166                           | 165.336                           | –                                 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –                                  | –                                 | –                                 | –                                 | –                                 | (1.498.000)                       |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 2.730                              | 2.330                             | 7.470.894                         | 1.158.371                         | 4.499.453                         | 3.300.535                         |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                    |                                   |                                   |                                   |                                   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                    |                                   |                                   |                                   |                                   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | –                                  | –                                 | –                                 | 145.058                           | 5.002.702                         | 4.998.000                         |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 2.730                              | –                                 | –                                 | 51.487                            | –                                 | 535                               |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –                                  | –                                 | –                                 | (4.340)                           | (668.585)                         | (200.000)                         |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 2.730                              | –                                 | –                                 | 192.205                           | 4.334.117                         | 4.798.535                         |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Global Opportunistic Bond

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP P | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I2 | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I2* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z |
|--|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                   |                                   |                                   |                                  |                                    |                                    |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                   |                                   |                                   |                                  |                                    |                                    |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 1.530                             | 2.295                             | 1.927                             | 392.969                           | 1.251.368                        | 2.123.351                          | –                                  | 2.357.233                         |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                                 | –                                 | –                                 | 341.675                           | –                                | 85.733                             | 1.891.680                          | –                                 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –                                 | –                                 | (373)                             | (11.212)                          | –                                | (1.712.675)                        | –                                  | (317.784)                         |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 1.530                             | 2.295                             | 1.554                             | 723.432                           | 1.251.368                        | 496.409                            | 1.891.680                          | 2.039.449                         |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                   |                                   |                                   |                                  |                                    |                                    |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                   |                                   |                                   |                                  |                                    |                                    |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 967.405                           | 2.295                             | 47.120                            | 379.169                           | 942.090                          | 2.391.648                          | –                                  | 2.868.980                         |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 1.530                             | –                                 | 853                               | 23.993                            | 309.278                          | 22.772                             | –                                  | 84.231                            |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (967.405)                         | –                                 | (46.046)                          | (10.193)                          | –                                | (291.069)                          | –                                  | (595.978)                         |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 1.530                             | 2.295                             | 1.927                             | 392.969                           | 1.251.368                        | 2.123.351                          | –                                  | 2.357.233                         |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Global Real Estate Securities\*\*

|  | Thesaurierende Klasse        |                              | EUR Z (nicht währungs-gesichert)* | Thesaurierende Klasse |               |                | Ausschüttende Klasse |                              |                              | Thesaurierende Klasse |
|--|------------------------------|------------------------------|-----------------------------------|-----------------------|---------------|----------------|----------------------|------------------------------|------------------------------|-----------------------|
|  | Ausschüttende Klasse EUR I5* | Thesaurierende Klasse EUR M* |                                   | Klasse GBP Z*         | Klasse USD A* | Klasse USD C1* | Klasse USD I*        | Ausschüttende Klasse USD I5* | Thesaurierende Klasse USD M* |                       |
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                              |                              |                                   |                       |               |                |                      |                              |                              |                       |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                              |                              |                                   |                       |               |                |                      |                              |                              |                       |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | –                            | 86.312                       | 18.144                            | 7.307                 | 329.901       | 14.639         | 914.915              | 3.315                        | 75.566                       | 174.112               |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                            | 4.312                        | –                                 | 4.013                 | 19.005        | –              | 210.072              | –                            | 5.223                        | 172.920               |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –                            | (90.624)                     | (18.144)                          | (11.320)              | (348.906)     | (14.639)       | (1.124.987)          | (3.315)                      | (80.789)                     | (347.032)             |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | –                            | –                            | –                                 | –                     | –             | –              | –                    | –                            | –                            | –                     |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                              |                              |                                   |                       |               |                |                      |                              |                              |                       |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                              |                              |                                   |                       |               |                |                      |                              |                              |                       |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 1.173.704                    | 103.501                      | 9.210                             | 7.307                 | 437.183       | 14.639         | 1.323.134            | 320.057                      | 74.771                       | 277.113               |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 146.514                      | 7.341                        | 9.234                             | –                     | 28.812        | –              | 97.887               | –                            | 2.817                        | –                     |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (1.320.218)                  | (24.530)                     | (300)                             | –                     | (136.094)     | –              | (506.106)            | (316.742)                    | (2.022)                      | (103.001)             |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | –                            | 86.312                       | 18.144                            | 7.307                 | 329.901       | 14.639         | 914.915              | 3.315                        | 75.566                       | 174.112               |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

\*\* Das Portfolio wurde am 31. Dezember 2024 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Global Sustainable Equity

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I5 (nicht<br>währungs-<br>gesichert) | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M (nicht<br>währungs-<br>gesichert) | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR Z (nicht<br>währungs-<br>gesichert) | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I (nicht<br>währungs-<br>gesichert) | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I5 (nicht<br>währungs-<br>gesichert) | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z |
|--|--|---|---|---|--|-----------------------------------|-----------------------------------|----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |  |   |   |   |  |                                   |                                   |                                  |                                   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |  |   |   |   |  |                                   |                                   |                                  |                                   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 7.177.571  | 6.933   | 122.824   | 85.086  | 381.373  | 52.873                            | 1.022.439                         | 1.131                            | 40.218                            | 3.665.763                         |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 141.988  | 2.801   | –   | 230.569   | 117.952  | –                                 | 108.138                           | –                                | –                                 | 2.905.363                         |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (1.083.870)  | (813)   | (2.395)   | (40.339)  | (89.683)   | (49.536)                          | (1.076.385)                       | –                                | (37.496)                          | (3.265.936)                       |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 6.235.689  | 8.921   | 120.429   | 275.316   | 409.642  | 3.337                             | 54.192                            | 1.131                            | 2.722                             | 3.305.190                         |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |  |   |   |   |  |                                   |                                   |                                  |                                   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |  |   |   |   |  |                                   |                                   |                                  |                                   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 7.828.939  | 6.081   | 124.615   | 53.508  | 404.831  | 71.933                            | 1.202.620                         | 1.131                            | 42.328                            | 3.468.551                         |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 859.111  | 852   | 664   | 53.464  | 99.618   | 18.698                            | 310.136                           | –                                | –                                 | 286.772                           |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (1.510.479)  | –   | (2.455)   | (21.886)  | (123.076)  | (37.758)                          | (490.317)                         | –                                | (2.110)                           | (89.560)                          |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 7.177.571  | 6.933   | 122.824   | 85.086  | 381.373  | 52.873                            | 1.022.439                         | 1.131                            | 40.218                            | 3.665.763                         |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Global Value

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I5 (nicht<br>währungs-<br>gesichert) | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP P (nicht<br>währungs-<br>gesichert)* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I3* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z |
|--|-----------------------------------|--|--|-----------------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |  |  |                                   |                                   |                                     |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |  |  |                                   |                                   |                                     |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 33.018                            | 927  | 823  | 75.626                            | 537.426                           | 2.802.961                           | 563.360                           |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 1.519                             | 1.244.330  | 27.591   | 55.412                            | 156.992                           | 506.739                             | 194.244                           |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (10.638)                          | (106.815)  | (938)  | (20.609)                          | (227.654)                         | (3.309.700)                         | (85.461)                          |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 23.899                            | 1.138.442  | 27.476   | 110.429                           | 466.764                           | –                                   | 672.143                           |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |  |  |                                   |                                   |                                     |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |  |  |                                   |                                   |                                     |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 34.497                            | 927  | –  | 132.262                           | 178.944                           | 2.442.209                           | 1.062.770                         |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 4.179                             | –  | 823  | 31.243                            | 441.693                           | 580.185                             | –                                 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (5.658)                           | –  | –  | (87.879)                          | (83.211)                          | (219.433)                           | (499.410)                         |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 33.018                            | 927  | 823  | 75.626                            | 537.426                           | 2.802.961                           | 563.360                           |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

High Yield Bond

|  | Ausschüttende<br>Klasse Thesaurierende<br>AUD A<br>(Monatlich) | Klasse<br>AUD A | Ausschüttende<br>Klasse Thesaurierende<br>AUD B<br>(Monatlich) | Klasse<br>AUD B | Ausschüttende<br>Klasse<br>AUD C2<br>(Monatlich)* | Ausschüttende<br>Klasse Thesaurierende<br>AUD E<br>(Monatlich) | Klasse<br>AUD E | Ausschüttende<br>Klasse<br>AUD I | Ausschüttende<br>Klasse<br>AUD T<br>(Monatlich) | Klasse<br>AUD T<br>(Wöchentlich) |
|--|--|-----------------|--|-----------------|---|--|-----------------|----------------------------------|---|----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |  |                 |  |                 |   |  |                 |                                  |   |                                  |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |  |                 |  |                 |   |  |                 |                                  |   |                                  |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 2.440.945  | 190.596         | 2.105.142  | 108.327         | 654   | 298.441  | 34.386          | 1.802.116                        | 12.757.978                                      | 135.945                          |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 24.251   | 952             | 1.203.930  | 140.413         | –   | 1.058.137  | 79.887          | 113.702                          | 467.646   | 241                              |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (90.036)   | (94.687)        | (1.013.214)  | (149.452)       | (654)   | (614.868)  | (69.394)        | (996.421)                        | (1.875.869)                                     | (22.445)                         |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 2.375.160  | 96.861          | 2.295.858  | 99.288          | –   | 741.710  | 44.879          | 919.397                          | 11.349.755                                      | 113.741                          |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |  |                 |  |                 |   |  |                 |                                  |   |                                  |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |  |                 |  |                 |   |  |                 |                                  |   |                                  |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 2.927.970  | 242.834         | 3.006.534  | 104.092         | 85.032  | 192.233  | 40.111          | 2.691.160                        | 13.609.831                                      | 143.194                          |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 25.904   | –               | 418.352  | 36.589          | 48  | 294.551  | 45.985          | 49.415                           | 1.019.120                                       | 1.336                            |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (512.929)  | (52.238)        | (1.319.744)  | (32.354)        | (84.426)  | (188.343)  | (51.710)        | (938.459)                        | (1.870.973)                                     | (8.585)                          |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 2.440.945  | 190.596         | 2.105.142  | 108.327         | 654   | 298.441  | 34.386          | 1.802.116                        | 12.757.978                                      | 135.945                          |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## High Yield Bond (Fortsetzung)

|  | Ausschüttende                     |                                |                                   |                                   |                                    | Ausschüttende                  |                                |                                | Ausschüttende                     |                                  |
|--|-----------------------------------|--------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|-----------------------------------|----------------------------------|
|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>AUD T | Klasse<br>CAD A<br>(Monatlich) | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF A | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF I | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF I2 | Klasse<br>CNY A<br>(Monatlich) | Klasse<br>CNY I<br>(Monatlich) | Klasse<br>EUR A<br>(Monatlich) | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR A |
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                |                                   |                                   |                                    |                                |                                |                                |                                   |                                  |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                |                                   |                                   |                                    |                                |                                |                                |                                   |                                  |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 119.342                           | 886.862                        | 238.365                           | 16.907                            | 217.575                            | 157.714                        | 2.682                          | 954.319                        | 279.633                           | 352.323                          |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 37.160                            | 242.843                        | 18.280                            | 10.592                            | –                                  | 169                            | –                              | 203.323                        | 1.570                             | 8.418                            |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (45.022)                          | (141.141)                      | (49.205)                          | (1.591)                           | (24.419)                           | (4.629)                        | –                              | (118.521)                      | (62.707)                          | (46.738)                         |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 111.480                           | 988.564                        | 207.440                           | 25.908                            | 193.156                            | 153.254                        | 2.682                          | 1.039.121                      | 218.496                           | 314.003                          |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                |                                   |                                   |                                    |                                |                                |                                |                                   |                                  |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                |                                   |                                   |                                    |                                |                                |                                |                                   |                                  |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 169.905                           | 982.013                        | 319.845                           | 432.280                           | 176.009                            | 191.923                        | 2.682                          | 1.065.293                      | 1.112.989                         | 418.681                          |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 20.843                            | 14.335                         | 2.455                             | 17.291                            | 73.974                             | 754                            | –                              | 109.148                        | 518.681                           | 143                              |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (71.406)                          | (109.486)                      | (83.935)                          | (432.664)                         | (32.408)                           | (34.963)                       | –                              | (220.122)                      | (1.352.037)                       | (66.501)                         |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 119.342                           | 886.862                        | 238.365                           | 16.907                            | 217.575                            | 157.714                        | 2.682                          | 954.319                        | 279.633                           | 352.323                          |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

|  | Thesaurierende  |                 | Ausschüttende    |                  | Thesaurierende  |                 | Ausschüttende                  |                 | Thesaurierende  |                 |
|--|-----------------|-----------------|------------------|------------------|-----------------|-----------------|--------------------------------|-----------------|-----------------|-----------------|
|  | Klasse<br>EUR I | Klasse<br>EUR I | Klasse<br>EUR I2 | Klasse<br>EUR I2 | Klasse<br>EUR M | Klasse<br>EUR Z | Klasse<br>GBP A<br>(Monatlich) | Klasse<br>GBP A | Klasse<br>GBP A | Klasse<br>GBP I |
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                 |                 |                  |                  |                 |                 |                                |                 |                 |                 |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                 |                 |                  |                  |                 |                 |                                |                 |                 |                 |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 1.037.098       | 623.068         | 4.098.608        | 8.332.751        | 3.060           | 15.212          | 423.657                        | 99.388          | 120.609         | 334.886         |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 287.026         | 28.736          | 2.680.952        | 1.631.909        | –               | 1.294           | 2.727                          | –               | 47              | 27.409          |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (303.460)       | (5.161)         | (1.002.496)      | (2.255.649)      | (860)           | –               | (139.794)                      | (15.734)        | –               | (2.715)         |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 1.020.664       | 646.643         | 5.777.064        | 7.709.011        | 2.200           | 16.506          | 286.590                        | 83.654          | 120.656         | 359.580         |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                 |                 |                  |                  |                 |                 |                                |                 |                 |                 |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                 |                 |                  |                  |                 |                 |                                |                 |                 |                 |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 1.304.687       | 751.660         | 1.902.298        | 5.703.153        | 3.914           | 15.212          | 421.494                        | 125.815         | 142.935         | 362.285         |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 235.494         | –               | 2.956.995        | 3.671.796        | –               | –               | 2.163                          | –               | 46              | 4.960           |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (503.083)       | (128.592)       | (760.685)        | (1.042.198)      | (854)           | –               | –                              | (26.427)        | (22.372)        | (32.359)        |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 1.037.098       | 623.068         | 4.098.608        | 8.332.751        | 3.060           | 15.212          | 423.657                        | 99.388          | 120.609         | 334.886         |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## High Yield Bond (Fortsetzung)

|  | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP I | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I2 | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP I2 | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP Z | Ausschüttende<br>Klasse<br>HKD A<br>(Monatlich) | Ausschüttende<br>Klasse<br>JPY A<br>(nicht<br>währungs-<br>gesichert)* | Thesaurierende<br>Klasse<br>SEK A | Ausschüttende<br>Klasse<br>SGD A<br>(Monatlich) | Thesaurierende<br>Klasse<br>SGD A | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD A<br>(Monatlich) |
|--|----------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|---|--|-----------------------------------|---|-----------------------------------|---|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                  |                                    |                                   |                                   |   |  |                                   |   |                                   |   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                  |                                    |                                   |                                   |   |  |                                   |   |                                   |   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 396.769                          | 109.271                            | 22.261.041                        | 9.268                             | 5.500.886                                       | –  | 5.400.849                         | 1.375.365                                       | 168.789                           | 10.799.931                                      |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 2.861                            | 14.364                             | 3.548.266                         | –                                 | 2.495   | 1.458  | 407.120                           | 545.226   | 30.709                            | 2.038.772                                       |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (300.346)                        | (16.826)                           | (7.804.835)                       | (6.539)                           | (1.075.654)                                     | –  | (3.841.940)                       | (270.646)                                       | (97.640)                          | (1.734.319)                                     |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 99.284                           | 106.809                            | 18.004.472                        | 2.729                             | 4.427.727                                       | 1.458  | 1.966.029                         | 1.649.945                                       | 101.858                           | 11.104.384                                      |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                  |                                    |                                   |                                   |   |  |                                   |   |                                   |   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                  |                                    |                                   |                                   |   |  |                                   |   |                                   |   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 881.445                          | 46.512                             | 16.921.590                        | 12.701                            | 5.896.017                                       | –  | 626.951                           | 1.638.642                                       | 108.171                           | 13.466.807                                      |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 9.982                            | 65.479                             | 10.368.432                        | –                                 | 3.089   | –  | 5.557.328                         | 15.494  | 204.439                           | 745.002   |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (494.658)                        | (2.720)                            | (5.028.981)                       | (3.433)                           | (398.220)                                       | –  | (783.430)                         | (278.771)                                       | (143.821)                         | (3.411.878)                                     |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 396.769                          | 109.271                            | 22.261.041                        | 9.268                             | 5.500.886                                       | –  | 5.400.849                         | 1.375.365                                       | 168.789                           | 10.799.931                                      |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

|  | Ausschüttende |                | Ausschüttende |              |                |                | Ausschüttende  |               |              |                |
|--|---------------|----------------|---------------|--------------|----------------|----------------|----------------|---------------|--------------|----------------|
|  | Klasse        | Thesaurierende | Ausschüttende | Klasse       | Thesaurierende | Thesaurierende | Thesaurierende | Ausschüttende | Klasse       | Thesaurierende |
|  | USD A         | Klasse         | Klasse        | USD B        | Klasse         | Klasse         | Klasse         | Klasse        | USD C2       | Klasse         |
|  | (Wöchentlich) | USD A          | USD A         | (Monatlich)  | USD B          | USD C          | USD C1         | USD C1        | (Monatlich)* | USD C2*        |
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |               |                |               |              |                |                |                |               |              |                |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |               |                |               |              |                |                |                |               |              |                |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 352.527       | 7.285.183      | 2.237.864     | 18.271.162   | 777.219        | 69.274         | 215.380        | 68.456        | 2.305        | 536            |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 174.998       | 827.957        | 118.236       | 9.632.145    | 981.493        | –              | –              | 662           | 47           | 22             |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (4.528)       | (1.210.617)    | (356.280)     | (10.067.059) | (896.885)      | (1.661)        | (48.911)       | (3.981)       | (2.352)      | (558)          |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 522.997       | 6.902.523      | 1.999.820     | 17.836.248   | 861.827        | 67.613         | 166.469        | 65.137        | –            | –              |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |               |                |               |              |                |                |                |               |              |                |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |               |                |               |              |                |                |                |               |              |                |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 427.606       | 8.395.075      | 2.530.429     | 20.645.450   | 1.198.731      | 74.079         | 263.716        | 73.867        | 669.843      | 215.498        |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 182           | 874.514        | 68.922        | 4.476.633    | 475.758        | –              | –              | 653           | 42.940       | 276            |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (75.261)      | (1.984.406)    | (361.487)     | (6.850.921)  | (897.270)      | (4.805)        | (48.336)       | (6.064)       | (710.478)    | (215.238)      |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 352.527       | 7.285.183      | 2.237.864     | 18.271.162   | 777.219        | 69.274         | 215.380        | 68.456        | 2.305        | 536            |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## High Yield Bond (Fortsetzung)

|  | Ausschüttende<br>Klasse Thesaurierende<br>USD E<br>Klasse<br>USD E<br>(Monatlich) |           | Ausschüttende<br>Klasse Thesaurierende<br>USD I<br>Klasse<br>USD I<br>(Monatlich) |             | Ausschüttende<br>Klasse Thesaurierende<br>USD I2<br>Klasse<br>USD I2<br>(Monatlich) |           |             | Ausschüttende<br>Klasse Thesaurierende<br>USD I4<br>Klasse<br>USD M<br>(Monatlich) |             |          |
|--|---|-----------|---|-------------|---|-----------|-------------|--|-------------|----------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |   |           |   |             |   |           |             |  |             |          |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |   |           |   |             |   |           |             |  |             |          |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 1.893.798   | 144.820   | 5.353.600   | 10.949.039  | 1.643.875   | 6.585.602 | 14.881.895  | 26.623.262   | 14.898.210  | 34.528   |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 5.211.474   | 495.639   | 1.151.467   | 1.592.446   | 2.572.464   | 104.295   | 1.261.322   | 4.453.415  | –           | 24.760   |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (3.456.151)   | (394.493) | (2.423.275)   | (7.520.134) | (381.520)   | (8.861)   | (2.903.233) | (8.148.862)  | (4.117.546) | (23.315) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 3.649.121   | 245.966   | 4.081.792   | 5.021.351   | 3.834.819   | 6.681.036 | 13.239.984  | 22.927.815   | 10.780.664  | 35.973   |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |   |           |   |             |   |           |             |  |             |          |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |   |           |   |             |   |           |             |  |             |          |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 2.155.711   | 274.864   | 7.910.242   | 16.987.264  | 2.090.887   | 6.620.346 | 19.600.897  | 19.756.247   | 13.975.144  | 45.645   |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 1.667.224   | 94.300    | 548.162   | 1.793.190   | 293.308   | 18.405    | 3.029.018   | 11.662.081   | 923.066     | 7.807    |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (1.929.137)   | (224.344) | (3.104.804)   | (7.831.415) | (740.320)   | (53.149)  | (7.748.020) | (4.795.066)  | –           | (18.924) |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 1.893.798   | 144.820   | 5.353.600   | 10.949.039  | 1.643.875   | 6.585.602 | 14.881.895  | 26.623.262   | 14.898.210  | 34.528   |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

|  | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD M | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD P | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD T<br>(Monatlich) | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD T<br>(Wöchentlich) | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD T | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD U<br>(Monatlich) | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD U | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z | Ausschüttende<br>Klasse<br>ZAR B<br>(Monatlich) | Ausschüttende<br>Klasse<br>ZAR C2<br>(Monatlich)* |
|--|----------------------------------|-----------------------------------|---|---|-----------------------------------|---|-----------------------------------|-----------------------------------|---|---|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                  |                                   |   |   |                                   |   |                                   |                                   |   |   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                  |                                   |   |   |                                   |   |                                   |                                   |   |   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 43.456                           | 154.737                           | 21.991.465                                      | 290.425   | 827.186                           | 107.874   | 507.040                           | 3.154.711                         | 5.631.940                                       | 8.258   |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 3.854                            | 65.297                            | 4.929.616                                       | 3.668   | 511.528                           | –   | –                                 | 130.378                           | 3.868.397                                       | 464   |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (17.879)                         | (161.206)                         | (4.940.913)                                     | (82.085)  | (778.189)                         | –   | (11.620)                          | (2.037.372)                       | (4.851.939)                                     | (8.722)   |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 29.431                           | 58.828                            | 21.980.168                                      | 212.008   | 560.525                           | 107.874   | 495.420                           | 1.247.717                         | 4.648.398                                       | –   |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                  |                                   |   |   |                                   |   |                                   |                                   |   |   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                  |                                   |   |   |                                   |   |                                   |                                   |   |   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 21.113                           | 412.350                           | 23.357.518                                      | 306.646   | 631.356                           | 109.686   | 860.009                           | 5.126.090                         | 6.845.279                                       | 134.051   |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 22.343                           | 66.906                            | 3.193.377                                       | 8.779   | 521.618                           | –   | –                                 | –                                 | 2.370.687                                       | 10.153  |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –                                | (324.519)                         | (4.559.430)                                     | (25.000)  | (325.788)                         | (1.812)   | (352.969)                         | (1.971.379)                       | (3.584.026)                                     | (135.946)   |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 43.456                           | 154.737                           | 21.991.465                                      | 290.425   | 827.186                           | 107.874   | 507.040                           | 3.154.711                         | 5.631.940                                       | 8.258   |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## High Yield Bond (Fortsetzung)

|  | Ausschüttende                                 |                 | Ausschüttende                                 |                 |
|--|---|-----------------|---|-----------------|
|  | Klasse Thesaurierende<br>ZAR E<br>(Monatlich) | Klasse<br>ZAR E | Klasse Thesaurierende<br>ZAR T<br>(Monatlich) | Klasse<br>ZAR T |
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |   |                 |   |                 |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |   |                 |   |                 |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 1.464.579                                     | 31.620          | 25.855.593                                    | 118.468         |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 2.570.700                                     | 121.848         | 2.060.369                                     | 37.797          |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (2.326.540)                                   | (90.741)        | (4.007.115)                                   | (32.695)        |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 1.708.739                                     | 62.727          | 23.908.847                                    | 123.570         |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |   |                 |   |                 |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |   |                 |   |                 |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 1.349.132                                     | 66.616          | 28.203.849                                    | 112.608         |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 793.513                                       | 4.164           | 2.246.458                                     | 41.659          |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (678.066)                                     | (39.160)        | (4.594.714)                                   | (35.799)        |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 1.464.579                                     | 31.620          | 25.855.593                                    | 118.468         |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

InnovAsia

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF I4 | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I4 | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M (nicht<br>währungs-<br>gesichert) | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR X | Thesaurierende<br>Klasse<br>SGD A | Thesaurierende<br>Klasse<br>SGD I4 | Thesaurierende<br>Klasse<br>SGD X | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I |
|--|------------------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|---|-----------------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                    |                                   |                                    |   |                                   |                                   |                                    |                                   |                                   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                    |                                   |                                    |   |                                   |                                   |                                    |                                   |                                   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 64.556                             | 2.539                             | 88.944                             | 3.853   | 495.894                           | 2.031                             | 59.673                             | 18.731                            | 530.756                           | 758.000                           |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                                  | 28                                | –                                  | 9.586   | 113                               | 44.549                            | 332                                | –                                 | –                                 | 4.272                             |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (8.864)                            | (28)                              | (42.386)                           | (10.855)  | –                                 | (44.549)                          | (20.444)                           | (346)                             | (163.960)                         | (758.000)                         |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 55.692                             | 2.539                             | 46.558                             | 2.584   | 496.007                           | 2.031                             | 39.561                             | 18.385                            | 366.796                           | 4.272                             |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                    |                                   |                                    |   |                                   |                                   |                                    |                                   |                                   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                    |                                   |                                    |   |                                   |                                   |                                    |                                   |                                   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 73.557                             | 44.689                            | 126.139                            | 3.853   | 494.894                           | 2.031                             | 52.763                             | 26.368                            | 19.159                            | 476.000                           |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 5.000                              | –                                 | 700                                | –   | 1.000                             | –                                 | 9.486                              | 346                               | 535.520                           | 282.000                           |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (14.001)                           | (42.150)                          | (37.895)                           | –   | –                                 | –                                 | (2.576)                            | (7.983)                           | (23.923)                          | –                                 |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 64.556                             | 2.539                             | 88.944                             | 3.853   | 495.894                           | 2.031                             | 59.673                             | 18.731                            | 530.756                           | 758.000                           |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## InnovAsia (Fortsetzung)

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I4 | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD X |
|--|------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                    |                                   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                    |                                   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 451.276                            | 1.000                             | 186.557                           |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                                  | 2.835                             | –                                 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (134.915)                          | –                                 | (54.971)                          |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 316.361                            | 3.835                             | 131.586                           |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                    |                                   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                    |                                   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 578.306                            | 1.000                             | 268.235                           |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 2.185                              | –                                 | –                                 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (129.215)                          | –                                 | (81.678)                          |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 451.276                            | 1.000                             | 186.557                           |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Japan Equity Engagement

|  | Ausschüttende Klasse<br>EUR I5 | Thesaurierende Klasse<br>GBP I5* | Thesaurierende Klasse<br>GBP I5 (nicht währungs-<br>gesichert)* | Thesaurierende Klasse<br>GBP P (nicht währungs-<br>gesichert) | Thesaurierende Klasse<br>JPY A* | Thesaurierende Klasse<br>JPY I | Ausschüttende Klasse<br>JPY I | Thesaurierende Klasse<br>JPY I5 | Thesaurierende Klasse<br>JPY Z | Thesaurierende Klasse<br>USD A* |
|--|--------------------------------|----------------------------------|---|---|---------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                |                                  |   |   |                                 |                                |                               |                                 |                                |                                 |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                |                                  |   |   |                                 |                                |                               |                                 |                                |                                 |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 2.662                          | 33.410                           | 1.100.075   | 1.319.857   | –                               | 88.436                         | 13.623                        | 753.181                         | 2.938.416                      | –                               |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                              | –                                | 848.814   | 301.010   | 4.678                           | 435.639                        | –                             | –                               | 801                            | 3.000                           |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –                              | (33.410)                         | (52.437)  | (382.603)   | –                               | (41.011)                       | –                             | (120.926)                       | (2.767.223)                    | –                               |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 2.662                          | –                                | 1.896.452   | 1.238.264   | 4.678                           | 483.064                        | 13.623                        | 632.255                         | 171.994                        | 3.000                           |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                |                                  |   |   |                                 |                                |                               |                                 |                                |                                 |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                |                                  |   |   |                                 |                                |                               |                                 |                                |                                 |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 6.356.690                      | 39.504                           | –   | 2.242   | –                               | 347.161                        | 507.443                       | 673.747                         | 4.840.035                      | –                               |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 2.662                          | 7.695                            | 1.104.106   | 1.469.580   | –                               | 34.275                         | 3.180                         | 231.160                         | 786.147                        | –                               |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (6.356.690)                    | (13.789)                         | (4.031)   | (151.965)   | –                               | (293.000)                      | (497.000)                     | (151.726)                       | (2.687.766)                    | –                               |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 2.662                          | 33.410                           | 1.100.075   | 1.319.857   | –                               | 88.436                         | 13.623                        | 753.181                         | 2.938.416                      | –                               |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Japan Equity Engagement (Fortsetzung)

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD 15 (nicht<br>währungs-<br>gesichert)* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD X (nicht<br>währungs-<br>gesichert)* |
|--|------------------------------------|---|--|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                    |   |  |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                    |   |  |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | –                                  | –   | –  |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 3.000                              | 1.018.135   | 4.551.996  |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –                                  | –   | –  |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 3.000                              | 1.018.135   | 4.551.996  |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                    |   |  |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                    |   |  |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | –                                  | –   | –  |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                                  | –   | –  |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –                                  | –   | –  |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | –                                  | –   | –  |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Macro Opportunities FX\*\*

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I* | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP Z* | Thesaurierende<br>Klasse<br>SEK I* | Ausschüttende<br>Klasse<br>SEK I* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z* |
|--|------------------------------------|------------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                    |                                    |                                    |                                   |                                    |                                    |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                    |                                    |                                    |                                   |                                    |                                    |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 135.097                            | 2.005                              | 170.356                            | 373                               | 1.081                              | 7.959                              |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 4.066                              | –                                  | 256                                | –                                 | –                                  | –                                  |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (139.163)                          | (2.005)                            | (170.612)                          | (373)                             | (1.081)                            | (7.959)                            |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | –                                  | –                                  | –                                  | –                                 | –                                  | –                                  |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                    |                                    |                                    |                                   |                                    |                                    |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                    |                                    |                                    |                                   |                                    |                                    |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 115.547                            | 16.762                             | 2.813.386                          | 746                               | 1.081                              | 710.542                            |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 65.287                             | –                                  | 914.490                            | –                                 | –                                  | –                                  |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (45.737)                           | (14.757)                           | (3.557.520)                        | (373)                             | –                                  | (702.583)                          |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 135.097                            | 2.005                              | 170.356                            | 373                               | 1.081                              | 7.959                              |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

\*\* Das Portfolio wurde am 8. Februar 2024 aufgelöst.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Multi-Asset Income\*\*

|  | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP P* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD C1* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I* | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I2* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M* |
|--|-----------------------------------|------------------------------------|-------------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------|------------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                    |                                     |                                    |                                   |                                     |                                    |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                    |                                     |                                    |                                   |                                     |                                    |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | –                                 | –                                  | –                                   | –                                  | –                                 | –                                   | –                                  |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                                 | –                                  | –                                   | –                                  | –                                 | –                                   | –                                  |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –                                 | –                                  | –                                   | –                                  | –                                 | –                                   | –                                  |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | –                                 | –                                  | –                                   | –                                  | –                                 | –                                   | –                                  |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                    |                                     |                                    |                                   |                                     |                                    |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                    |                                     |                                    |                                   |                                     |                                    |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 2.332                             | 652.893                            | 235.557                             | 59.117                             | 12.352                            | –                                   | 147.152                            |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                                 | 1.272                              | –                                   | –                                  | –                                 | –                                   | 1.034                              |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (2.332)                           | (654.165)                          | (235.557)                           | (59.117)                           | (12.352)                          | –                                   | (148.186)                          |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | –                                 | –                                  | –                                   | –                                  | –                                 | –                                   | –                                  |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

\*\* Das Portfolio wurde am 6. Juli 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Next Generation Connectivity

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>AUD A | Thesaurierende<br>Klasse<br>AUD E* | Thesaurierende<br>Klasse<br>AUD I2* | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF A* | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF I* | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF I2* | Thesaurierende<br>Klasse<br>CNY A | Thesaurierende<br>Klasse<br>CNY I2* | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A (nicht<br>währungs-<br>gesichert) |
|--|-----------------------------------|------------------------------------|-------------------------------------|------------------------------------|------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------|-----------------------------------|---|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                    |                                     |                                    |                                    |                                     |                                   |                                     |                                   |   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                    |                                     |                                    |                                    |                                     |                                   |                                     |                                   |   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 1.930.615                         | –                                  | 4.665                               | 2.627                              | 2.627                              | 2.675                               | 29.597                            | 2.181                               | 3.940.974                         | 4.345.418   |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 2.192.586                         | 417.853                            | –                                   | –                                  | –                                  | 2.000                               | –                                 | –                                   | 975.038                           | 3.939.417   |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (2.385.615)                       | (292.169)                          | –                                   | –                                  | –                                  | (2.000)                             | –                                 | –                                   | (1.987.980)                       | (3.407.963)   |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 1.737.586                         | 125.684                            | 4.665                               | 2.627                              | 2.627                              | 2.675                               | 29.597                            | 2.181                               | 2.928.032                         | 4.876.872   |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                    |                                     |                                    |                                    |                                     |                                   |                                     |                                   |   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                    |                                     |                                    |                                    |                                     |                                   |                                     |                                   |   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 2.137.146                         | –                                  | –                                   | –                                  | –                                  | –                                   | 41.590                            | –                                   | 5.175.148                         | 5.791.246   |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 600.388                           | –                                  | 4.665                               | 2.627                              | 2.627                              | 2.675                               | –                                 | 2.181                               | 408.666                           | 1.393.678   |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (806.919)                         | –                                  | –                                   | –                                  | –                                  | –                                   | (11.993)                          | –                                   | (1.642.840)                       | (2.839.506)   |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 1.930.615                         | –                                  | 4.665                               | 2.627                              | 2.627                              | 2.675                               | 29.597                            | 2.181                               | 3.940.974                         | 4.345.418   |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Next Generation Connectivity (Fortsetzung)

|  | Thesaurierende Klasse EUR I | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungs-gesichert) | Thesaurierende Klasse EUR I2* | Thesaurierende Klasse EUR I5 | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungs-gesichert) | Thesaurierende Klasse GBP A | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungs-gesichert) | Thesaurierende Klasse GBP I2* | Thesaurierende Klasse HKD A | Thesaurierende Klasse HKD I2* |
|--|-----------------------------|--|-------------------------------|------------------------------|--|-----------------------------|--|-------------------------------|-----------------------------|-------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                             |  |                               |                              |  |                             |  |                               |                             |                               |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                             |  |                               |                              |  |                             |  |                               |                             |                               |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 3.824.952                   | 3.629.936  | 2.791                         | 1.965                        | 4.808.986  | 794.660                     | 28.742   | 2.400                         | 4.071.052                   | 23.473                        |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 1.825.322                   | 1.112.889  | –                             | –                            | 611.749  | 245.540                     | 6.058  | –                             | 16.207.189                  | 20.633                        |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (1.976.356)                 | (1.975.035)  | –                             | –                            | (2.047.008)  | (474.694)                   | (6.838)  | –                             | (13.727.783)                | –                             |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 3.673.918                   | 2.767.790  | 2.791                         | 1.965                        | 3.373.727  | 565.506                     | 27.962   | 2.400                         | 6.550.458                   | 44.106                        |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                             |  |                               |                              |  |                             |  |                               |                             |                               |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                             |  |                               |                              |  |                             |  |                               |                             |                               |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 5.085.224                   | 4.835.463  | –                             | 194.128                      | 4.899.354  | 1.222.283                   | 68.522   | –                             | 5.414.373                   | –                             |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 1.016.506                   | 1.290.694  | 2.791                         | –                            | 543.853  | 107.886                     | 2.304  | 2.400                         | 2.836.065                   | 23.473                        |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (2.276.778)                 | (2.496.221)  | –                             | (192.163)                    | (634.221)  | (535.509)                   | (42.084)   | –                             | (4.179.386)                 | –                             |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 3.824.952                   | 3.629.936  | 2.791                         | 1.965                        | 4.808.986  | 794.660                     | 28.742   | 2.400                         | 4.071.052                   | 23.473                        |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Next Generation Connectivity (Fortsetzung)

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>SGD A | Thesaurierende<br>Klasse<br>SGD I2* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD E* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I2 | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I3 | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I5 | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M |
|--|-----------------------------------|-------------------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                     |                                   |                                    |                                   |                                  |                                    |                                    |                                    |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                     |                                   |                                    |                                   |                                  |                                    |                                    |                                    |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 1.774.457                         | 2.039                               | 34.823.782                        | 64.850                             | 9.247.584                         | 1.537.418                        | 97.633                             | 8.934.054                          | 1.181.307                          | 2.303.153                         |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 307.161                           | –                                   | 8.283.600                         | 3.237.902                          | 405.759                           | 31.830                           | 74.362                             | 2.910.504                          | 24.424                             | 73.248                            |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (877.975)                         | –                                   | (20.474.311)                      | (2.530.466)                        | (3.900.364)                       | (586.807)                        | (51.633)                           | (931.624)                          | –                                  | (1.256.651)                       |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 1.203.643                         | 2.039                               | 22.633.071                        | 772.286                            | 5.752.979                         | 982.441                          | 120.362                            | 10.912.934                         | 1.205.731                          | 1.119.750                         |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                     |                                   |                                    |                                   |                                  |                                    |                                    |                                    |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                     |                                   |                                    |                                   |                                  |                                    |                                    |                                    |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 2.280.615                         | –                                   | 46.228.556                        | –                                  | 14.717.531                        | 1.931.717                        | 995.963                            | 9.735.467                          | 1.246.071                          | 2.923.879                         |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 38.815                            | 2.039                               | 1.600.865                         | 232.269                            | 662.756                           | 34.656                           | 97.633                             | 475.669                            | –                                  | 115.513                           |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (544.973)                         | –                                   | (13.005.639)                      | (167.419)                          | (6.132.703)                       | (428.955)                        | (995.963)                          | (1.277.082)                        | (64.764)                           | (736.239)                         |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 1.774.457                         | 2.039                               | 34.823.782                        | 64.850                             | 9.247.584                         | 1.537.418                        | 97.633                             | 8.934.054                          | 1.181.307                          | 2.303.153                         |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Next Generation Connectivity (Fortsetzung)

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z | Thesaurierende<br>Klasse<br>ZAR A* | Thesaurierende<br>Klasse<br>ZAR E* |
|--|-----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                    |                                    |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                    |                                    |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 108.424                           | 29.295                             | 16.415                             |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                                 | 455.818                            | 1.325.346                          |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (76.223)                          | (322.221)                          | (1.161.384)                        |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 32.201                            | 162.892                            | 180.377                            |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                    |                                    |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                    |                                    |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 112.195                           | –                                  | –                                  |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                                 | 52.912                             | 26.304                             |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (3.771)                           | (23.617)                           | (9.889)                            |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 108.424                           | 29.295                             | 16.415                             |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Next Generation Mobility

|  | Thesaurierende Klasse EUR A | Thesaurierende Klasse EUR I | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungs-gesichert) | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungs-gesichert) | Thesaurierende Klasse USD A | Thesaurierende Klasse USD C1 | Thesaurierende Klasse USD I | Ausschüttende Klasse USD I | Thesaurierende Klasse USD M | Thesaurierende Klasse USD X |
|--|-----------------------------|-----------------------------|--|--|-----------------------------|------------------------------|-----------------------------|----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                             |                             |  |  |                             |                              |                             |                            |                             |                             |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                             |                             |  |  |                             |                              |                             |                            |                             |                             |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 11.060                      | 3.960                       | 2.336.215  | 1.778.720  | 1.955.262                   | 87.414                       | 523.396                     | 377.069                    | 406.490                     | 1.278.367                   |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 475                         | –                           | 432.303  | 127.484  | 120.680                     | –                            | 1.040.518                   | –                          | 4.453                       | 14.873                      |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (3.643)                     | –                           | (948.836)  | (613.489)  | (533.832)                   | (49.982)                     | (597.010)                   | (186.928)                  | (203.163)                   | (595.650)                   |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 7.892                       | 3.960                       | 1.819.682  | 1.292.715  | 1.542.110                   | 37.432                       | 966.904                     | 190.141                    | 207.780                     | 697.590                     |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                             |                             |  |  |                             |                              |                             |                            |                             |                             |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                             |                             |  |  |                             |                              |                             |                            |                             |                             |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 11.363                      | 32.834                      | 2.748.201  | 1.917.802  | 2.054.173                   | 137.589                      | 370.324                     | 421.606                    | 494.738                     | 1.910.978                   |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 4.324                       | –                           | 475.757  | 257.194  | 323.919                     | –                            | 384.544                     | 2.198                      | 34.103                      | –                           |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (4.627)                     | (28.874)                    | (887.743)  | (396.276)  | (422.830)                   | (50.175)                     | (231.472)                   | (46.735)                   | (122.351)                   | (632.611)                   |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 11.060                      | 3.960                       | 2.336.215  | 1.778.720  | 1.955.262                   | 87.414                       | 523.396                     | 377.069                    | 406.490                     | 1.278.367                   |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Next Generation Space Economy

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A (nicht<br>währungs-<br>gesichert)* | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR B (nicht<br>währungs-<br>gesichert) | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M (nicht<br>währungs-<br>gesichert) | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I |
|--|--|---|---|------------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |  |   |   |                                    |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |  |   |   |                                    |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | –  | 863.004   | 390.789   | –                                  | 300.000                           |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 921  | 929.950   | 1.305.171   | 1.000                              | 352.960                           |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –  | (184.351)   | (114.913)   | –                                  | (131.307)                         |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 921  | 1.608.603   | 1.581.047   | 1.000                              | 521.653                           |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |  |   |   |                                    |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |  |   |   |                                    |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | –  | 443.187   | 113.032   | –                                  | 300.000                           |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –  | 476.691   | 290.893   | –                                  | –                                 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –  | (56.874)  | (13.136)  | –                                  | –                                 |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | –  | 863.004   | 390.789   | –                                  | 300.000                           |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt

|  | Ausschüttende<br>Klasse<br>AUD A<br>(Monatlich) | Ausschüttende<br>Klasse<br>CAD A<br>(Monatlich) | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF A | Ausschüttende<br>Klasse<br>CHF A | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF I | Ausschüttende<br>Klasse<br>CHF I | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF I2 | Ausschüttende<br>Klasse<br>CHF I2 | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF I5 | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF P |
|--|---|---|-----------------------------------|----------------------------------|-----------------------------------|----------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |   |   |                                   |                                  |                                   |                                  |                                    |                                   |                                    |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |   |   |                                   |                                  |                                   |                                  |                                    |                                   |                                    |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 201.698   | 50.877  | 339.868                           | 83.280                           | 659.341                           | 106.300                          | 991.980                            | 8.106                             | 149.600                            | 3.028.912                         |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 37.334  | –   | 118.079                           | 6.200                            | 123.603                           | –                                | 4.682                              | –                                 | –                                  | 1.040.969                         |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (3.489)   | –   | (86.443)                          | (17.499)                         | (271.161)                         | (103.100)                        | (514.946)                          | –                                 | (95.400)                           | (305.547)                         |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 235.543   | 50.877  | 371.504                           | 71.981                           | 511.783                           | 3.200                            | 481.716                            | 8.106                             | 54.200                             | 3.764.334                         |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |   |   |                                   |                                  |                                   |                                  |                                    |                                   |                                    |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |   |   |                                   |                                  |                                   |                                  |                                    |                                   |                                    |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 329.980   | 532.977   | 485.575                           | 121.294                          | 1.310.726                         | 168.480                          | 1.996.523                          | 1.655.388                         | 151.200                            | 2.996.603                         |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 3.867   | 17.900  | 19.905                            | –                                | 258.897                           | 89.090                           | 51.607                             | –                                 | –                                  | 950.193                           |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (132.149)                                       | (500.000)                                       | (165.612)                         | (38.014)                         | (910.282)                         | (151.270)                        | (1.056.150)                        | (1.647.282)                       | (1.600)                            | (917.884)                         |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 201.698   | 50.877  | 339.868                           | 83.280                           | 659.341                           | 106.300                          | 991.980                            | 8.106                             | 149.600                            | 3.028.912                         |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR A | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I2 | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I2 | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I5 | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR M | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR P |
|--|-----------------------------------|----------------------------------|-----------------------------------|----------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|----------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                  |                                   |                                  |                                    |                                   |                                    |                                   |                                  |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                  |                                   |                                  |                                    |                                   |                                    |                                   |                                  |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 10.437.868                        | 2.133.087                        | 64.879.961                        | 21.471.116                       | 17.018.422                         | 6.729.285                         | 565.771                            | 252.097                           | 267.531                          | 5.116.815                         |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 1.292.992                         | 361.572                          | 38.622.783                        | 100.885                          | 5.592.671                          | –                                 | 226.628                            | 192.519                           | 404.765                          | 553.402                           |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (2.265.085)                       | (758.204)                        | (33.097.440)                      | (2.224.442)                      | (1.165.697)                        | (979.123)                         | (241.480)                          | (45.469)                          | (92.358)                         | (3.350.264)                       |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 9.465.775                         | 1.736.455                        | 70.405.304                        | 19.347.559                       | 21.445.396                         | 5.750.162                         | 550.919                            | 399.147                           | 579.938                          | 2.319.953                         |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                  |                                   |                                  |                                    |                                   |                                    |                                   |                                  |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                  |                                   |                                  |                                    |                                   |                                    |                                   |                                  |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 12.313.118                        | 2.355.226                        | 71.354.629                        | 23.218.416                       | 21.343.869                         | 7.801.041                         | 599.699                            | 289.438                           | 165.016                          | 11.340.764                        |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 1.286.977                         | 244.106                          | 38.828.846                        | 876.961                          | 5.674.820                          | 164                               | 147.062                            | 44.958                            | 118.153                          | 799.837                           |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (3.162.227)                       | (466.245)                        | (45.303.514)                      | (2.624.261)                      | (10.000.267)                       | (1.071.920)                       | (180.990)                          | (82.299)                          | (15.638)                         | (7.023.786)                       |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 10.437.868                        | 2.133.087                        | 64.879.961                        | 21.471.116                       | 17.018.422                         | 6.729.285                         | 565.771                            | 252.097                           | 267.531                          | 5.116.815                         |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR U | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR X* | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP A | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP I | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I2 | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP I2 | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP I5 | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP P | Thesaurierende<br>Klasse<br>JPY I |
|--|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|----------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                   |                                   |                                   |                                  |                                    |                                   |                                   |                                   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                   |                                   |                                   |                                  |                                    |                                   |                                   |                                   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 280.229                           | 5.600.000                         | 95.726                            | 214.622                           | 182.079                          | 42.503                             | 1.394.266                         | 18.170.557                        | 170.705                           | 75.491.886                        |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 145.417                           | –                                 | 63.500                            | 40.256                            | 26.296                           | –                                  | 4.698                             | 3.951.560                         | 359.694                           | 3.220.458                         |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (230.379)                         | (5.600.000)                       | (16.689)                          | (143.756)                         | (88.170)                         | (2.680)                            | (474.732)                         | (5.356.573)                       | (193.742)                         | (9.916.323)                       |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 195.267                           | –                                 | 142.537                           | 111.122                           | 120.205                          | 39.823                             | 924.232                           | 16.765.544                        | 336.657                           | 68.796.021                        |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                   |                                   |                                   |                                  |                                    |                                   |                                   |                                   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                   |                                   |                                   |                                  |                                    |                                   |                                   |                                   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 409.924                           | 5.600.000                         | 178.390                           | 456.013                           | 451.110                          | 195.144                            | 61.906.491                        | 17.028.791                        | 171.325                           | 88.355.473                        |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 259.021                           | –                                 | –                                 | 32.236                            | 107.971                          | 1.114                              | 3.844.487                         | 4.959.455                         | 131.835                           | 3.596.736                         |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (388.716)                         | –                                 | (82.664)                          | (273.627)                         | (377.002)                        | (153.755)                          | (64.356.712)                      | (3.817.689)                       | (132.455)                         | (16.460.323)                      |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 280.229                           | 5.600.000                         | 95.726                            | 214.622                           | 182.079                          | 42.503                             | 1.394.266                         | 18.170.557                        | 170.705                           | 75.491.886                        |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

|  | Ausschüttende Thesaurierende |                 | Ausschüttende                  |                                | Ausschüttende Thesaurierende |                 | Ausschüttende Thesaurierende |                  | Ausschüttende   |                 |
|--|------------------------------|-----------------|--------------------------------|--------------------------------|------------------------------|-----------------|------------------------------|------------------|-----------------|-----------------|
|  | Klasse<br>JPY I              | Klasse<br>SEK A | Klasse<br>SGD A<br>(Monatlich) | Klasse<br>USD A<br>(Monatlich) | Klasse<br>USD A              | Klasse<br>USD A | Klasse<br>USD C1             | Klasse<br>USD C1 | Klasse<br>USD I | Klasse<br>USD I |
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                              |                 |                                |                                |                              |                 |                              |                  |                 |                 |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                              |                 |                                |                                |                              |                 |                              |                  |                 |                 |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 5.479.712                    | 107.318         | 3.791.218                      | 3.416.665                      | 29.630.347                   | 10.620.540      | 3.170.869                    | 314.975          | 53.269.235      | 9.056.307       |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 2.030.149                    | 12.259          | 1.997.310                      | 2.513.553                      | 9.055.482                    | 985.802         | –                            | 1.364            | 9.786.217       | 2.108.298       |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (54.641)                     | (38.358)        | (1.293.278)                    | (1.840.725)                    | (8.312.249)                  | (3.771.590)     | (1.555.846)                  | (30.122)         | (9.680.964)     | (4.814.775)     |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 7.455.220                    | 81.219          | 4.495.250                      | 4.089.493                      | 30.373.580                   | 7.834.752       | 1.615.023                    | 286.217          | 53.374.488      | 6.349.830       |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                              |                 |                                |                                |                              |                 |                              |                  |                 |                 |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                              |                 |                                |                                |                              |                 |                              |                  |                 |                 |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 5.383.361                    | 166.970         | 2.577.819                      | 2.835.944                      | 36.560.035                   | 14.724.239      | 3.899.770                    | 458.405          | 62.869.655      | 9.453.599       |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 96.351                       | 5.464           | 1.872.412                      | 1.277.803                      | 3.706.919                    | 834.919         | 677                          | 1.532            | 5.314.847       | 1.798.419       |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –                            | (65.116)        | (659.013)                      | (697.082)                      | (10.636.607)                 | (4.938.618)     | (729.578)                    | (144.962)        | (14.915.267)    | (2.195.711)     |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 5.479.712                    | 107.318         | 3.791.218                      | 3.416.665                      | 29.630.347                   | 10.620.540      | 3.170.869                    | 314.975          | 53.269.235      | 9.056.307       |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I2 | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I2 | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I5 | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I5 | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD M | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD P | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z |
|--|------------------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                    |                                   |                                    |                                   |                                   |                                  |                                   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                    |                                   |                                    |                                   |                                   |                                  |                                   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 2.911.470                          | 1.327.444                         | 390.598                            | 1.759.460                         | 4.209.663                         | 1.041.363                        | 14.946.594                        | 1.859.929                         |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 406.643                            | 747.255                           | –                                  | 462.039                           | 1.489.358                         | 99.327                           | 1.911.543                         | 165.470                           |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (1.073.962)                        | (413.276)                         | (15.399)                           | (876.149)                         | (1.647.686)                       | (325.840)                        | (12.289.451)                      | (299.196)                         |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 2.244.151                          | 1.661.423                         | 375.199                            | 1.345.350                         | 4.051.335                         | 814.850                          | 4.568.686                         | 1.726.203                         |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                    |                                   |                                    |                                   |                                   |                                  |                                   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                    |                                   |                                    |                                   |                                   |                                  |                                   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 13.796.794                         | 10.271.003                        | 462.275                            | 2.565.820                         | 4.240.903                         | 1.222.416                        | 16.556.554                        | 1.153.935                         |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 1.114.455                          | 1.600.872                         | –                                  | 365.525                           | 820.671                           | 160.057                          | 3.883.877                         | 981.050                           |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (11.999.779)                       | (10.544.431)                      | (71.677)                           | (1.171.885)                       | (851.911)                         | (341.110)                        | (5.493.837)                       | (275.056)                         |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 2.911.470                          | 1.327.444                         | 390.598                            | 1.759.460                         | 4.209.663                         | 1.041.363                        | 14.946.594                        | 1.859.929                         |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Short Duration Euro Bond

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF P | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF U | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I2 | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I5 | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR U | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR Z |
|--|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                   |                                   |                                   |                                  |                                    |                                    |                                   |                                   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                   |                                   |                                   |                                  |                                    |                                    |                                   |                                   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 7.900                             | 55.713                            | 198.874                           | 5.787.503                         | 52.262                           | 804.923                            | 1.687.446                          | 89.915                            | 99.466                            | 19.030                            |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 1.400                             | 5.708                             | 1.426.580                         | 7.423.075                         | 32.896                           | –                                  | 376.428                            | 908.599                           | 275.697                           | 12.205                            |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (1.900)                           | (16.020)                          | (345.691)                         | (1.809.103)                       | (6.609)                          | –                                  | (206.742)                          | (131.754)                         | (67.226)                          | (14.945)                          |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 7.400                             | 45.401                            | 1.279.763                         | 11.401.475                        | 78.549                           | 804.923                            | 1.857.132                          | 866.760                           | 307.937                           | 16.290                            |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                   |                                   |                                   |                                  |                                    |                                    |                                   |                                   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                   |                                   |                                   |                                  |                                    |                                    |                                   |                                   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 7.900                             | 66.596                            | 53.957                            | 5.092.957                         | 15.867                           | 501.554                            | 1.640.462                          | 806                               | 40.833                            | 22.356                            |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                                 | 3.907                             | 186.949                           | 3.494.687                         | 83.255                           | 303.369                            | 279.617                            | 94.643                            | 64.043                            | 6.774                             |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –                                 | (14.790)                          | (42.032)                          | (2.800.141)                       | (46.860)                         | –                                  | (232.633)                          | (5.534)                           | (5.410)                           | (10.100)                          |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 7.900                             | 55.713                            | 198.874                           | 5.787.503                         | 52.262                           | 804.923                            | 1.687.446                          | 89.915                            | 99.466                            | 19.030                            |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Short Duration Euro Bond (Fortsetzung)

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z |
|--|-----------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 20.284                            | 575.000                           |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 15.238                            | 495                               |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (18.622)                          | (575.000)                         |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 16.900                            | 495                               |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 24.446                            | 805.000                           |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 87.633                            | –                                 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (91.795)                          | (230.000)                         |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 20.284                            | 575.000                           |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Short Duration High Yield Engagement

|  | Ausschüttende                  |                                   |                                   | Ausschüttende                  |                                   |                 | Ausschüttende   |                  |                 |                 |
|--|--------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|--------------------------------|-----------------------------------|-----------------|-----------------|------------------|-----------------|-----------------|
|  | Klasse<br>AUD A<br>(Monatlich) | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF A | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF I | Klasse<br>CNY A<br>(Monatlich) | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A | Klasse<br>EUR A | Klasse<br>EUR I | Klasse<br>EUR I2 | Klasse<br>EUR M | Klasse<br>EUR M |
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                |                                   |                                   |                                |                                   |                 |                 |                  |                 |                 |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                |                                   |                                   |                                |                                   |                 |                 |                  |                 |                 |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 160.774                        | 39.210                            | 19.499                            | 24.415                         | 1.032.478                         | 278.422         | 3.887.034       | 3.521.165        | 91.765          | 88.606          |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 302.267                        | –                                 | –                                 | 851                            | 272.328                           | 198.406         | 1.905.410       | 117.588          | 28.515          | 5.950           |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (116.853)                      | –                                 | –                                 | (1.299)                        | (348.463)                         | (168.581)       | (4.496.357)     | (1.630.111)      | (12.256)        | (10.086)        |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 346.188                        | 39.210                            | 19.499                            | 23.967                         | 956.343                           | 308.247         | 1.296.087       | 2.008.642        | 108.024         | 84.470          |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                |                                   |                                   |                                |                                   |                 |                 |                  |                 |                 |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                |                                   |                                   |                                |                                   |                 |                 |                  |                 |                 |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 168.383                        | 73.530                            | 19.499                            | 24.316                         | 1.043.186                         | 372.075         | 3.313.293       | 518.941          | 92.174          | 92.293          |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 22.122                         | –                                 | –                                 | 1.199                          | 758.046                           | 763             | 1.472.839       | 3.074.524        | 9.174           | 8.912           |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (29.731)                       | (34.320)                          | –                                 | (1.100)                        | (768.754)                         | (94.416)        | (899.098)       | (72.300)         | (9.583)         | (12.599)        |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 160.774                        | 39.210                            | 19.499                            | 24.415                         | 1.032.478                         | 278.422         | 3.887.034       | 3.521.165        | 91.765          | 88.606          |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Short Duration High Yield Engagement (Fortsetzung)

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP I | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I2 | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP I2 | Ausschüttende<br>Klasse<br>HKD A<br>(Monatlich) | Thesaurierende<br>Klasse<br>JPY I | Ausschüttende<br>Klasse<br>JPY I* | Ausschüttende<br>Klasse<br>SGD A<br>(Monatlich) | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD A<br>(Monatlich) | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A |
|--|-----------------------------------|----------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|---|-----------------------------------|-----------------------------------|---|---|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                  |                                    |                                   |   |                                   |                                   |   |   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                  |                                    |                                   |   |                                   |                                   |   |   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 27.491                            | 7.165.473                        | 98.459                             | 119.900                           | 153.565   | 13.585.765                        | 1.500.000                         | 242.031   | 525.940   | 2.375.815                         |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 8.955                             | 2.105.091                        | 6                                  | –                                 | –   | 1.909.336                         | –                                 | 163.146   | 1.056.080                                       | 504.470                           |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (22.608)                          | (2.027.481)                      | (147)                              | (27.598)                          | (70.797)  | (1.744.286)                       | (1.500.000)                       | (50.137)  | (153.211)                                       | (284.317)                         |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 13.838                            | 7.243.083                        | 98.318                             | 92.302                            | 82.768  | 13.750.815                        | –                                 | 355.040   | 1.428.809                                       | 2.595.968                         |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                  |                                    |                                   |   |                                   |                                   |   |   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                  |                                    |                                   |   |                                   |                                   |   |   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 1.184.596                         | 319.083                          | 99.495                             | 188.675                           | 237.545   | 14.584.769                        | 1.500.000                         | 146.696   | 409.578   | 2.686.234                         |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 9.792                             | 7.142.435                        | 5                                  | –                                 | 41.393  | 1.214.913                         | –                                 | 122.573   | 146.935   | 498.102                           |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (1.166.897)                       | (296.045)                        | (1.041)                            | (68.775)                          | (125.373)                                       | (2.213.917)                       | –                                 | (27.238)  | (30.573)  | (808.521)                         |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 27.491                            | 7.165.473                        | 98.459                             | 119.900                           | 153.565   | 13.585.765                        | 1.500.000                         | 242.031   | 525.940   | 2.375.815                         |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Short Duration High Yield Engagement (Fortsetzung)

|  | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD A | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD C1 | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I2 | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I2 | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I4* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I5 | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD M |
|--|----------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|----------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                  |                                    |                                   |                                  |                                    |                                   |                                     |                                    |                                   |                                  |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                  |                                    |                                   |                                  |                                    |                                   |                                     |                                    |                                   |                                  |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 1.013.765                        | 255.045                            | 8.485.236                         | 22.682.092                       | 105.587                            | 35.107                            | 281.000                             | 2.514.199                          | 272.882                           | 193.342                          |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 64.731                           | –                                  | 4.144.625                         | 2.480.784                        | –                                  | –                                 | –                                   | –                                  | 40.099                            | 25.371                           |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (143.771)                        | (42.703)                           | (4.900.285)                       | (16.860.053)                     | (8.988)                            | (207)                             | (280.000)                           | (528.635)                          | (91.921)                          | (104.046)                        |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 934.725                          | 212.342                            | 7.729.576                         | 8.302.823                        | 96.599                             | 34.900                            | 1.000                               | 1.985.564                          | 221.060                           | 114.667                          |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                  |                                    |                                   |                                  |                                    |                                   |                                     |                                    |                                   |                                  |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                  |                                    |                                   |                                  |                                    |                                   |                                     |                                    |                                   |                                  |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 1.203.389                        | 385.271                            | 8.546.826                         | 317.102                          | 7.171.291                          | 237.376                           | –                                   | 2.514.199                          | 796.656                           | 445.414                          |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 34.856                           | –                                  | 8.965.863                         | 22.417.004                       | –                                  | 16.589                            | 281.000                             | –                                  | 204.183                           | 283.518                          |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (224.480)                        | (130.226)                          | (9.027.453)                       | (52.014)                         | (7.065.704)                        | (218.858)                         | –                                   | –                                  | (727.957)                         | (535.590)                        |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 1.013.765                        | 255.045                            | 8.485.236                         | 22.682.092                       | 105.587                            | 35.107                            | 281.000                             | 2.514.199                          | 272.882                           | 193.342                          |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Short Duration High Yield Engagement (Fortsetzung)

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z |
|--|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 406.193                           |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 143.277                           |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (104.363)                         |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 445.107                           |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 776.456                           |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 74.483                            |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (444.746)                         |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 406.193                           |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Strategic Income

|  | Ausschüttende<br>Klasse<br>AUD A<br>(Monatlich) | Ausschüttende<br>Klasse<br>AUD E<br>(Monatlich)* | Ausschüttende<br>Klasse<br>AUD Z<br>(Monatlich) | Ausschüttende<br>Klasse<br>CNY A<br>(Monatlich)* | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR A<br>(Monatlich) | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP A<br>(Monatlich) | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP I<br>(Monatlich)* |
|--|---|--|---|--|---|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|---|--|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |   |  |   |  |   |                                   |                                   |                                   |   |  |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |   |  |   |  |   |                                   |                                   |                                   |   |  |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 9.710.637                                       | –  | 15.558.836                                      | 1.228.735  | 5.158.901                                       | 36.602                            | 743.690                           | 104.343                           | 3.378.612                                       | 649.150  |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 29.062.279                                      | 3.312.171  | 4.979.435                                       | 10.793.296                                       | 6.371.917                                       | 99.031                            | 89.395                            | 44.266                            | 7.905.785                                       | 194.552  |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (14.713.012)                                    | (388.422)  | (356.190)                                       | (3.576.993)                                      | (2.919.315)                                     | (941)                             | (268.528)                         | (24.283)                          | (3.997.281)                                     | –  |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 24.059.904                                      | 2.923.749  | 20.182.081                                      | 8.445.038  | 8.611.503                                       | 134.692                           | 564.557                           | 124.326                           | 7.287.116                                       | 843.702  |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |   |  |   |  |   |                                   |                                   |                                   |   |  |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |   |  |   |  |   |                                   |                                   |                                   |   |  |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 471.279   | –  | 8.514.232                                       | –  | 870.921   | 5.400                             | 655.596                           | 135.233                           | 225.209   | –  |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 11.281.729                                      | –  | 7.692.003                                       | 1.281.499  | 5.631.637                                       | 32.038                            | 447.649                           | 29.935                            | 4.396.759                                       | 649.150  |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (2.042.371)                                     | –  | (647.399)                                       | (52.764)   | (1.343.657)                                     | (836)                             | (359.555)                         | (60.825)                          | (1.243.356)                                     | –  |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 9.710.637                                       | –  | 15.558.836                                      | 1.228.735  | 5.158.901                                       | 36.602                            | 743.690                           | 104.343                           | 3.378.612                                       | 649.150  |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Strategic Income (Fortsetzung)

|  | Ausschüttende<br>Klasse<br>HKD A<br>(Monatlich) | Ausschüttende<br>Klasse<br>JPY A<br>(Monatlich)* | Ausschüttende<br>Klasse<br>JPY A<br>(Monatlich)<br>(nicht<br>währungs-<br>gesichert)* | Ausschüttende<br>Klasse<br>JPY E<br>(Monatlich)<br>(nicht<br>währungs-<br>gesichert)* | Thesaurierende<br>Klasse<br>JPY I | Thesaurierende<br>Klasse<br>JPY I (nicht<br>währungs-<br>gesichert) | Ausschüttende<br>Klasse<br>JPY I CG | Ausschüttende<br>Klasse<br>JPY I | Thesaurierende<br>Klasse<br>JPY Z | Ausschüttende<br>Klasse<br>SGD A<br>(Monatlich) |
|--|---|--|---|---|-----------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|-----------------------------------|---|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |   |  |   |   |                                   |   |                                     |                                  |                                   |   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |   |  |   |   |                                   |   |                                     |                                  |                                   |   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 113.862.565                                     | –  | –   | –   | 10.552.725                        | 2.345.665   | 1.169.889                           | 5.300                            | 5.959.065                         | 3.669.361                                       |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 429.200.874                                     | 20.876.589                                       | 4.375   | 1.467   | 884.205                           | –   | –                                   | –                                | –                                 | 29.139.040                                      |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (204.342.664)                                   | (2.784.736)                                      | –   | –   | (920.133)                         | (2.557)   | (1.411)                             | –                                | –                                 | (2.288.012)                                     |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 338.720.775                                     | 18.091.853                                       | 4.375   | 1.467   | 10.516.797                        | 2.343.108   | 1.168.478                           | 5.300                            | 5.959.065                         | 30.520.389                                      |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |   |  |   |   |                                   |   |                                     |                                  |                                   |   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |   |  |   |   |                                   |   |                                     |                                  |                                   |   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 1.370.873                                       | –  | –   | –   | 11.761.499                        | 2.348.460   | 6.742.455                           | 9.131.838                        | 10.979.747                        | 1.418.467                                       |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 136.313.875                                     | –  | –   | –   | 653.954                           | –   | –                                   | 5.300                            | –                                 | 3.002.669                                       |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (23.822.183)                                    | –  | –   | –   | (1.862.728)                       | (2.795)   | (5.572.566)                         | (9.131.838)                      | (5.020.682)                       | (751.775)                                       |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 113.862.565                                     | –  | –   | –   | 10.552.725                        | 2.345.665   | 1.169.889                           | 5.300                            | 5.959.065                         | 3.669.361                                       |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Strategic Income (Fortsetzung)

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>SGD A | Ausschüttende<br>Klasse<br>SGD I<br>(Monatlich) | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD A<br>(Monatlich) | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD A | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD C1 | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD E<br>(Monatlich)* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I4<br>(Monatlich)* |
|--|-----------------------------------|---|---|-----------------------------------|----------------------------------|------------------------------------|--|-----------------------------------|----------------------------------|---|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |   |   |                                   |                                  |                                    |  |                                   |                                  |   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |   |   |                                   |                                  |                                    |  |                                   |                                  |   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 637.357                           | 760.359   | 31.390.943                                      | 39.344.692                        | 2.405.383                        | 3.552.363                          | –  | 27.778.385                        | 6.668.736                        | –   |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 1.338.121                         | 1.031.241                                       | 108.969.296                                     | 28.883.613                        | 916.389                          | –                                  | 27.573.591                                       | 22.486.812                        | 11.610.715                       | 36.581.626  |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (697.614)                         | (946.101)                                       | (41.454.336)                                    | (7.151.635)                       | (688.498)                        | (846.991)                          | (2.993.344)                                      | (13.691.941)                      | (2.590.643)                      | (710.685)   |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 1.277.864                         | 845.499   | 98.905.903                                      | 61.076.670                        | 2.633.274                        | 2.705.372                          | 24.580.247                                       | 36.573.256                        | 15.688.808                       | 35.870.941  |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |   |   |                                   |                                  |                                    |  |                                   |                                  |   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |   |   |                                   |                                  |                                    |  |                                   |                                  |   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 216.898                           | 648.072   | 4.909.524                                       | 26.750.249                        | 1.624.416                        | 4.399.957                          | –  | 30.162.828                        | 2.693.726                        | –   |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 525.874                           | 232.717   | 32.570.536                                      | 17.296.531                        | 1.068.937                        | –                                  | –  | 9.491.191                         | 5.940.870                        | –   |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (105.415)                         | (120.430)                                       | (6.089.117)                                     | (4.702.088)                       | (287.970)                        | (847.594)                          | –  | (11.875.634)                      | (1.965.860)                      | –   |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 637.357                           | 760.359   | 31.390.943                                      | 39.344.692                        | 2.405.383                        | 3.552.363                          | –  | 27.778.385                        | 6.668.736                        | –   |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Strategic Income (Fortsetzung)

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD M | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z | Ausschüttende<br>Klasse<br>ZAR A<br>(Monatlich)* | Ausschüttende<br>Klasse<br>ZAR E<br>(Monatlich)* |
|--|-----------------------------------|----------------------------------|-----------------------------------|--|--|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                  |                                   |  |  |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                  |                                   |  |  |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 9.106.715                         | 1.246.614                        | 3.446.547                         | –  | –  |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 4.850.184                         | 664.447                          | 200.350                           | 335.743  | 4.607.600  |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (2.090.767)                       | (293.522)                        | (544.157)                         | (156.558)  | (1.920.817)                                      |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 11.866.132                        | 1.617.539                        | 3.102.740                         | 179.185  | 2.686.783  |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                  |                                   |  |  |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                  |                                   |  |  |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 6.188.277                         | 994.062                          | 3.459.057                         | –  | –  |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 4.271.764                         | 461.089                          | 140.478                           | –  | –  |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (1.353.326)                       | (208.537)                        | (152.988)                         | –  | –  |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 9.106.715                         | 1.246.614                        | 3.446.547                         | –  | –  |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Sustainable Asia High Yield

|  | Thesaurierende   |                  | Ausschüttende                  |                 | Thesaurierende  |                 | Ausschüttende   |  |
|--|------------------|------------------|--------------------------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|--|
|  | Klasse<br>EUR X* | Klasse<br>GBP X* | Klasse<br>USD A<br>(Monatlich) | Klasse<br>USD A | Klasse<br>USD I | Klasse<br>USD Z | Klasse<br>USD Z |  |
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                  |                  |                                |                 |                 |                 |                 |  |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                  |                  |                                |                 |                 |                 |                 |  |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 42.700           | 3.996            | 2.693                          | 1.000           | 1.225           | 2.406.657       | 721.340         |  |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                | –                | 2.484                          | 1.000           | –               | 2.395.262       | –               |  |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (42.700)         | (3.996)          | (3.462)                        | (1.000)         | –               | (2.399.466)     | –               |  |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | –                | –                | 1.715                          | 1.000           | 1.225           | 2.402.453       | 721.340         |  |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                  |                  |                                |                 |                 |                 |                 |  |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                  |                  |                                |                 |                 |                 |                 |  |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 429.777          | 22.390           | 1.000                          | 1.000           | 1.225           | 2.408.657       | 721.340         |  |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                | –                | 3.032                          | –               | –               | –               | –               |  |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (387.077)        | (18.394)         | (1.339)                        | –               | –               | (2.000)         | –               |  |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 42.700           | 3.996            | 2.693                          | 1.000           | 1.225           | 2.406.657       | 721.340         |  |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I3 | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I4* | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I5* | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR X | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I5 |
|--|------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                    |                                     |                                     |                                   |                                   |                                    |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                    |                                     |                                     |                                   |                                   |                                    |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 782.526                            | 23.326.137                          | –                                   | 8.388.644                         | 1.000                             | 7.267.654                          |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 21.717                             | 5.726.707                           | –                                   | 8.499.411                         | 8.050                             | 1.381.941                          |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (315.344)                          | (414.253)                           | –                                   | (2.499.173)                       | –                                 | –                                  |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 488.899                            | 28.638.591                          | –                                   | 14.388.882                        | 9.050                             | 8.649.595                          |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                    |                                     |                                     |                                   |                                   |                                    |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                    |                                     |                                     |                                   |                                   |                                    |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 2.156.822                          | –                                   | 249.922                             | 7.706.142                         | 1.000                             | 7.267.654                          |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 834.545                            | 25.687.200                          | –                                   | 5.776.200                         | –                                 | –                                  |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (2.208.841)                        | (2.361.063)                         | (249.922)                           | (5.093.698)                       | –                                 | –                                  |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 782.526                            | 23.326.137                          | –                                   | 8.388.644                         | 1.000                             | 7.267.654                          |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Tactical Macro<sup>1</sup>

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I5* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I5* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z* |
|--|-------------------------------------|------------------------------------|-------------------------------------|------------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                     |                                    |                                     |                                    |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                     |                                    |                                     |                                    |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | –                                   | 1.000                              | 32.912                              | 2.605.310                          |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 311.074                             | –                                  | 87.858                              | 349.133                            |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (13.504)                            | –                                  | (33.239)                            | –                                  |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 297.570                             | 1.000                              | 87.531                              | 2.954.443                          |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                     |                                    |                                     |                                    |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                     |                                    |                                     |                                    |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | –                                   | –                                  | –                                   | –                                  |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                                   | 1.000                              | 32.912                              | 2.605.310                          |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –                                   | –                                  | –                                   | –                                  |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | –                                   | 1.000                              | 32.912                              | 2.605.310                          |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Uncorrelated Strategies

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF I | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF I5* | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I2 | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I5* | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR P | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I2 |
|--|-----------------------------------|-------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                     |                                   |                                   |                                    |                                     |                                   |                                   |                                   |                                    |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                     |                                   |                                   |                                    |                                     |                                   |                                   |                                   |                                    |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 213.116                           | –                                   | 681.470                           | 1.002.598                         | 739.326                            | –                                   | 76.048                            | 22.968                            | 1.270.457                         | 55.994.200                         |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 243                               | –                                   | 17.474                            | 17.687                            | 3.904                              | –                                   | 669                               | –                                 | 928.702                           | 7.811.320                          |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (147.883)                         | –                                   | (482.067)                         | (465.423)                         | (367.612)                          | –                                   | (35.597)                          | (20.037)                          | (1.734.959)                       | (34.877.192)                       |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 65.476                            | –                                   | 216.877                           | 554.862                           | 375.618                            | –                                   | 41.120                            | 2.931                             | 464.200                           | 28.928.328                         |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                     |                                   |                                   |                                    |                                     |                                   |                                   |                                   |                                    |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                     |                                   |                                   |                                    |                                     |                                   |                                   |                                   |                                    |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 331.704                           | 139.713                             | 3.198.588                         | 14.958.535                        | 1.401.062                          | 614.817                             | 168.291                           | 2.888.663                         | 6.717.230                         | 75.869.469                         |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 151.053                           | 37.452                              | 259.067                           | 2.480.933                         | 25.140                             | 16.894                              | –                                 | 147.958                           | 1.476.635                         | 26.752.166                         |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (269.641)                         | (177.165)                           | (2.776.185)                       | (16.436.870)                      | (686.876)                          | (631.711)                           | (92.243)                          | (3.013.653)                       | (6.923.408)                       | (46.627.435)                       |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 213.116                           | –                                   | 681.470                           | 1.002.598                         | 739.326                            | –                                   | 76.048                            | 22.968                            | 1.270.457                         | 55.994.200                         |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

|  | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP I2 | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I5 | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP P | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP Z | Thesaurierende<br>Klasse<br>JPY I | Thesaurierende<br>Klasse<br>SGD A | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD C1 | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I2 |
|--|-----------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                    |                                   |                                   |                                   |                                   |                                   |                                    |                                   |                                    |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                    |                                   |                                   |                                   |                                   |                                   |                                    |                                   |                                    |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 28.937                            | 3.163.884                          | 34.417.049                        | 41.713                            | 4.200.973                         | 457                               | 3.626.090                         | 414.274                            | 17.554.824                        | 4.223.339                          |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 6.482                             | 312.560                            | 4.687.918                         | –                                 | –                                 | 315.874                           | 100.788                           | –                                  | 353.028                           | 4.230                              |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (34.561)                          | (3.438.251)                        | (29.131.087)                      | (9.702)                           | (10.529)                          | (313.986)                         | (1.903.937)                       | (277.588)                          | (4.301.288)                       | (2.276.681)                        |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 858                               | 38.193                             | 9.973.880                         | 32.011                            | 4.190.444                         | 2.345                             | 1.822.941                         | 136.686                            | 13.606.564                        | 1.950.888                          |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                    |                                   |                                   |                                   |                                   |                                   |                                    |                                   |                                    |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                    |                                   |                                   |                                   |                                   |                                   |                                    |                                   |                                    |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 7.635                             | 20.811.248                         | 65.755.680                        | 41.713                            | 4.210.727                         | 10.011                            | 6.893.263                         | 664.412                            | 21.190.138                        | 4.960.786                          |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 28.547                            | 1.274.912                          | 18.481.299                        | –                                 | –                                 | 814.157                           | 663.357                           | –                                  | 17.697.579                        | 502.688                            |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (7.245)                           | (18.922.276)                       | (49.819.930)                      | –                                 | (9.754)                           | (823.711)                         | (3.930.530)                       | (250.138)                          | (21.332.893)                      | (1.240.135)                        |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 28.937                            | 3.163.884                          | 34.417.049                        | 41.713                            | 4.200.973                         | 457                               | 3.626.090                         | 414.274                            | 17.554.824                        | 4.223.339                          |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I5 | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD P | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z |
|--|------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                    |                                   |                                   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                    |                                   |                                   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 977.651                            | 529.868                           | 637.127                           | 958.190                           |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 268.071                            | 50.204                            | 1.245                             | –                                 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –                                  | (270.099)                         | (633.479)                         | (937.710)                         |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 1.245.722                          | 309.973                           | 4.893                             | 20.480                            |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                    |                                   |                                   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                    |                                   |                                   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 1.920.389                          | 1.297.914                         | 4.656.985                         | 2.256.709                         |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 183.568                            | 92.708                            | 214.528                           | 8.919                             |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (1.126.306)                        | (860.754)                         | (4.234.386)                       | (1.307.438)                       |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 977.651                            | 529.868                           | 637.127                           | 958.190                           |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## Uncorrelated Trading\*\*

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR X* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD X* |
|--|------------------------------------|------------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                    |                                    |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                    |                                    |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | –                                  | –                                  |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                                  | –                                  |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –                                  | –                                  |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | –                                  | –                                  |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                    |                                    |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                    |                                    |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 66.029.923                         | 1.818.579                          |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 644.896                            | 471.245                            |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (66.674.819)                       | (2.289.824)                        |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | –                                  | –                                  |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

\*\* Das Portfolio wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Equity

|  | Thesaurierende Klasse<br>EUR I (nicht währungs-<br>gesichert)* | Thesaurierende Klasse<br>EUR 15* | Thesaurierende Klasse<br>EUR 15 (nicht währungs-<br>gesichert)* | Ausschüttende Klasse<br>EUR 15 (nicht währungs-<br>gesichert)* | Thesaurierende Klasse<br>EUR X (nicht währungs-<br>gesichert)* | Ausschüttende Klasse<br>GBP 15 (nicht währungs-<br>gesichert)* | Thesaurierende Klasse<br>GBP X (nicht währungs-<br>gesichert)* | Thesaurierende Klasse<br>JPY I3 | Thesaurierende Klasse<br>USD A | Thesaurierende Klasse<br>USD I |
|--|--|----------------------------------|---|--|--|--|--|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |  |                                  |   |  |  |  |  |                                 |                                |                                |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |  |                                  |   |  |  |  |  |                                 |                                |                                |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | –  | –                                | –   | –  | –  | –  | –  | 3.822.231                       | 200.642                        | 167.004                        |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 917  | 921.966                          | 933   | 933  | 21.170   | 788  | 152.121  | 316.364                         | 1.015.720                      | 658.501                        |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –  | –                                | –   | –  | –  | –  | –  | (3.819.278)                     | (122.272)                      | (475.276)                      |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 917  | 921.966                          | 933   | 933  | 21.170   | 788  | 152.121  | 319.317                         | 1.094.090                      | 350.229                        |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |  |                                  |   |  |  |  |  |                                 |                                |                                |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |  |                                  |   |  |  |  |  |                                 |                                |                                |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | –  | –                                | –   | –  | –  | –  | –  | 3.336.540                       | 227.315                        | 150.640                        |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –  | –                                | –   | –  | –  | –  | –  | 495.845                         | 35.050                         | 33.651                         |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –  | –                                | –   | –  | –  | –  | –  | (10.154)                        | (61.723)                       | (17.287)                       |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | –  | –                                | –   | –  | –  | –  | –  | 3.822.231                       | 200.642                        | 167.004                        |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## US Equity (Fortsetzung)

|  | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I5* | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I5* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD X* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z* |
|--|----------------------------------|-------------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                  |                                     |                                    |                                   |                                    |                                    |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                  |                                     |                                    |                                   |                                    |                                    |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 229.104                          | –                                   | –                                  | 554.217                           | –                                  | –                                  |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                                | 3.269.401                           | 3.000                              | 627.679                           | 1.000                              | 390.000                            |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –                                | (143.988)                           | –                                  | (620.338)                         | –                                  | (35.305)                           |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 229.104                          | 3.125.413                           | 3.000                              | 561.558                           | 1.000                              | 354.695                            |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                  |                                     |                                    |                                   |                                    |                                    |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                  |                                     |                                    |                                   |                                    |                                    |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 229.104                          | –                                   | –                                  | 1.000                             | –                                  | –                                  |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                                | –                                   | –                                  | 562.322                           | –                                  | –                                  |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –                                | –                                   | –                                  | (9.105)                           | –                                  | –                                  |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 229.104                          | –                                   | –                                  | 554.217                           | –                                  | –                                  |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Equity Premium

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I3 | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I4 | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I4* | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I (nicht<br>währungs-<br>gesichert) | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I3 | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP I3 | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP I3 (nicht<br>währungs-<br>gesichert)* | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I4 (nicht<br>währungs-<br>gesichert) |
|--|-----------------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|---|------------------------------------|-----------------------------------|--|--|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                   |                                    |                                    |                                   |   |                                    |                                   |  |  |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                   |                                    |                                    |                                   |   |                                    |                                   |  |  |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 306.435                           | 504.081                           | 44.279                             | 2.748                              | 25.684                            | 1.060.132   | 8.928.700                          | 22.590.898                        | 785  | 3.671.571  |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 80.181                            | 118.726                           | –                                  | –                                  | 3.833                             | 69.288  | 2.912.478                          | 3.115.008                         | –  | 700.064  |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (106.608)                         | (303.112)                         | (2.940)                            | –                                  | (13.176)                          | (1.011.149)   | (5.241.781)                        | (14.996.522)                      | –  | (4.321.293)  |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 280.008                           | 319.695                           | 41.339                             | 2.748                              | 16.341                            | 118.271   | 6.599.397                          | 10.709.384                        | 785  | 50.342   |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                   |                                    |                                    |                                   |   |                                    |                                   |  |  |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                   |                                    |                                    |                                   |   |                                    |                                   |  |  |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 44.461                            | 549.260                           | 66.048                             | –                                  | 27.502                            | 2.427.688   | 6.272.119                          | 21.276.762                        | –  | 9.386.183  |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 315.495                           | 78.615                            | 240                                | 2.748                              | 86                                | 217.259   | 5.145.591                          | 4.786.168                         | 785  | 18.942   |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (53.521)                          | (123.794)                         | (22.009)                           | –                                  | (1.904)                           | (1.584.815)   | (2.489.010)                        | (3.472.032)                       | –  | (5.733.554)  |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 306.435                           | 504.081                           | 44.279                             | 2.748                              | 25.684                            | 1.060.132   | 8.928.700                          | 22.590.898                        | 785  | 3.671.571  |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## US Equity Premium (Fortsetzung)

|  | Ausschüttende Thesaurierende       |   |  | Ausschüttende<br>Klasse<br>SGD A<br>(Monatlich) | Ausschüttende Thesaurierende   |                 |           | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I3<br>(Monatlich) | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I4 | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M |
|--|------------------------------------|---|--|---|--------------------------------|-----------------|-----------|--|------------------------------------|-----------------------------------|
|  | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP I4* | GBP P (nicht<br>währungs-<br>gesichert) | Klasse<br>GBP X (nicht<br>währungs-<br>gesichert)* |   | Klasse<br>USD I<br>(Monatlich) | Klasse<br>USD I |           |  |                                    |                                   |
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                    |   |  |   |                                |                 |           |  |                                    |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                    |   |  |   |                                |                 |           |  |                                    |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 43.332                             | 376.204                                 | –  | 9.641   | 891.514                        | 892             | 4.378.184 | 2.294.652  | 377.765                            | 87.640                            |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                                  | 178.772                                 | 13.354.622   | 387.280   | 750.316                        | 3.448           | 2.971.691 | 276.260  | 69.130                             | 200.070                           |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (35.657)                           | (312.398)                               | (3.975.135)  | (32.730)  | (347.245)                      | –               | (416.462) | (1.156.698)                                      | (50.775)                           | (45.742)                          |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 7.675                              | 242.578                                 | 9.379.487  | 364.191   | 1.294.585                      | 4.340           | 6.933.413 | 1.414.214  | 396.120                            | 241.968                           |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                    |   |  |   |                                |                 |           |  |                                    |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                    |   |  |   |                                |                 |           |  |                                    |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | –                                  | 458.474                                 | –  | 9.705   | 950.719                        | 1.097.810       | 4.024.747 | 2.042.656  | 385.879                            | 98.157                            |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 43.332                             | 91.944                                  | –  | 4.841   | 415.505                        | 2.043.767       | 898.789   | 522.685  | 118.043                            | 24.441                            |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –                                  | (174.214)                               | –  | (4.905)   | (474.710)                      | (3.140.685)     | (545.352) | (270.689)  | (126.157)                          | (34.958)                          |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 43.332                             | 376.204                                 | –  | 9.641   | 891.514                        | 892             | 4.378.184 | 2.294.652  | 377.765                            | 87.640                            |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Equity Premium (Fortsetzung)

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z |
|--|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 3.285.506                         |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 463.009                           |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (831.517)                         |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 2.916.998                         |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 2.712.179                         |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 1.093.031                         |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (519.704)                         |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 3.285.506                         |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## US Large Cap Value

|  | Thesaurierende Klasse EUR A | Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungs-gesichert) | Thesaurierende Klasse EUR I | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungs-gesichert) | Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungs-gesichert) | Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungs-gesichert) | Thesaurierende Klasse GBP I | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungs-gesichert) | Ausschüttende Klasse GBP I | Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungs-gesichert) |
|--|-----------------------------|--|-----------------------------|--|--|---|-----------------------------|--|----------------------------|---|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                             |  |                             |  |  |   |                             |  |                            |   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                             |  |                             |  |  |   |                             |  |                            |   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 56.980                      | 23.502   | 2.926.961                   | 16.583.553   | 1.259.190  | 10.581.451  | 2.528                       | 52.144   | 31.818                     | 616.053   |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 5.371                       | 11.243   | 949.450                     | 11.281.473   | 21.303   | –   | –                           | 3.103  | 10.630                     | 20.300  |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (6.349)                     | (14.991)   | (2.326.571)                 | (4.799.682)  | (1.255.714)  | (1.187.571)   | –                           | (34.905)   | (9.700)                    | (592.500)   |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 56.002                      | 19.754   | 1.549.840                   | 23.065.344   | 24.779   | 9.393.880   | 2.528                       | 20.342   | 32.748                     | 43.853  |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                             |  |                             |  |  |   |                             |  |                            |   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                             |  |                             |  |  |   |                             |  |                            |   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 13.958                      | 39.526   | 1.468.204                   | 3.967.984  | 1.436.743  | 11.258.613  | 2.528                       | 843  | 2.528                      | 843   |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 65.490                      | 28.220   | 2.417.441                   | 18.901.030   | 159.284  | 45.314  | –                           | 54.613   | 29.700                     | 657.290   |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (22.468)                    | (44.244)   | (958.684)                   | (6.285.461)  | (336.837)  | (722.476)   | –                           | (3.312)  | (410)                      | (42.080)  |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 56.980                      | 23.502   | 2.926.961                   | 16.583.553   | 1.259.190  | 10.581.451  | 2.528                       | 52.144   | 31.818                     | 616.053   |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Large Cap Value (Fortsetzung)

|  | Ausschüttende Klasse<br>GBP I4 (nicht<br>währungs-<br>gesichert) | Thesaurierende Klasse<br>GBP P (nicht<br>währungs-<br>gesichert) | Ausschüttende Klasse<br>GBP P | Thesaurierende Klasse<br>GBP Y (nicht<br>währungs-<br>gesichert) | Ausschüttende Klasse<br>GBP Y (nicht<br>währungs-<br>gesichert) | Thesaurierende Klasse<br>USD A | Thesaurierende Klasse<br>USD I | Ausschüttende Klasse<br>USD I4 | Thesaurierende Klasse<br>USD I5 | Thesaurierende Klasse<br>USD M |
|--|--|--|-------------------------------|--|---|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |  |  |                               |  |   |                                |                                |                                |                                 |                                |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |  |  |                               |  |   |                                |                                |                                |                                 |                                |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 71.617.826   | 160.664  | 2.678                         | 10.065.302   | 30.726  | 6.989.356                      | 34.847.924                     | 4.528.562                      | 4.500                           | 2.408.016                      |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 2.217.635  | 198.426  | 2.950                         | 5.377.623  | 31.643  | 904.888                        | 7.064.947                      | 18.662                         | –                               | 302.718                        |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (69.788.448)   | (52.333)   | –                             | (3.605.188)  | (7.653)   | (2.465.147)                    | (21.672.659)                   | (4.259.568)                    | (1.520)                         | (886.752)                      |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 4.047.013  | 306.757  | 5.628                         | 11.837.737   | 54.716  | 5.429.097                      | 20.240.212                     | 287.656                        | 2.980                           | 1.823.982                      |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |  |  |                               |  |   |                                |                                |                                |                                 |                                |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |  |  |                               |  |   |                                |                                |                                |                                 |                                |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 70.274.876   | 101.890  | 2.678                         | 7.624.449  | 5.601   | 6.754.569                      | 35.996.493                     | 5.756.675                      | 5.300                           | 5.176.603                      |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 10.973.706   | 107.842  | –                             | 3.957.303  | 26.432  | 3.474.454                      | 23.051.960                     | 422.550                        | –                               | 1.232.124                      |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (9.630.756)  | (49.068)   | –                             | (1.516.450)  | (1.307)   | (3.239.667)                    | (24.200.529)                   | (1.650.663)                    | (800)                           | (4.000.711)                    |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 71.617.826   | 160.664  | 2.678                         | 10.065.302   | 30.726  | 6.989.356                      | 34.847.924                     | 4.528.562                      | 4.500                           | 2.408.016                      |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## US Large Cap Value (Fortsetzung)

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Y* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z |
|--|------------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                    |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                    |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 10.023.997                         | 20.291                            |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 1.656.876                          | –                                 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (884.450)                          | –                                 |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 10.796.423                         | 20.291                            |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                    |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                    |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | –                                  | 1.344.067                         |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 10.023.997                         | 19.275                            |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –                                  | (1.343.051)                       |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 10.023.997                         | 20.291                            |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Long Short Equity

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I3 | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I3 (nicht<br>währungs-<br>gesichert)* | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP I3 | Thesaurierende<br>Klasse<br>SGD A1 | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A (PF) | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A1 |
|--|-----------------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|---|-----------------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|--|-----------------------------------|------------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                   |                                    |   |                                   |                                   |                                    |  |                                   |                                    |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                   |                                    |   |                                   |                                   |                                    |  |                                   |                                    |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 22.759                            | 2.583.458                         | 3.013.538                          | –   | 246.755                           | 137.589                           | 6.537                              | 113.349                                | 1.179.982                         | 970.316                            |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 332                               | 329.198                           | 1.300.674                          | 933   | 9.022                             | 321.685                           | 1.517                              | 20.277                                 | 202.467                           | 34.138                             |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (89)                              | (740.753)                         | (519.361)                          | –   | (55.169)                          | (49.660)                          | (3.311)                            | (34.454)                               | (286.506)                         | (314.075)                          |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 23.002                            | 2.171.903                         | 3.794.851                          | 933   | 200.608                           | 409.614                           | 4.743                              | 99.172                                 | 1.095.943                         | 690.379                            |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                   |                                    |   |                                   |                                   |                                    |  |                                   |                                    |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                   |                                    |   |                                   |                                   |                                    |  |                                   |                                    |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 57.075                            | 3.268.450                         | 3.439.272                          | –   | 316.553                           | 54.852                            | 12.714                             | 233.693                                | 1.265.021                         | 1.094.746                          |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 137                               | 723.435                           | 424.140                            | –   | 786                               | 90.971                            | 1.527                              | 14.454                                 | 109.187                           | 89.727                             |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (34.453)                          | (1.408.427)                       | (849.874)                          | –   | (70.584)                          | (8.234)                           | (7.704)                            | (134.798)                              | (194.226)                         | (214.157)                          |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 22.759                            | 2.583.458                         | 3.013.538                          | –   | 246.755                           | 137.589                           | 6.537                              | 113.349                                | 1.179.982                         | 970.316                            |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## US Long Short Equity (Fortsetzung)

|  | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I (PF) | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I3 | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD U | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z |
|--|---------------------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                       |                                   |                                    |                                   |                                   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                       |                                   |                                    |                                   |                                   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 2.575.670                             | 2.068.775                         | 917.546                            | 77.743                            | 88.542                            | 201.038                           |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 522.044                               | 2.315.809                         | 978.324                            | 20.172                            | –                                 | 144.141                           |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (994.346)                             | (1.033.751)                       | (441.011)                          | (21.134)                          | (38.988)                          | (19.703)                          |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 2.103.368                             | 3.350.833                         | 1.454.859                          | 76.781                            | 49.554                            | 325.476                           |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                       |                                   |                                    |                                   |                                   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                       |                                   |                                    |                                   |                                   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 2.642.224                             | 3.674.697                         | 1.186.852                          | 111.946                           | 534.775                           | 267.357                           |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 807.930                               | 1.587.062                         | 202.787                            | 13.482                            | –                                 | –                                 |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (874.484)                             | (3.192.984)                       | (472.093)                          | (47.685)                          | (446.233)                         | (66.319)                          |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 2.575.670                             | 2.068.775                         | 917.546                            | 77.743                            | 88.542                            | 201.038                           |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Multi Cap Opportunities

|  | Thesaurierende Klasse<br>AUD E | Thesaurierende Klasse<br>AUD T | Thesaurierende Klasse<br>EUR I (nicht währungs-<br>gesichert)* | Thesaurierende Klasse<br>EUR I3 | Thesaurierende Klasse<br>EUR M | Thesaurierende Klasse<br>EUR1 A | Thesaurierende Klasse<br>EUR1 I | Ausschüttende Klasse<br>GBP I3* | Ausschüttende Klasse<br>GBP I3 (nicht währungs-<br>gesichert) | Thesaurierende Klasse<br>GBP P (nicht währungs-<br>gesichert)* |
|--|--------------------------------|--------------------------------|--|---------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|---|--|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                |                                |  |                                 |                                |                                 |                                 |                                 |   |  |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                |                                |  |                                 |                                |                                 |                                 |                                 |   |  |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 64.980                         | 121.388                        | –  | 84.141                          | 26.971                         | 71.862                          | 113.863                         | –                               | 1.065   | –  |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 80.066                         | 66.766                         | 724.636  | –                               | 2.480                          | 7.978                           | 2.128                           | 2.367                           | –   | 1.226  |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (111.944)                      | (101.427)                      | (713)  | –                               | (8.401)                        | (36.298)                        | (60.946)                        | –                               | –   | –  |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 33.102                         | 86.727                         | 723.923  | 84.141                          | 21.050                         | 43.542                          | 55.045                          | 2.367                           | 1.065   | 1.226  |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                |                                |  |                                 |                                |                                 |                                 |                                 |   |  |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                |                                |  |                                 |                                |                                 |                                 |                                 |   |  |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 93.786                         | 110.356                        | –  | 84.141                          | 30.996                         | 78.036                          | 125.756                         | –                               | 1.065   | –  |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 26.899                         | 41.328                         | –  | –                               | 1.733                          | 11.143                          | 57.842                          | –                               | –   | –  |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (55.705)                       | (30.296)                       | –  | –                               | (5.758)                        | (17.317)                        | (69.735)                        | –                               | –   | –  |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 64.980                         | 121.388                        | –  | 84.141                          | 26.971                         | 71.862                          | 113.863                         | –                               | 1.065   | –  |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>SGD A | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD B | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD C1 | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD C2* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD E | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I2* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I3 | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I3* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD T |
|--|-----------------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------|------------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                   |                                    |                                     |                                   |                                     |                                    |                                    |                                   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                   |                                    |                                     |                                   |                                     |                                    |                                    |                                   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 627.593                           | 553.855                           | 117.619                            | 535                                 | 641.964                           | 1.000                               | 662.524                            | 215.406                            | 362.374                           | 900.358                           |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 573.365                           | 874.180                           | –                                  | –                                   | 644.705                           | –                                   | 53.369                             | –                                  | 98.033                            | 818.080                           |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (257.925)                         | (1.124.170)                       | (19.939)                           | (535)                               | (1.058.620)                       | –                                   | (7.197)                            | (215.406)                          | (112.573)                         | (987.049)                         |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 943.033                           | 303.865                           | 97.680                             | –                                   | 228.049                           | 1.000                               | 708.696                            | –                                  | 347.834                           | 731.389                           |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                   |                                    |                                     |                                   |                                     |                                    |                                    |                                   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                   |                                    |                                     |                                   |                                     |                                    |                                    |                                   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 579.622                           | 807.081                           | 136.170                            | 43.555                              | 724.570                           | –                                   | 883.721                            | 215.406                            | 464.616                           | 950.340                           |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 685.550                           | 717.450                           | –                                  | 612                                 | 295.828                           | 1.000                               | 3.330                              | –                                  | 116.205                           | 557.491                           |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (637.579)                         | (970.676)                         | (18.551)                           | (43.632)                            | (378.434)                         | –                                   | (224.527)                          | –                                  | (218.447)                         | (607.473)                         |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 627.593                           | 553.855                           | 117.619                            | 535                                 | 641.964                           | 1.000                               | 662.524                            | 215.406                            | 362.374                           | 900.358                           |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD U | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD1 A | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD1 I | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD1 I | Thesaurierende<br>Klasse<br>ZAR B | Thesaurierende<br>Klasse<br>ZAR C2* | Thesaurierende<br>Klasse<br>ZAR E | Thesaurierende<br>Klasse<br>ZAR T |
|--|-----------------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                   |                                    |                                    |                                   |                                   |                                     |                                   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                   |                                    |                                    |                                   |                                   |                                     |                                   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 1.636.608                         | 12.011                            | 1.791.035                          | 4.088.916                          | 174.205                           | 110.674                           | 173                                 | 143.480                           | 180.116                           |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 114.811                           | –                                 | 470.297                            | 556.592                            | 7.212                             | 175.085                           | 10                                  | 551.044                           | 140.134                           |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (274.676)                         | (530)                             | (485.496)                          | (2.165.491)                        | (16.008)                          | (225.138)                         | (183)                               | (468.193)                         | (179.770)                         |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 1.476.743                         | 11.481                            | 1.775.836                          | 2.480.017                          | 165.409                           | 60.621                            | –                                   | 226.331                           | 140.480                           |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                   |                                    |                                    |                                   |                                   |                                     |                                   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                   |                                    |                                    |                                   |                                   |                                     |                                   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 2.057.222                         | 12.941                            | 2.345.397                          | 5.765.989                          | 174.175                           | 171.064                           | 2.779                               | 247.002                           | 219.960                           |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                                 | –                                 | 324.075                            | 526.299                            | 56.274                            | 168.398                           | 618                                 | 260.588                           | 110.817                           |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (420.614)                         | (930)                             | (878.437)                          | (2.203.372)                        | (56.244)                          | (228.788)                         | (3.224)                             | (364.110)                         | (150.661)                         |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 1.636.608                         | 12.011                            | 1.791.035                          | 4.088.916                          | 174.205                           | 110.674                           | 173                                 | 143.480                           | 180.116                           |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## US Real Estate Securities

|  | Ausschüttende<br>Klasse<br>AUD A<br>(Monatlich) | Ausschüttende<br>Klasse<br>AUD B<br>(Monatlich) | Thesaurierende<br>Klasse<br>AUD B | Ausschüttende<br>Klasse<br>AUD C2<br>(Monatlich)* | Ausschüttende<br>Klasse<br>AUD E<br>(Monatlich) | Thesaurierende<br>Klasse<br>AUD E | Ausschüttende<br>Klasse<br>AUD T<br>(Monatlich) | Thesaurierende<br>Klasse<br>AUD T | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF A | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A |
|--|---|---|-----------------------------------|---|---|-----------------------------------|---|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |   |   |                                   |   |   |                                   |   |                                   |                                   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |   |   |                                   |   |   |                                   |   |                                   |                                   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 402.407   | 329.390   | 125.744                           | –   | 224.291   | 53.360                            | 455.958   | 301.966                           | 102.376                           | 115.346                           |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 6.405   | 93.453  | 48.540                            | –   | 125.635   | 166.753                           | 263.730   | 73.634                            | 564                               | 1.941.088                         |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (78.051)  | (142.156)                                       | (85.495)                          | –   | (230.794)                                       | (146.712)                         | (230.505)                                       | (138.101)                         | (20.384)                          | (1.923.055)                       |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 330.761   | 280.687   | 88.789                            | –   | 119.132   | 73.401                            | 489.183   | 237.499                           | 82.556                            | 133.379                           |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |   |   |                                   |   |   |                                   |   |                                   |                                   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |   |   |                                   |   |   |                                   |   |                                   |                                   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 675.732   | 492.551   | 138.287                           | 1.807   | 245.324   | 121.348                           | 462.964   | 368.420                           | 139.881                           | 133.521                           |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 12.444  | 46.222  | 43.342                            | –   | 19.919  | 26.286                            | 120.444   | 71.826                            | –                                 | 35.925                            |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (285.769)                                       | (209.383)                                       | (55.885)                          | (1.807)   | (40.952)  | (94.274)                          | (127.450)                                       | (138.280)                         | (37.505)                          | (54.100)                          |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 402.407   | 329.390   | 125.744                           | –   | 224.291   | 53.360                            | 455.958   | 301.966                           | 102.376                           | 115.346                           |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M | Ausschüttende<br>Klasse<br>HKD A<br>(Monatlich) | Thesaurierende<br>Klasse<br>SGD A | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD A<br>(Monatlich) | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD A | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD B<br>(Monatlich) | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD B | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD C1 |
|--|-----------------------------------|-----------------------------------|---|-----------------------------------|---|-----------------------------------|----------------------------------|---|-----------------------------------|------------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                   |   |                                   |   |                                   |                                  |   |                                   |                                    |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                   |   |                                   |   |                                   |                                  |   |                                   |                                    |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 504.388                           | 48.516                            | 4.557.644                                       | 27.861                            | 2.515.574                                       | 7.693.487                         | 791.729                          | 2.079.682                                       | 747.507                           | 936.039                            |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 50.259                            | 1.604                             | 1.100.149                                       | 41.326                            | 228.478   | 706.290                           | 15.929                           | 569.786   | 647.952                           | –                                  |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (423.607)                         | (3.483)                           | (1.569.040)                                     | (31.899)                          | (970.416)                                       | (3.330.889)                       | (82.117)                         | (1.016.059)                                     | (733.074)                         | (272.502)                          |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 131.040                           | 46.637                            | 4.088.753                                       | 37.288                            | 1.773.636                                       | 5.068.888                         | 725.541                          | 1.633.409                                       | 662.385                           | 663.537                            |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                   |   |                                   |   |                                   |                                  |   |                                   |                                    |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                   |   |                                   |   |                                   |                                  |   |                                   |                                    |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 550.981                           | 48.760                            | 7.160.831                                       | 28.524                            | 3.425.409                                       | 10.009.919                        | 925.030                          | 2.528.277                                       | 1.279.147                         | 1.229.746                          |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 25.361                            | 3.364                             | 540.387   | 13.501                            | 86.168  | 1.452.660                         | 3.420                            | 540.383   | 444.491                           | –                                  |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (71.954)                          | (3.608)                           | (3.143.574)                                     | (14.164)                          | (996.003)                                       | (3.769.092)                       | (136.721)                        | (988.978)                                       | (976.131)                         | (293.707)                          |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 504.388                           | 48.516                            | 4.557.644                                       | 27.861                            | 2.515.574                                       | 7.693.487                         | 791.729                          | 2.079.682                                       | 747.507                           | 936.039                            |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## US Real Estate Securities (Fortsetzung)

|  | Ausschüttende<br>Klasse Thesaurierende<br>USD C2<br>(Monatlich)* |          | Ausschüttende<br>Klasse Thesaurierende<br>USD E<br>(Monatlich) |           | Ausschüttende<br>Klasse Thesaurierende<br>USD I<br>(Monatlich) |             | Ausschüttende Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I2 |          | Ausschüttende Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M |  | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD T<br>(Monatlich) |
|--|--|----------|--|-----------|--|-------------|--|----------|---|--|---|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |  |          |  |           |  |             |  |          |   |  |   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |  |          |  |           |  |             |  |          |   |  |   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | –  | –        | 910.646  | 563.940   | 23.259   | 4.007.523   | 531.090  | 879.613  | 2.513.906                                       |  | 1.149.534                                       |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –  | –        | 338.211  | 796.788   | –  | 1.104.922   | 619.172  | –        | 277.003   |  | 741.876   |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –  | –        | (827.903)  | (744.493) | (539)  | (1.648.448) | (267.660)  | –        | (656.559)                                       |  | (516.453)                                       |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | –  | –        | 420.954  | 616.235   | 22.720   | 3.463.997   | 882.602  | 879.613  | 2.134.350                                       |  | 1.374.957                                       |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |  |          |  |           |  |             |  |          |   |  |   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |  |          |  |           |  |             |  |          |   |  |   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 33.343   | 25.679   | 1.159.742  | 925.767   | 23.259   | 5.613.666   | 552.034  | 895.705  | 3.629.307                                       |  | 1.332.629                                       |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 9.180  | 275      | 186.730  | 177.748   | –  | 1.148.152   | 34.829   | –        | 142.543   |  | 325.133   |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (42.523)   | (25.954) | (435.826)  | (539.575) | –  | (2.754.295) | (55.773)   | (16.092) | (1.257.944)                                     |  | (508.228)                                       |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | –  | –        | 910.646  | 563.940   | 23.259   | 4.007.523   | 531.090  | 879.613  | 2.513.906                                       |  | 1.149.534                                       |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD T | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z | Ausschüttende<br>Klasse<br>ZAR B<br>(Monatlich) | Thesaurierende<br>Klasse<br>ZAR B | Ausschüttende<br>Klasse<br>ZAR C2<br>(Monatlich)* | Thesaurierende<br>Klasse<br>ZAR C2* | Ausschüttende<br>Klasse<br>ZAR E<br>(Monatlich) | Thesaurierende<br>Klasse<br>ZAR E | Ausschüttende<br>Klasse<br>ZAR T<br>(Monatlich) | Thesaurierende<br>Klasse<br>ZAR T |
|--|-----------------------------------|-----------------------------------|---|-----------------------------------|---|-------------------------------------|---|-----------------------------------|---|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                   |   |                                   |   |                                     |   |                                   |   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                   |   |                                   |   |                                     |   |                                   |   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 1.058.113                         | 72.761                            | 1.001.674                                       | 97.005                            | –   | 1.776                               | 518.873   | 134.912                           | 786.641   | 163.965                           |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 787.367                           | 318.414                           | 68.840  | 83.039                            | –   | –                                   | 637.512   | 59.848                            | 1.036.425                                       | 95.298                            |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (855.005)                         | (36.678)                          | (438.563)                                       | (130.102)                         | –   | (1.776)                             | (610.682)                                       | (127.183)                         | (815.026)                                       | (122.413)                         |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 990.475                           | 354.497                           | 631.951   | 49.942                            | –   | –                                   | 545.703   | 67.577                            | 1.008.040                                       | 136.850                           |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                   |   |                                   |   |                                     |   |                                   |   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                   |   |                                   |   |                                     |   |                                   |   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 1.205.244                         | 194.495                           | 1.218.015                                       | 197.018                           | 26.163  | 5.956                               | 641.792   | 154.149                           | 861.697   | 213.911                           |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 272.790                           | 1.362                             | 64.684  | 38.501                            | –   | –                                   | 134.508   | 52.498                            | 166.334   | 89.973                            |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (419.921)                         | (123.096)                         | (281.025)                                       | (138.514)                         | (26.163)  | (4.180)                             | (257.427)                                       | (71.735)                          | (241.390)                                       | (139.919)                         |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 1.058.113                         | 72.761                            | 1.001.674                                       | 97.005                            | –   | 1.776                               | 518.873   | 134.912                           | 786.641   | 163.965                           |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## US Small Cap

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>AUD B | Thesaurierende<br>Klasse<br>AUD C2* | Thesaurierende<br>Klasse<br>AUD E | Thesaurierende<br>Klasse<br>AUD T | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A<br>(nicht<br>währungs-<br>gesichert) | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I (nicht<br>währungs-<br>gesichert) | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I2 (nicht<br>währungs-<br>gesichert) | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I4 (nicht<br>währungs-<br>gesichert) |
|--|-----------------------------------|-------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|--|-----------------------------------|---|--|--|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                     |                                   |                                   |                                   |  |                                   |   |  |  |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                     |                                   |                                   |                                   |  |                                   |   |  |  |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 145.328                           | 1.010                               | 122.323                           | 117.587                           | 82.838                            | 26.448   | 344.502                           | 260.228   | 519.208  | 4.487.898  |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 117.733                           | –                                   | 162.080                           | 149.107                           | 2.549.064                         | 574.945  | 72.615                            | 1.134.814   | 56.549   | 2.858.109  |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (182.911)                         | (1.010)                             | (173.362)                         | (109.553)                         | (92.402)                          | (10.845)   | (306.374)                         | (225.275)   | (547.519)  | (4.867.040)  |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 80.150                            | –                                   | 111.041                           | 157.141                           | 2.539.500                         | 590.548  | 110.743                           | 1.169.767   | 28.238   | 2.478.967  |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                   |                                     |                                   |                                   |                                   |  |                                   |   |  |  |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                   |                                     |                                   |                                   |                                   |  |                                   |   |  |  |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 108.173                           | 1.690                               | 97.829                            | 111.847                           | 148.159                           | 29.210   | 189.681                           | 211.363   | 1.467.828  | 3.871.698  |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 66.284                            | –                                   | 59.405                            | 27.859                            | 8.459                             | 10.000   | 215.043                           | 80.862  | 170.598  | 739.200  |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (29.129)                          | (680)                               | (34.911)                          | (22.119)                          | (73.780)                          | (12.762)   | (60.222)                          | (31.997)  | (1.119.218)  | (123.000)  |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 145.328                           | 1.010                               | 122.323                           | 117.587                           | 82.838                            | 26.448   | 344.502                           | 260.228   | 519.208  | 4.487.898  |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Small Cap (Fortsetzung)

|  | Thesaurierende Klasse<br>EUR M | Thesaurierende Klasse<br>EUR Z | Thesaurierende Klasse<br>GBP P (nicht währungs-<br>gesichert)* | Ausschüttende Klasse<br>JPY I | Thesaurierende Klasse<br>USD A | Ausschüttende Klasse<br>USD A | Thesaurierende Klasse<br>USD B | Thesaurierende Klasse<br>USD C2* | Thesaurierende Klasse<br>USD E | Thesaurierende Klasse<br>USD I |
|--|--------------------------------|--------------------------------|--|-------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|--------------------------------|----------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                |                                |  |                               |                                |                               |                                |                                  |                                |                                |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                |                                |  |                               |                                |                               |                                |                                  |                                |                                |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 21.065                         | 19.269                         | –  | 744.590.434                   | 3.663.812                      | 632.523                       | 429.444                        | 154                              | 267.712                        | 7.555.619                      |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 26.577                         | 8.867                          | 769  | 115.266.031                   | 2.366.258                      | 381.842                       | 716.757                        | –                                | 2.148.165                      | 5.816.693                      |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (13.125)                       | –                              | –  | (218.178.091)                 | (1.718.742)                    | (292.447)                     | (833.639)                      | (154)                            | (1.073.899)                    | (1.949.778)                    |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 34.517                         | 28.136                         | 769  | 641.678.374                   | 4.311.328                      | 721.918                       | 312.562                        | –                                | 1.341.978                      | 11.422.534                     |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                |                                |  |                               |                                |                               |                                |                                  |                                |                                |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                |                                |  |                               |                                |                               |                                |                                  |                                |                                |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 13.758                         | 18.895                         | –  | 901.455.981                   | 3.946.798                      | 658.004                       | 388.279                        | 3.384                            | 161.293                        | 8.382.330                      |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 11.023                         | 374                            | –  | 116.852.155                   | 632.739                        | 16.607                        | 897.834                        | 330                              | 387.845                        | 2.375.399                      |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (3.716)                        | –                              | –  | (273.717.702)                 | (915.725)                      | (42.088)                      | (856.669)                      | (3.560)                          | (281.426)                      | (3.202.110)                    |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 21.065                         | 19.269                         | –  | 744.590.434                   | 3.663.812                      | 632.523                       | 429.444                        | 154                              | 267.712                        | 7.555.619                      |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

## US Small Cap (Fortsetzung)

|  | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD B | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD T | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z | Thesaurierende<br>Klasse<br>ZAR E | Thesaurierende<br>Klasse<br>ZAR T |
|--|----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                  |                                   |                                   |                                   |                                   |                                   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                  |                                   |                                   |                                   |                                   |                                   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 1.048.516                        | 7.441                             | 229.059                           | 335.926                           | 84.567                            | 32.618                            | 74.274                            |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 464.668                          | 2.848                             | 393.970                           | 563.487                           | 5.882                             | 130.569                           | 77.114                            |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (189.290)                        | (3.647)                           | (143.803)                         | (431.930)                         | (13.111)                          | (93.647)                          | (81.883)                          |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 1.323.894                        | 6.642                             | 479.226                           | 467.483                           | 77.338                            | 69.540                            | 69.505                            |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                  |                                   |                                   |                                   |                                   |                                   |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                  |                                   |                                   |                                   |                                   |                                   |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | 1.118.497                        | 7.496                             | 177.791                           | 364.357                           | 120.834                           | 81.361                            | 96.280                            |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 88.468                           | 189                               | 115.791                           | 256.086                           | 1.462                             | 19.771                            | 36.544                            |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | (158.449)                        | (244)                             | (64.523)                          | (284.517)                         | (37.729)                          | (68.514)                          | (58.550)                          |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 1.048.516                        | 7.441                             | 229.059                           | 335.926                           | 84.567                            | 32.618                            | 74.274                            |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Small Cap Intrinsic Value

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I3* | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I (nicht<br>währungs-<br>gesichert) | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I2 (nicht<br>währungs-<br>gesichert) | Thesaurierende<br>Klasse<br>JPY I3 (nicht<br>währungs-<br>gesichert)* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I2 | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I3* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M |
|--|-------------------------------------|---|--|---|-----------------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr</b> |                                     |   |  |   |                                   |                                   |                                    |                                     |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                     |   |  |   |                                   |                                   |                                    |                                     |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | –                                   | 7.123.885   | 1.833.952  | 633.142   | 417.946                           | 6.095.673                         | 7.128.340                          | –                                   | 23.348                            |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | 693.253                             | 3.712.476   | 331.836  | 99.795  | 171.733                           | 1.803.565                         | 218.019                            | 2.274.334                           | 54.378                            |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –                                   | (1.410.662)   | (314.239)  | (169.295)   | (209.604)                         | (1.141.139)                       | (2.463.388)                        | –                                   | (6.776)                           |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | 693.253                             | 9.425.699   | 1.851.549  | 563.642   | 380.075                           | 6.758.099                         | 4.882.971                          | 2.274.334                           | 70.950                            |
| <b>Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr</b> |                                     |   |  |   |                                   |                                   |                                    |                                     |                                   |
| <b>Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile</b>             |                                     |   |  |   |                                   |                                   |                                    |                                     |                                   |
| Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres            | –                                   | 4.206.288   | 1.414.380  | –   | 461.520                           | 5.064.335                         | 3.900.000                          | –                                   | 31.526                            |
| Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile        | –                                   | 3.974.667   | 551.054  | 633.142   | 76.050                            | 1.935.998                         | 3.228.340                          | –                                   | 739                               |
| Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile    | –                                   | (1.057.070)   | (131.482)  | –   | (119.624)                         | (904.660)                         | –                                  | –                                   | (8.917)                           |
| Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres              | –                                   | 7.123.885   | 1.833.952  | 633.142   | 417.946                           | 6.095.673                         | 7.128.340                          | –                                   | 23.348                            |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE

Der Manager hat für jede Klasse Anspruch auf eine Gebühr in Bezug auf Managementdienste, die er für jedes Portfolio erbringt (die „Managementgebühr“). Darüber hinaus hat der Manager Anspruch auf eine Gebühr von 0,025 % in Bezug auf die von ihm der Gesellschaft bereitgestellten administrativen Supportdienste.

Die maximale jährliche Gebühr, die der Gesellschaft in Bezug auf ein Portfolio in Rechnung gestellt wird, beträgt 2,5 % seines NIW. Die aktuelle Managementgebühr, die in Bezug auf jedes Portfolio zahlbar ist, wird im betreffenden Nachtrag veröffentlicht. Die aktuellen Sätze für die Managementgebühr der einzelnen Anlageklassen sind nachstehend aufgeführt.

Die Managementgebühr läuft täglich auf und ist monatlich rückwirkend am Ende eines jeden Kalendermonats zahlbar. Sofern im Nachtrag des betreffenden Portfolios keine anders lautenden Angaben gemacht werden, bezahlt der Manager die in Bezug auf ein Portfolio bestellten Sub-Investment-Manager oder Anlageberater aus seiner Managementgebühr. Der Manager hat ferner Anspruch auf Erstattung aller Spesen durch die Gesellschaft, die ihm (oder seinen Beauftragten) bei der Erfüllung seiner (ihrer) Pflichten entstehen, und zahlt diese erstatteten Spesen an den jeweiligen Dienstleister.

| Asia Responsible Transition Bond                                 | Management-<br>gebühr | China Equity (Fortsetzung)                           | Management-<br>gebühr |
|--|-----------------------|--|-----------------------|
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)                           | 1,20 %                | Thesaurierende Klasse USD A                          | 1,85 %                |
| Thesaurierende Klasse USD A                                      | 1,20 %                | Ausschüttende Klasse USD A                           | 1,85 %                |
| Thesaurierende Klasse USD C1                                     | 1,20 %                | Thesaurierende Klasse USD I                          | 1,10 %                |
| Thesaurierende Klasse USD I                                      | 0,60 %                | Thesaurierende Klasse USD I2                         | 0,88 %                |
| Ausschüttende Klasse USD I                                       | 0,60 %                | Thesaurierende Klasse USD M                          | 1,85 %                |
| Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich)                          | 0,36 %                | Thesaurierende Klasse USD U                          | 1,45 %                |
| Thesaurierende Klasse USD I4                                     | 0,36 %                | Thesaurierende Klasse USD Z                          | 0,00 %                |
| Thesaurierende Klasse USD M                                      | 1,20 %                |  |                       |
| Ausschüttende Klasse USD X (Monatlich)                           | 1,10 %                | <b>Climate Innovation</b>                            |                       |
| Thesaurierende Klasse USD X                                      | 1,10 %                | Thesaurierende Klasse USD A                          | 1,70 %                |
| Thesaurierende Klasse USD Z                                      | 0,00 %                | Thesaurierende Klasse USD I                          | 0,85 %                |
|  |                       | Thesaurierende Klasse USD I5                         | 0,43 %                |
| <b>China A-Share Equity</b>                                      |                       | Thesaurierende Klasse USD Z                          | 0,00 %                |
| Thesaurierende Klasse CNY I                                      | 0,90 %                |  |                       |
| Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)            | 0,90 %                | <b>CLO Income</b>                                    |                       |
| Ausschüttende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)             | 0,90 %                | Thesaurierende Klasse EUR A                          | 1,50 %                |
|  |                       | Thesaurierende Klasse EUR I                          | 0,75 %                |
| <b>China Bond</b>  |                       | Ausschüttende Klasse EUR I2                          | 0,60 %                |
| Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)                           | 1,30 %                | Thesaurierende Klasse EUR X                          | 0,40 %                |
| Ausschüttende Klasse CNY I                                       | 0,65 %                | Ausschüttende Klasse EUR X                           | 0,40 %                |
| Thesaurierende Klasse CNY Z                                      | 0,00 %                | Thesaurierende Klasse GBP Z                          | 0,00 %                |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) (nicht währungsgesichert) | 1,30 %                | Ausschüttende Klasse JPY I                           | 0,75 %                |
| Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)            | 0,65 %                | Ausschüttende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert) | 0,75 %                |
| Thesaurierende Klasse USD Z                                      | 0,00 %                | Thesaurierende Klasse SEK I                          | 0,75 %                |
| Thesaurierende Klasse USD Z (nicht währungsgesichert)            | 0,00 %                | Thesaurierende Klasse USD A                          | 1,50 %                |
|  |                       | Thesaurierende Klasse USD I                          | 0,75 %                |
| <b>China Equity</b>  |                       | Ausschüttende Klasse USD I                           | 0,75 %                |
| Thesaurierende Klasse CHF I                                      | 1,10 %                | Ausschüttende Klasse USD I2                          | 0,60 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR A                                      | 1,85 %                | Thesaurierende Klasse USD I4                         | 0,45 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR I                                      | 1,10 %                | Ausschüttende Klasse USD I5                          | 0,38 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR Z                                      | 0,00 %                | Thesaurierende Klasse USD U                          | 1,13 %                |
| Thesaurierende Klasse SGD A                                      | 1,85 %                | Thesaurierende Klasse USD Z                          | 0,00 %                |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

| Commodities  | Management-<br>gebühr |
|--|-----------------------|
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)  | 0,65 %                |
| Thesaurierende Klasse GBP I2                           | 0,52 %                |
| Thesaurierende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert) | 0,46 %                |
| Thesaurierende Klasse GBP I5                           | 0,33 %                |
| Thesaurierende Klasse GBP P                            | 0,62 %                |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 1,40 %                |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 0,65 %                |
| Thesaurierende Klasse USD I3                           | 0,46 %                |
| Thesaurierende Klasse USD I5                           | 0,33 %                |
| Thesaurierende Klasse USD M                            | 1,40 %                |
| Thesaurierende Klasse USD Z                            | 0,00 %                |

| Corporate Hybrid Bond                  | Management-<br>gebühr |
|--|-----------------------|
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | 1,20 %                |
| Ausschüttende Klasse CHF A             | 1,20 %                |
| Thesaurierende Klasse CHF I3           | 0,42 %                |
| Thesaurierende Klasse CHF P            | 0,57 %                |
| Ausschüttende Klasse CHF P             | 0,57 %                |
| Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) | 1,20 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR A            | 1,20 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR I            | 0,60 %                |
| Ausschüttende Klasse EUR I             | 0,60 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR I2           | 0,48 %                |
| Ausschüttende Klasse EUR I2            | 0,48 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR I3           | 0,42 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR I5           | 0,30 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR M            | 1,20 %                |
| Ausschüttende Klasse EUR M             | 1,20 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR P            | 0,57 %                |
| Ausschüttende Klasse EUR P             | 0,57 %                |
| Thesaurierende Klasse GBP I            | 0,60 %                |
| Thesaurierende Klasse GBP I2           | 0,48 %                |
| Ausschüttende Klasse GBP I2            | 0,48 %                |
| Thesaurierende Klasse GBP P            | 0,57 %                |
| Ausschüttende Klasse GBP P             | 0,57 %                |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | 1,20 %                |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 1,20 %                |
| Thesaurierende Klasse USD A            | 1,20 %                |
| Ausschüttende Klasse USD A             | 1,20 %                |
| Thesaurierende Klasse USD C1           | 1,20 %                |

| Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)    | Management-<br>gebühr |
|--|-----------------------|
| Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) | 0,60 %                |
| Thesaurierende Klasse USD I            | 0,60 %                |
| Ausschüttende Klasse USD I             | 0,60 %                |
| Thesaurierende Klasse USD I2           | 0,48 %                |
| Ausschüttende Klasse USD I2            | 0,48 %                |
| Thesaurierende Klasse USD M            | 1,20 %                |
| Ausschüttende Klasse USD M             | 1,20 %                |
| Thesaurierende Klasse USD P            | 0,57 %                |
| Thesaurierende Klasse USD Z            | 0,00 %                |

Developed Market FMP – 2027

|                             |        |
|-----------------------------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR A | 0,65 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I  | 0,30 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 0,65 % |
| Ausschüttende Klasse USD A  | 0,65 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,30 % |
| Ausschüttende Klasse USD I  | 0,30 % |
| Thesaurierende Klasse USD X | 0,40 % |

EMD Corporate – Social and Environmental Transition

|  |        |
|--|--------|
| Thesaurierende Klasse CHF I            | 0,80 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A            | 1,60 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I            | 0,80 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I3           | 0,48 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M            | 1,60 % |
| Ausschüttende Klasse EUR M             | 1,60 % |
| Thesaurierende Klasse EUR X            | 0,35 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I            | 0,80 % |
| Thesaurierende Klasse SEK A            | 1,60 % |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 1,60 % |
| Thesaurierende Klasse USD A            | 1,60 % |
| Thesaurierende Klasse USD C1           | 1,60 % |
| Thesaurierende Klasse USD I            | 0,80 % |
| Ausschüttende Klasse USD I             | 0,80 % |
| Thesaurierende Klasse USD I2           | 0,64 % |
| Thesaurierende Klasse USD M            | 1,60 % |
| Ausschüttende Klasse USD M             | 1,60 % |

Emerging Market Debt - Hard Currency

|  |        |
|--|--------|
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | 1,40 % |
|--|--------|

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

| Emerging Market Debt - Hard Currency<br>(Fortsetzung)  | Management-<br>gebühr | Emerging Market Debt - Local Currency                  | Management-<br>gebühr |
|--|-----------------------|--|-----------------------|
| Ausschüttende Klasse AUD I                             | 0,70 %                | Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich)                 | 1,80 %                |
| Thesaurierende Klasse CAD I3 (nicht währungsgesichert) | 0,49 %                | Thesaurierende Klasse AUD B                            | 1,80 %                |
| Thesaurierende Klasse CHF I2                           | 0,56 %                | Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)                 | 1,80 %                |
| Thesaurierende Klasse CHF P                            | 0,67 %                | Thesaurierende Klasse AUD E                            | 1,80 %                |
| Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)                 | 1,40 %                | Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)                 | 1,80 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR A                            | 1,40 %                | Thesaurierende Klasse AUD T                            | 1,80 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR I                            | 0,70 %                | Thesaurierende Klasse EUR A                            | 1,50 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)  | 0,70 %                | Thesaurierende Klasse EUR I                            | 0,75 %                |
| Ausschüttende Klasse EUR I                             | 0,70 %                | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)  | 0,75 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR I2                           | 0,56 %                | Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert) | 0,60 %                |
| Ausschüttende Klasse EUR I2                            | 0,56 %                | Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)  | 0,45 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR I3                           | 0,49 %                | Thesaurierende Klasse EUR Y (nicht währungsgesichert)  | 0,36 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR I4                           | 0,42 %                | Thesaurierende Klasse GBP I                            | 0,75 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert) | 0,35 %                | Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) | 0,45 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR M                            | 1,40 %                | Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)  | 0,45 %                |
| Ausschüttende Klasse EUR M                             | 1,40 %                | Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)  | 0,36 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR P                            | 0,67 %                | Thesaurierende Klasse SEK A                            | 1,50 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR Z                            | 0,00 %                | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)                 | 1,50 %                |
| Thesaurierende Klasse GBP I                            | 0,70 %                | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)                 | 1,50 %                |
| Ausschüttende Klasse GBP I                             | 0,70 %                | Thesaurierende Klasse USD A                            | 1,50 %                |
| Thesaurierende Klasse GBP I2                           | 0,56 %                | Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich)                 | 1,80 %                |
| Ausschüttende Klasse GBP I2                            | 0,56 %                | Thesaurierende Klasse USD B                            | 1,80 %                |
| Thesaurierende Klasse GBP P                            | 0,67 %                | Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)                 | 1,80 %                |
| Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)                 | 1,40 %                | Thesaurierende Klasse USD E                            | 1,80 %                |
| Thesaurierende Klasse JPY I                            | 0,70 %                | Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)                 | 0,75 %                |
| Thesaurierende Klasse SEK A                            | 1,40 %                | Thesaurierende Klasse USD I                            | 0,75 %                |
| Thesaurierende Klasse SEK I2                           | 0,56 %                | Ausschüttende Klasse USD I                             | 0,75 %                |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)                 | 1,40 %                | Thesaurierende Klasse USD I2                           | 0,60 %                |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)                 | 1,40 %                | Thesaurierende Klasse USD I5                           | 0,38 %                |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 1,40 %                | Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)                 | 1,80 %                |
| Ausschüttende Klasse USD A                             | 1,40 %                | Thesaurierende Klasse USD T                            | 1,80 %                |
| Thesaurierende Klasse USD C1                           | 1,40 %                | Thesaurierende Klasse USD X                            | 0,38 %                |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 0,70 %                | Thesaurierende Klasse USD Y                            | 0,36 %                |
| Ausschüttende Klasse USD I                             | 0,70 %                | Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)                 | 1,80 %                |
| Thesaurierende Klasse USD I2                           | 0,56 %                | Thesaurierende Klasse ZAR B                            | 1,80 %                |
| Ausschüttende Klasse USD I2                            | 0,56 %                | Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)                 | 1,80 %                |
| Ausschüttende Klasse USD I3                            | 0,49 %                | Thesaurierende Klasse ZAR E                            | 1,80 %                |
| Thesaurierende Klasse USD M                            | 1,40 %                | Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)                 | 1,80 %                |
| Ausschüttende Klasse USD M                             | 1,40 %                | Thesaurierende Klasse ZAR T                            | 1,80 %                |
| Thesaurierende Klasse USD P                            | 0,67 %                |  |                       |
| Thesaurierende Klasse USD X                            | 0,31 %                | <b>Emerging Market Debt Blend</b>                      |                       |
| Thesaurierende Klasse USD Z                            | 0,00 %                | Ausschüttende Klasse AUD I3                            | 0,49 %                |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

| Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)                       | Managementgebühr | Emerging Markets Equity (Fortsetzung)                | Managementgebühr |
|--|------------------|--|------------------|
| Thesaurierende Klasse EUR A                                    | 1,40 %           | Thesaurierende Klasse AUD E                          | 2,00 %           |
| Thesaurierende Klasse EUR I                                    | 0,70 %           | Thesaurierende Klasse AUD T                          | 2,00 %           |
| Ausschüttende Klasse EUR I                                     | 0,70 %           | Ausschüttende Klasse CAD I (nicht währungsgesichert) | 1,00 %           |
| Thesaurierende Klasse EUR I2                                   | 0,56 %           | Ausschüttende Klasse CAD I2                          | 0,80 %           |
| Ausschüttende Klasse EUR I2                                    | 0,56 %           | Thesaurierende Klasse EUR I                          | 1,00 %           |
| Ausschüttende Klasse EUR I3                                    | 0,49 %           | Thesaurierende Klasse EUR M                          | 2,00 %           |
| Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)         | 0,42 %           | Thesaurierende Klasse EUR Z                          | 0,00 %           |
| Thesaurierende Klasse EUR I5                                   | 0,35 %           | Thesaurierende Klasse GBP I                          | 1,00 %           |
| Thesaurierende Klasse EUR M                                    | 1,40 %           | Thesaurierende Klasse GBP Z                          | 0,00 %           |
| Ausschüttende Klasse EUR M                                     | 1,40 %           | Thesaurierende Klasse USD A                          | 2,00 %           |
| Thesaurierende Klasse EUR Z                                    | 0,00 %           | Thesaurierende Klasse USD B                          | 2,00 %           |
| Thesaurierende Klasse GBP I                                    | 0,70 %           | Thesaurierende Klasse USD E                          | 2,00 %           |
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)          | 0,70 %           | Thesaurierende Klasse USD I                          | 1,00 %           |
| Ausschüttende Klasse GBP I                                     | 0,70 %           | Thesaurierende Klasse USD M                          | 2,00 %           |
| Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)           | 0,70 %           | Thesaurierende Klasse USD T                          | 2,00 %           |
| Thesaurierende Klasse GBP P                                    | 0,67 %           | Thesaurierende Klasse USD Z                          | 0,00 %           |
| Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)          | 0,67 %           | Thesaurierende Klasse ZAR B                          | 2,00 %           |
| Thesaurierende Klasse GBP Z                                    | 0,00 %           | Thesaurierende Klasse ZAR E                          | 2,00 %           |
| Thesaurierende Klasse NOK U                                    | 1,05 %           | Thesaurierende Klasse ZAR T                          | 2,00 %           |
| Thesaurierende Klasse SEK A                                    | 1,40 %           |  |                  |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)                         | 1,40 %           | <b>Euro Bond</b>                                     |                  |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)                         | 1,40 %           | Thesaurierende Klasse EUR A                          | 0,70 %           |
| Thesaurierende Klasse USD A                                    | 1,40 %           | Thesaurierende Klasse EUR I                          | 0,35 %           |
| Thesaurierende Klasse USD C1                                   | 1,40 %           | Ausschüttende Klasse EUR I                           | 0,35 %           |
| Thesaurierende Klasse USD I                                    | 0,70 %           | Thesaurierende Klasse EUR M                          | 0,70 %           |
| Ausschüttende Klasse USD I                                     | 0,70 %           | Thesaurierende Klasse EUR Z                          | 0,00 %           |
| Ausschüttende Klasse USD I2                                    | 0,56 %           |  |                  |
| Thesaurierende Klasse USD I5                                   | 0,35 %           | <b>Euro Bond Absolute Return</b>                     |                  |
| Thesaurierende Klasse USD M                                    | 1,40 %           | Thesaurierende Klasse EUR A                          | 0,90 %           |
| Ausschüttende Klasse USD M                                     | 1,40 %           | Thesaurierende Klasse EUR I                          | 0,45 %           |
| Thesaurierende Klasse USD Z                                    | 0,00 %           | Ausschüttende Klasse EUR I                           | 0,45 %           |
|  |                  | Thesaurierende Klasse EUR I2                         | 0,36 %           |
| <b>Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend</b> |                  | Thesaurierende Klasse EUR I5                         | 0,23 %           |
| Thesaurierende Klasse AUD I2                                   | 0,48 %           | Thesaurierende Klasse EUR Z                          | 0,00 %           |
| Thesaurierende Klasse NOK I                                    | 0,60 %           | Thesaurierende Klasse USD Z                          | 0,00 %           |
| Thesaurierende Klasse NOK I3                                   | 0,42 %           |  |                  |
| Thesaurierende Klasse USD I                                    | 0,60 %           | <b>European High Yield Bond</b>                      |                  |
| Thesaurierende Klasse USD Z                                    | 0,00 %           | Thesaurierende Klasse CHF I                          | 0,60 %           |
|  |                  | Thesaurierende Klasse EUR I                          | 0,60 %           |
| <b>Emerging Markets Equity</b>                                 |                  | Thesaurierende Klasse EUR I2                         | 0,48 %           |
| Thesaurierende Klasse AUD B                                    | 2,00 %           | Ausschüttende Klasse EUR I5                          | 0,30 %           |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

| European High Yield Bond (Fortsetzung)                          | Managementgebühr | Global Equity Megatrends (Fortsetzung)                 | Managementgebühr |
|---|------------------|--|------------------|
| Thesaurierende Klasse EUR M                                     | 1,20 %           | Thesaurierende Klasse EUR I                            | 0,80 %           |
| Thesaurierende Klasse EUR X                                     | 0,20 %           | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)  | 1,60 %           |
| Thesaurierende Klasse EUR Y                                     | 0,10 %           | Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) | 0,48 %           |
| Ausschüttende Klasse EUR Y                                      | 0,10 %           | Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)  | 0,48 %           |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)                          | 1,20 %           | Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)  | 0,76 %           |
| Thesaurierende Klasse USD I                                     | 0,60 %           | Thesaurierende Klasse HKD A                            | 1,60 %           |
| Thesaurierende Klasse USD X                                     | 0,20 %           | Thesaurierende Klasse SGD A                            | 1,60 %           |
| Thesaurierende Klasse USD Z                                     | 0,00 %           | Thesaurierende Klasse USD A                            | 1,60 %           |
|   |                  | Thesaurierende Klasse USD C1                           | 1,60 %           |
| <b>European Sustainable Equity</b>                              |                  | Thesaurierende Klasse USD I                            | 0,80 %           |
| Ausschüttende Klasse EUR A                                      | 1,50 %           | Thesaurierende Klasse USD I4                           | 0,48 %           |
| Thesaurierende Klasse EUR I                                     | 0,60 %           | Thesaurierende Klasse USD M                            | 1,60 %           |
| Ausschüttende Klasse EUR I                                      | 0,60 %           | Thesaurierende Klasse USD U                            | 1,20 %           |
| Ausschüttende Klasse EUR I3                                     | 0,42 %           | Thesaurierende Klasse USD Z                            | 0,00 %           |
| Thesaurierende Klasse EUR I5                                    | 0,30 %           |  |                  |
| Thesaurierende Klasse EUR M                                     | 1,50 %           | <b>Global Flexible Credit Income</b>                   |                  |
| Thesaurierende Klasse EUR Z                                     | 0,00 %           | Thesaurierende Klasse CAD I5                           | 0,30 %           |
| Thesaurierende Klasse USD A (nicht währungsgesichert)           | 1,50 %           | Thesaurierende Klasse EUR I                            | 0,60 %           |
| Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)           | 0,60 %           | Thesaurierende Klasse EUR M                            | 1,20 %           |
| Thesaurierende Klasse USD M (nicht währungsgesichert)           | 1,50 %           | Thesaurierende Klasse GBP I5                           | 0,30 %           |
|   |                  | Ausschüttende Klasse GBP P                             | 0,57 %           |
| <b>Event Driven</b>   |                  | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)                 | 1,20 %           |
| Thesaurierende Klasse EUR I                                     | 1,00 %           | Thesaurierende Klasse USD A                            | 1,20 %           |
| Ausschüttende Klasse EUR I5                                     | 0,50 %           | Thesaurierende Klasse USD I                            | 0,60 %           |
| Thesaurierende Klasse GBP I5                                    | 0,50 %           | Ausschüttende Klasse USD I                             | 0,60 %           |
| Ausschüttende Klasse GBP I5                                     | 0,50 %           | Thesaurierende Klasse USD M                            | 1,20 %           |
| Thesaurierende Klasse GBP P                                     | 0,95 %           | Thesaurierende Klasse USD U                            | 0,90 %           |
| Thesaurierende Klasse JPY I                                     | 1,00 %           | Thesaurierende Klasse USD Z                            | 0,00 %           |
| Thesaurierende Klasse USD I                                     | 1,00 %           |  |                  |
| Thesaurierende Klasse USD I5                                    | 0,50 %           | <b>Global High Yield Engagement</b>                    |                  |
|   |                  | Ausschüttende Klasse AUD I                             | 0,60 %           |
| <b>Global Bond</b>  |                  | Thesaurierende Klasse AUD I4                           | 0,37 %           |
| Thesaurierende Klasse EUR I Benchmark Währungsgesicherte Klasse | 0,20 %           | Thesaurierende Klasse CHF I4                           | 0,37 %           |
| Ausschüttende Klasse GBP P                                      | 0,19 %           | Ausschüttende Klasse CHF I4                            | 0,37 %           |
| Thesaurierende Klasse USD C1                                    | 0,40 %           | Thesaurierende Klasse CHF X                            | 1,10 %           |
| Thesaurierende Klasse USD I Benchmark Währungsgesicherte Klasse | 0,20 %           | Thesaurierende Klasse EUR I4                           | 0,37 %           |
| Thesaurierende Klasse USD I                                     | 0,20 %           | Ausschüttende Klasse EUR I4                            | 0,37 %           |
| Thesaurierende Klasse USD M                                     | 0,40 %           | Thesaurierende Klasse EUR X                            | 1,10 %           |
| Thesaurierende Klasse USD Z                                     | 0,00 %           | Thesaurierende Klasse EUR Z (PF)                       | 0,10 %           |
|   |                  | Thesaurierende Klasse GBP I4                           | 0,37 %           |
| <b>Global Equity Megatrends</b>                                 |                  | Thesaurierende Klasse GBP X                            | 1,10 %           |
| Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)           | 1,60 %           | Thesaurierende Klasse USD A                            | 1,20 %           |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

| Global High Yield Engagement (Fortsetzung) | Managementgebühr |
|--|------------------|
| Thesaurierende Klasse USD I                | 0,60 %           |
| Thesaurierende Klasse USD I4               | 0,37 %           |
| Ausschüttende Klasse USD M                 | 1,20 %           |
| Thesaurierende Klasse USD X                | 1,10 %           |
| Thesaurierende Klasse USD Z                | 0,00 %           |

| Global Investment Grade Credit |        |
|--------------------------------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR I    | 0,10 % |
| Ausschüttende Klasse GBP P     | 0,29 % |
| Ausschüttende Klasse GBP X     | 0,10 % |
| Thesaurierende Klasse USD I    | 0,30 % |
| Thesaurierende Klasse USD X    | 0,10 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z    | 0,00 % |

| Global Opportunistic Bond    |        |
|------------------------------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR I  | 0,30 % |
| Thesaurierende Klasse GBP P  | 0,29 % |
| Thesaurierende Klasse USD A  | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse USD I  | 0,30 % |
| Ausschüttende Klasse USD I   | 0,30 % |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 0,24 % |
| Ausschüttende Klasse USD I2  | 0,24 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z  | 0,00 % |

| Global Real Estate Securities                         |        |
|---|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR M                           | 1,50 % |
| Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert) | 0,00 % |
| Thesaurierende Klasse USD A                           | 1,50 % |
| Thesaurierende Klasse USD CI                          | 1,50 % |
| Thesaurierende Klasse USD I                           | 0,75 % |
| Thesaurierende Klasse USD M                           | 1,50 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z                           | 0,00 % |

| Global Sustainable Equity                              |        |
|--|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert) | 0,30 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)  | 1,50 % |
| Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert)  | 0,00 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)  | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert) | 0,30 % |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 1,50 % |

| Global Sustainable Equity (Fortsetzung) | Managementgebühr |
|---|------------------|
| Thesaurierende Klasse USD I             | 0,60 %           |
| Ausschüttende Klasse USD I              | 0,60 %           |
| Thesaurierende Klasse USD M             | 1,50 %           |
| Thesaurierende Klasse USD Z             | 0,00 %           |

| Global Value   |        |
|--|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR M                            | 0,90 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert) | 0,23 % |
| Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)  | 0,43 % |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 0,90 % |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 0,45 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z                            | 0,00 % |

| High Yield Bond                          |        |
|--|--------|
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)   | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse AUD A              | 1,20 % |
| Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich)   | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse AUD B              | 1,80 % |
| Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)   | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse AUD E              | 1,80 % |
| Ausschüttende Klasse AUD I               | 0,60 % |
| Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)   | 1,80 % |
| Ausschüttende Klasse AUD T (Wöchentlich) | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse AUD T              | 1,80 % |
| Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich)   | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse CHF A              | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse CHF I              | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse CHF I2             | 0,50 % |
| Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)   | 1,20 % |
| Ausschüttende Klasse CNY I (Monatlich)   | 0,60 % |
| Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)   | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A              | 1,20 % |
| Ausschüttende Klasse EUR A               | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I              | 0,60 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I               | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I2             | 0,50 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I2              | 0,50 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M              | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse EUR Z              | 0,00 % |
| Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich)   | 1,20 % |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

| High Yield Bond (Fortsetzung)                                    | Managementgebühr | High Yield Bond (Fortsetzung)                          | Managementgebühr |
|--|------------------|--|------------------|
| Thesaurierende Klasse GBP A                                      | 1,20 %           | Thesaurierende Klasse ZAR E                            | 1,80 %           |
| Ausschüttende Klasse GBP A                                       | 1,20 %           | Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)                 | 1,80 %           |
| Thesaurierende Klasse GBP I                                      | 0,60 %           | Thesaurierende Klasse ZAR T                            | 1,80 %           |
| Ausschüttende Klasse GBP I                                       | 0,60 %           |  |                  |
| Thesaurierende Klasse GBP I2                                     | 0,50 %           | <b>InnovAsia</b>                                       |                  |
| Ausschüttende Klasse GBP I2                                      | 0,50 %           | Thesaurierende Klasse CHF I4                           | 0,51 %           |
| Thesaurierende Klasse GBP Z                                      | 0,00 %           | Thesaurierende Klasse EUR A                            | 1,70 %           |
| Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)                           | 1,20 %           | Thesaurierende Klasse EUR I4                           | 0,51 %           |
| Ausschüttende Klasse JPY A (Monatlich) (nicht währungsgesichert) | 1,20 %           | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)  | 1,70 %           |
| Thesaurierende Klasse SEK A                                      | 1,20 %           | Thesaurierende Klasse EUR X                            | 1,45 %           |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)                           | 1,20 %           | Thesaurierende Klasse SGD A                            | 1,70 %           |
| Thesaurierende Klasse SGD A                                      | 1,20 %           | Thesaurierende Klasse SGD I4                           | 0,51 %           |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)                           | 1,20 %           | Thesaurierende Klasse SGD X                            | 1,45 %           |
| Ausschüttende Klasse USD A (Wöchentlich)                         | 1,20 %           | Thesaurierende Klasse USD A                            | 1,70 %           |
| Thesaurierende Klasse USD A                                      | 1,20 %           | Thesaurierende Klasse USD I                            | 0,85 %           |
| Ausschüttende Klasse USD A                                       | 1,20 %           | Thesaurierende Klasse USD I4                           | 0,51 %           |
| Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich)                           | 1,80 %           | Thesaurierende Klasse USD M                            | 1,70 %           |
| Thesaurierende Klasse USD B                                      | 1,80 %           | Thesaurierende Klasse USD X                            | 1,45 %           |
| Thesaurierende Klasse USD C                                      | 0,80 %           |  |                  |
| Thesaurierende Klasse USD C1                                     | 1,20 %           | <b>Japan Equity Engagement</b>                         |                  |
| Ausschüttende Klasse USD C1                                      | 1,20 %           | Ausschüttende Klasse EUR I5                            | 0,43 %           |
| Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)                           | 1,80 %           | Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert) | 0,43 %           |
| Thesaurierende Klasse USD E                                      | 1,80 %           | Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)  | 0,81 %           |
| Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)                           | 0,60 %           | Thesaurierende Klasse JPY A                            | 1,70 %           |
| Thesaurierende Klasse USD I                                      | 0,60 %           | Thesaurierende Klasse JPY I                            | 0,85 %           |
| Ausschüttende Klasse USD I                                       | 0,60 %           | Ausschüttende Klasse JPY I                             | 0,85 %           |
| Ausschüttende Klasse USD I2 (Monatlich)                          | 0,50 %           | Thesaurierende Klasse JPY I5                           | 0,43 %           |
| Thesaurierende Klasse USD I2                                     | 0,50 %           | Thesaurierende Klasse JPY Z                            | 0,00 %           |
| Ausschüttende Klasse USD I2                                      | 0,50 %           | Thesaurierende Klasse USD A                            | 1,70 %           |
| Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich)                          | 0,36 %           | Thesaurierende Klasse USD I                            | 0,85 %           |
| Thesaurierende Klasse USD M                                      | 1,20 %           | Thesaurierende Klasse USD I5 (nicht währungsgesichert) | 0,43 %           |
| Ausschüttende Klasse USD M                                       | 1,20 %           | Thesaurierende Klasse USD X (nicht währungsgesichert)  | 0,35 %           |
| Thesaurierende Klasse USD P                                      | 0,57 %           |  |                  |
| Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)                           | 1,80 %           | <b>Next Generation Connectivity</b>                    |                  |
| Ausschüttende Klasse USD T (Wöchentlich)                         | 1,80 %           | Thesaurierende Klasse AUD A                            | 1,70 %           |
| Thesaurierende Klasse USD T                                      | 1,80 %           | Thesaurierende Klasse AUD E                            | 1,70 %           |
| Ausschüttende Klasse USD U (Monatlich)                           | 0,90 %           | Thesaurierende Klasse AUD I2                           | 0,68 %           |
| Thesaurierende Klasse USD U                                      | 0,90 %           | Thesaurierende Klasse CHF A                            | 1,70 %           |
| Thesaurierende Klasse USD Z                                      | 0,00 %           | Thesaurierende Klasse CHF I                            | 0,85 %           |
| Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)                           | 1,80 %           | Thesaurierende Klasse CHF I2                           | 0,68 %           |
| Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)                           | 1,80 %           | Thesaurierende Klasse CNY A                            | 1,70 %           |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

| Next Generation Connectivity (Fortsetzung)             | Managementgebühr | Next Generation Space Economy (Fortsetzung)           | Managementgebühr |
|--|------------------|---|------------------|
| Thesaurierende Klasse CNY I2                           | 0,68 %           | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) | 1,70 %           |
| Thesaurierende Klasse EUR A                            | 1,70 %           | Thesaurierende Klasse USD A                           | 1,70 %           |
| Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)  | 1,70 %           | Thesaurierende Klasse USD I                           | 0,85 %           |
| Thesaurierende Klasse EUR I                            | 0,85 %           |   |                  |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)  | 0,85 %           | <b>Short Duration Emerging Market Debt</b>            |                  |
| Thesaurierende Klasse EUR I2                           | 0,68 %           | Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)                | 1,00 %           |
| Thesaurierende Klasse EUR I5                           | 0,43 %           | Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich)                | 1,00 %           |
| Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)  | 1,70 %           | Thesaurierende Klasse CHF A                           | 1,00 %           |
| Thesaurierende Klasse GBP A                            | 1,70 %           | Ausschüttende Klasse CHF A                            | 1,00 %           |
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)  | 0,85 %           | Thesaurierende Klasse CHF I                           | 0,50 %           |
| Thesaurierende Klasse GBP I2                           | 0,68 %           | Ausschüttende Klasse CHF I                            | 0,50 %           |
| Thesaurierende Klasse HKD A                            | 1,70 %           | Thesaurierende Klasse CHF I2                          | 0,40 %           |
| Thesaurierende Klasse HKD I2                           | 0,68 %           | Ausschüttende Klasse CHF I2                           | 0,40 %           |
| Thesaurierende Klasse SGD A                            | 1,70 %           | Thesaurierende Klasse CHF I5                          | 0,25 %           |
| Thesaurierende Klasse SGD I2                           | 0,68 %           | Thesaurierende Klasse CHF P                           | 0,48 %           |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 1,70 %           | Thesaurierende Klasse EUR A                           | 1,00 %           |
| Thesaurierende Klasse USD E                            | 1,80 %           | Ausschüttende Klasse EUR A                            | 1,00 %           |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 0,85 %           | Thesaurierende Klasse EUR I                           | 0,50 %           |
| Ausschüttende Klasse USD I                             | 0,85 %           | Ausschüttende Klasse EUR I                            | 0,50 %           |
| Thesaurierende Klasse USD I2                           | 0,68 %           | Thesaurierende Klasse EUR I2                          | 0,40 %           |
| Thesaurierende Klasse USD I3                           | 0,60 %           | Ausschüttende Klasse EUR I2                           | 0,40 %           |
| Thesaurierende Klasse USD I5                           | 0,43 %           | Thesaurierende Klasse EUR I5                          | 0,25 %           |
| Thesaurierende Klasse USD M                            | 1,70 %           | Thesaurierende Klasse EUR M                           | 1,00 %           |
| Thesaurierende Klasse USD Z                            | 0,00 %           | Ausschüttende Klasse EUR M                            | 1,00 %           |
| Thesaurierende Klasse ZAR A                            | 1,70 %           | Thesaurierende Klasse EUR P                           | 0,48 %           |
| Thesaurierende Klasse ZAR E                            | 1,80 %           | Thesaurierende Klasse EUR U                           | 0,75 %           |
|  |                  | Thesaurierende Klasse GBP A                           | 1,00 %           |
| <b>Next Generation Mobility</b>                        |                  | Thesaurierende Klasse GBP I                           | 0,50 %           |
| Thesaurierende Klasse EUR A                            | 1,70 %           | Ausschüttende Klasse GBP I                            | 0,50 %           |
| Thesaurierende Klasse EUR I                            | 0,85 %           | Thesaurierende Klasse GBP I2                          | 0,40 %           |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)  | 0,85 %           | Ausschüttende Klasse GBP I2                           | 0,40 %           |
| Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)  | 1,70 %           | Ausschüttende Klasse GBP I5                           | 0,25 %           |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 1,70 %           | Thesaurierende Klasse GBP P                           | 0,48 %           |
| Thesaurierende Klasse USD C1                           | 1,70 %           | Thesaurierende Klasse JPY I                           | 0,50 %           |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 0,85 %           | Ausschüttende Klasse JPY I                            | 0,50 %           |
| Ausschüttende Klasse USD I                             | 0,85 %           | Thesaurierende Klasse SEK A                           | 1,00 %           |
| Thesaurierende Klasse USD M                            | 1,70 %           | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)                | 1,00 %           |
| Thesaurierende Klasse USD X                            | 1,55 %           | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)                | 1,00 %           |
|  |                  | Thesaurierende Klasse USD A                           | 1,00 %           |
| <b>Next Generation Space Economy</b>                   |                  | Ausschüttende Klasse USD A                            | 1,00 %           |
| Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)  | 1,70 %           | Thesaurierende Klasse USD C1                          | 1,00 %           |
| Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert) | 0,60 %           | Ausschüttende Klasse USD C1                           | 1,00 %           |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

| Short Duration Emerging Market Debt<br>(Fortsetzung) | Managementgebühr | Short Duration High Yield Engagement<br>(Fortsetzung)            | Management-<br>gebühr |
|--|------------------|--|-----------------------|
| Thesaurierende Klasse USD I                          | 0,50 %           | Thesaurierende Klasse JPY I                                      | 0,60 %                |
| Ausschüttende Klasse USD I                           | 0,50 %           | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)                           | 1,20 %                |
| Thesaurierende Klasse USD I2                         | 0,40 %           | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)                           | 1,20 %                |
| Ausschüttende Klasse USD I2                          | 0,40 %           | Thesaurierende Klasse USD A                                      | 1,20 %                |
| Thesaurierende Klasse USD I5                         | 0,25 %           | Ausschüttende Klasse USD A                                       | 1,20 %                |
| Ausschüttende Klasse USD I5                          | 0,25 %           | Thesaurierende Klasse USD C1                                     | 1,20 %                |
| Thesaurierende Klasse USD M                          | 1,00 %           | Thesaurierende Klasse USD I                                      | 0,60 %                |
| Ausschüttende Klasse USD M                           | 1,00 %           | Ausschüttende Klasse USD I                                       | 0,60 %                |
| Thesaurierende Klasse USD P                          | 0,48 %           | Thesaurierende Klasse USD I2                                     | 0,50 %                |
| Thesaurierende Klasse USD Z                          | 0,00 %           | Ausschüttende Klasse USD I2                                      | 0,50 %                |
|  |                  | Thesaurierende Klasse USD I4                                     | 0,36 %                |
|  |                  | Thesaurierende Klasse USD I5                                     | 0,30 %                |
| <b>Short Duration Euro Bond</b>                      |                  | Thesaurierende Klasse USD M                                      | 1,20 %                |
| Thesaurierende Klasse CHF P                          | 0,18 %           | Ausschüttende Klasse USD M                                       | 1,20 %                |
| Thesaurierende Klasse CHF U                          | 0,29 %           | Thesaurierende Klasse USD Z                                      | 0,00 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR A                          | 0,38 %           |  |                       |
| Thesaurierende Klasse EUR I                          | 0,19 %           | <b>Strategic Income</b>  |                       |
| Ausschüttende Klasse EUR I                           | 0,19 %           | Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)                           | 1,00 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR I2                         | 0,15 %           | Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)                           | 1,00 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR I5                         | 0,09 %           | Ausschüttende Klasse AUD Z (Monatlich)                           | 0,00 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR M                          | 0,38 %           | Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)                           | 1,00 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR U                          | 0,29 %           | Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)                           | 1,00 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR Z                          | 0,00 %           | Thesaurierende Klasse EUR A                                      | 1,00 %                |
| Thesaurierende Klasse USD I                          | 0,19 %           | Thesaurierende Klasse EUR I                                      | 0,50 %                |
| Thesaurierende Klasse USD Z                          | 0,00 %           | Thesaurierende Klasse EUR M                                      | 1,00 %                |
|  |                  | Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich)                           | 1,00 %                |
| <b>Short Duration High Yield Engagement</b>          |                  | Ausschüttende Klasse GBP I (Monatlich)                           | 0,50 %                |
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)               | 1,20 %           | Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)                           | 1,00 %                |
| Thesaurierende Klasse CHF A                          | 1,20 %           | Ausschüttende Klasse JPY A (Monatlich)                           | 1,00 %                |
| Thesaurierende Klasse CHF I                          | 0,60 %           | Ausschüttende Klasse JPY A (Monatlich) (nicht währungsgesichert) | 1,00 %                |
| Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)               | 1,20 %           | Ausschüttende Klasse JPY E (Monatlich) (nicht währungsgesichert) | 1,00 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR A                          | 1,20 %           | Thesaurierende Klasse JPY I                                      | 0,50 %                |
| Ausschüttende Klasse EUR A                           | 1,20 %           | Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert)            | 0,50 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR I                          | 0,60 %           | Ausschüttende Klasse JPY I CG                                    | 0,50 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR I2                         | 0,50 %           | Ausschüttende Klasse JPY I                                       | 0,50 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR M                          | 1,20 %           | Thesaurierende Klasse JPY Z                                      | 0,00 %                |
| Ausschüttende Klasse EUR M                           | 1,20 %           | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)                           | 1,00 %                |
| Thesaurierende Klasse GBP I                          | 0,60 %           | Thesaurierende Klasse SGD A                                      | 1,00 %                |
| Ausschüttende Klasse GBP I                           | 0,60 %           | Ausschüttende Klasse SGD I (Monatlich)                           | 0,50 %                |
| Thesaurierende Klasse GBP I2                         | 0,50 %           | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)                           | 1,00 %                |
| Ausschüttende Klasse GBP I2                          | 0,50 %           | Thesaurierende Klasse USD A                                      | 1,00 %                |
| Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)               | 1,20 %           |  |                       |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

| Strategic Income (Fortsetzung)                          | Managementgebühr |
|---|------------------|
| Ausschüttende Klasse USD A                              | 1,00 %           |
| Thesaurierende Klasse USD C1                            | 1,00 %           |
| Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)                  | 1,00 %           |
| Thesaurierende Klasse USD I                             | 0,50 %           |
| Ausschüttende Klasse USD I                              | 0,50 %           |
| Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich)                 | 0,30 %           |
| Thesaurierende Klasse USD M                             | 1,00 %           |
| Ausschüttende Klasse USD M                              | 1,00 %           |
| Thesaurierende Klasse USD Z                             | 0,00 %           |
| Ausschüttende Klasse ZAR A (Monatlich)                  | 1,00 %           |
| Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)                  | 1,00 %           |
| <b>Sustainable Asia High Yield</b>                      |                  |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)                  | 1,20 %           |
| Thesaurierende Klasse USD A                             | 1,20 %           |
| Thesaurierende Klasse USD I                             | 0,60 %           |
| Thesaurierende Klasse USD Z                             | 0,00 %           |
| Ausschüttende Klasse USD Z                              | 0,00 %           |
| <b>Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency</b> |                  |
| Thesaurierende Klasse EUR I3                            | 0,49 %           |
| Thesaurierende Klasse EUR I4                            | 0,42 %           |
| Thesaurierende Klasse EUR X                             | 0,35 %           |
| Thesaurierende Klasse USD I                             | 0,70 %           |
| Thesaurierende Klasse USD I5                            | 0,35 %           |
| <b>Tactical Macro</b>                                   |                  |
| Thesaurierende Klasse EUR I5                            | 0,40 %           |
| Thesaurierende Klasse USD I                             | 0,80 %           |
| Thesaurierende Klasse USD I5                            | 0,40 %           |
| Thesaurierende Klasse USD Z                             | 0,00 %           |
| <b>Uncorrelated Strategies</b>                          |                  |
| Thesaurierende Klasse CHF I                             | 0,75 %           |
| Thesaurierende Klasse EUR A                             | 1,50 %           |
| Thesaurierende Klasse EUR I                             | 0,75 %           |
| Thesaurierende Klasse EUR I2                            | 0,60 %           |
| Thesaurierende Klasse EUR M                             | 1,50 %           |
| Thesaurierende Klasse EUR P                             | 0,71 %           |
| Thesaurierende Klasse GBP I                             | 0,75 %           |
| Thesaurierende Klasse GBP I2                            | 0,60 %           |

| Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)                  | Managementgebühr |
|--|------------------|
| Ausschüttende Klasse GBP I2                            | 0,60 %           |
| Thesaurierende Klasse GBP I5                           | 0,38 %           |
| Thesaurierende Klasse GBP P                            | 0,71 %           |
| Thesaurierende Klasse GBP Z                            | 0,00 %           |
| Thesaurierende Klasse JPY I                            | 0,75 %           |
| Thesaurierende Klasse SGD A                            | 1,50 %           |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 1,50 %           |
| Thesaurierende Klasse USD C1                           | 1,50 %           |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 0,75 %           |
| Thesaurierende Klasse USD I2                           | 0,60 %           |
| Thesaurierende Klasse USD I5                           | 0,38 %           |
| Thesaurierende Klasse USD M                            | 1,50 %           |
| Thesaurierende Klasse USD P                            | 0,71 %           |
| Thesaurierende Klasse USD Z                            | 0,00 %           |
| <b>US Equity</b>                                       |                  |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)  | 0,75 %           |
| Thesaurierende Klasse EUR I5                           | 0,38 %           |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert) | 0,38 %           |
| Ausschüttende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)  | 0,38 %           |
| Thesaurierende Klasse EUR X (nicht währungsgesichert)  | 0,15 %           |
| Ausschüttende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)  | 0,38 %           |
| Thesaurierende Klasse GBP X (nicht währungsgesichert)  | 0,15 %           |
| Thesaurierende Klasse JPY I3                           | 0,53 %           |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 1,50 %           |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 0,75 %           |
| Ausschüttende Klasse USD I                             | 0,75 %           |
| Thesaurierende Klasse USD I5                           | 0,38 %           |
| Ausschüttende Klasse USD I5                            | 0,38 %           |
| Thesaurierende Klasse USD M                            | 1,50 %           |
| Thesaurierende Klasse USD X                            | 0,15 %           |
| Thesaurierende Klasse USD Z                            | 0,00 %           |
| <b>US Equity Premium</b>                               |                  |
| Thesaurierende Klasse EUR I                            | 0,60 %           |
| Ausschüttende Klasse EUR I3                            | 0,42 %           |
| Thesaurierende Klasse EUR I4                           | 0,36 %           |
| Ausschüttende Klasse EUR I4                            | 0,36 %           |
| Thesaurierende Klasse EUR M                            | 1,20 %           |
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)  | 0,60 %           |
| Thesaurierende Klasse GBP I3                           | 0,42 %           |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

| US Equity Premium (Fortsetzung)                        | Management-<br>gebühr |
|--|-----------------------|
| Ausschüttende Klasse GBP I3                            | 0,42 %                |
| Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert)  | 0,42 %                |
| Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) | 0,36 %                |
| Ausschüttende Klasse GBP I4                            | 0,36 %                |
| Ausschüttende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)   | 0,57 %                |
| Thesaurierende Klasse GBP X (nicht währungsgesichert)  | 0,34 %                |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)                 | 1,20 %                |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 1,20 %                |
| Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)                 | 0,60 %                |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 0,60 %                |
| Ausschüttende Klasse USD I3                            | 0,42 %                |
| Thesaurierende Klasse USD I4                           | 0,36 %                |
| Thesaurierende Klasse USD M                            | 1,20 %                |
| Thesaurierende Klasse USD Z                            | 0,00 %                |

**US Large Cap Value**

|  |        |
|--|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR A                            | 1,50 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)  | 1,50 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I                            | 0,70 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)  | 0,70 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)  | 0,42 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert) | 0,35 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I                            | 0,70 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)  | 0,70 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I                             | 0,70 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)   | 0,70 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)  | 0,42 % |
| Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)  | 0,67 % |
| Ausschüttende Klasse GBP P                             | 0,67 % |
| Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)  | 0,63 % |
| Ausschüttende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)   | 0,63 % |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 1,50 % |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 0,70 % |
| Ausschüttende Klasse USD I4                            | 0,42 % |
| Thesaurierende Klasse USD I5                           | 0,35 % |
| Thesaurierende Klasse USD M                            | 1,50 % |
| Thesaurierende Klasse USD Y                            | 0,63 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z                            | 0,00 % |

**US Long Short Equity**

|                             |        |
|-----------------------------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR A | 2,25 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 1,35 % |

| US Long Short Equity (Fortsetzung)                     | Management-<br>gebühr |
|--|-----------------------|
| Thesaurierende Klasse EUR I3                           | 0,95 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert) | 0,95 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR M                            | 2,25 %                |
| Ausschüttende Klasse GBP I3                            | 0,95 %                |
| Thesaurierende Klasse SGD A1                           | 1,80 %                |
| Thesaurierende Klasse USD A (PF)                       | 1,70 %                |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 2,25 %                |
| Thesaurierende Klasse USD A1                           | 1,80 %                |
| Ausschüttende Klasse USD I (PF)                        | 1,00 %                |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 1,35 %                |
| Thesaurierende Klasse USD I3                           | 0,95 %                |
| Thesaurierende Klasse USD M                            | 2,25 %                |
| Thesaurierende Klasse USD U                            | 1,80 %                |
| Thesaurierende Klasse USD Z                            | 0,00 %                |

**US Multi Cap Opportunities**

|   |        |
|---|--------|
| Thesaurierende Klasse AUD E                           | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse AUD T                           | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I3                          | 0,50 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M                           | 1,70 % |
| Thesaurierende Klasse EUR1 A                          | 1,70 % |
| Thesaurierende Klasse EUR1 I                          | 0,85 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) | 0,85 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I3                           | 0,50 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert) | 0,50 % |
| Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) | 0,81 % |
| Thesaurierende Klasse SGD A                           | 1,70 % |
| Thesaurierende Klasse USD B                           | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse USD C1                          | 1,70 % |
| Thesaurierende Klasse USD E                           | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse USD I2                          | 0,68 % |
| Thesaurierende Klasse USD I3                          | 0,50 % |
| Thesaurierende Klasse USD M                           | 1,70 % |
| Thesaurierende Klasse USD T                           | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse USD U                           | 1,25 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z                           | 0,00 % |
| Thesaurierende Klasse USD1 A                          | 1,70 % |
| Thesaurierende Klasse USD1 I                          | 0,85 % |
| Ausschüttende Klasse USD1 I                           | 0,85 % |
| Thesaurierende Klasse ZAR B                           | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse ZAR E                           | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse ZAR T                           | 1,80 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

| US Real Estate Securities              | Management-<br>gebühr | US Small Cap (Fortsetzung)                             | Management-<br>gebühr |
|--|-----------------------|--|-----------------------|
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | 1,50 %                | Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)  | 1,70 %                |
| Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich) | 1,80 %                | Thesaurierende Klasse EUR I                            | 0,85 %                |
| Thesaurierende Klasse AUD B            | 1,80 %                | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)  | 0,85 %                |
| Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich) | 1,80 %                | Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert) | 0,68 %                |
| Thesaurierende Klasse AUD E            | 1,80 %                | Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert) | 0,51 %                |
| Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) | 1,80 %                | Thesaurierende Klasse EUR M                            | 1,70 %                |
| Thesaurierende Klasse AUD T            | 1,80 %                | Thesaurierende Klasse EUR Z                            | 0,00 %                |
| Thesaurierende Klasse CHF A            | 1,50 %                | Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)  | 0,81 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR A            | 1,50 %                | Ausschüttende Klasse JPY I                             | 0,85 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR I            | 0,75 %                | Thesaurierende Klasse USD A                            | 1,70 %                |
| Thesaurierende Klasse EUR M            | 1,50 %                | Ausschüttende Klasse USD A                             | 1,70 %                |
| Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) | 1,50 %                | Thesaurierende Klasse USD B                            | 1,80 %                |
| Thesaurierende Klasse SGD A            | 1,50 %                | Thesaurierende Klasse USD E                            | 1,80 %                |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 1,50 %                | Thesaurierende Klasse USD I                            | 0,85 %                |
| Thesaurierende Klasse USD A            | 1,50 %                | Ausschüttende Klasse USD I                             | 0,85 %                |
| Ausschüttende Klasse USD A             | 1,50 %                | Thesaurierende Klasse USD I3                           | 0,60 %                |
| Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich) | 1,80 %                | Thesaurierende Klasse USD M                            | 1,70 %                |
| Thesaurierende Klasse USD B            | 1,80 %                | Thesaurierende Klasse USD T                            | 1,80 %                |
| Thesaurierende Klasse USD C1           | 1,50 %                | Thesaurierende Klasse USD Z                            | 0,00 %                |
| Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich) | 1,80 %                | Thesaurierende Klasse ZAR E                            | 1,80 %                |
| Thesaurierende Klasse USD E            | 1,80 %                | Thesaurierende Klasse ZAR T                            | 1,80 %                |
| Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) | 0,75 %                |  |                       |
| Thesaurierende Klasse USD I            | 0,75 %                | <b>US Small Cap Intrinsic Value</b>                    |                       |
| Ausschüttende Klasse USD I             | 0,75 %                | Thesaurierende Klasse EUR I3                           | 0,60 %                |
| Thesaurierende Klasse USD I2           | 0,54 %                | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)  | 0,85 %                |
| Thesaurierende Klasse USD M            | 1,50 %                | Thesaurierende Klasse GBP I2 (nicht währungsgesichert) | 0,68 %                |
| Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) | 1,80 %                | Thesaurierende Klasse JPY I3 (nicht währungsgesichert) | 0,60 %                |
| Thesaurierende Klasse USD T            | 1,80 %                | Thesaurierende Klasse USD A                            | 1,70 %                |
| Thesaurierende Klasse USD Z            | 0,00 %                | Thesaurierende Klasse USD I                            | 0,85 %                |
| Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich) | 1,80 %                | Thesaurierende Klasse USD I2                           | 0,68 %                |
| Thesaurierende Klasse ZAR B            | 1,80 %                | Thesaurierende Klasse USD I3                           | 0,60 %                |
| Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich) | 1,80 %                | Thesaurierende Klasse USD M                            | 1,70 %                |
| Thesaurierende Klasse ZAR E            | 1,80 %                |  |                       |
| Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) | 1,80 %                |  |                       |
| Thesaurierende Klasse ZAR T            | 1,80 %                |  |                       |
|  |                       |  |                       |
| <b>US Small Cap</b>                    |                       |  |                       |
| Thesaurierende Klasse AUD B            | 1,80 %                |  |                       |
| Thesaurierende Klasse AUD E            | 1,80 %                |  |                       |
| Thesaurierende Klasse AUD T            | 1,80 %                |  |                       |
| Thesaurierende Klasse EUR A            | 1,70 %                |  |                       |

Gegebenenfalls wird auf die o. g. Gebühren ein Rabatt eingeräumt.

**FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR****6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)**

Der Manager kann auf seine Gebühren verzichten, um die Gesamtkostenquoten („TERs“) der Portfolios nach oben zu begrenzen. Diese Gebührenverzichtete sind freiwillig und können vom Manager jederzeit ohne vorherige Mitteilung zurückgenommen werden. Gebühren, auf die freiwillig verzichtet wurde, können nicht vom Manager zurückgefordert werden. Eine Aufgliederung der TERs der einzelnen Portfolios ist in Anhang I enthalten.

Für jede Klasse der Uncorrelated Strategies hat der Sub-Investment-Manager Anspruch auf eine Gebühr (die „zusätzliche Beratergebühr“) von bis zu 0,75 % des Nettoinventarwerts des Portfolios für die von den Beratern für das Portfolio erbrachten Dienstleistungen. Die zusätzliche Beratergebühr läuft täglich auf und ist monatlich nachträglich innerhalb von 30 Geschäftstagen nach dem Ende des Kalendermonats zu zahlen.

Die Gesellschaft bezahlt Verwaltungsgebühren, die nicht mehr als 0,20 % des NIW des betreffenden Portfolios betragen werden. Die Verwaltungsgebühr setzt sich zusammen aus einer Gebühr, die an die Verwaltungsstelle für die von ihr in Bezug auf jedes Portfolio erbrachten Verwaltungsdienste zu zahlen ist, und einer Gebühr, die an den Manager für die von ihm für jedes Portfolio erbrachten administrativen Supportdienste zu zahlen ist; sie läuft monatlich auf und ist monatlich rückwirkend zu zahlen.

Der Fonds zahlt/zahlte an die Verwaltungsstelle Verwaltungsgebühren auf der Grundlage der Bewertung des Nettovermögens des Uncorrelated Strategies und Uncorrelated Trading am Monatsende mit den folgenden Sätzen:

|  |         |
|--|---------|
| Vermögenswerte von 0 – 500 Mio. US\$     | 0,055 % |
| Vermögenswerte von 500 – 2.000 Mio. US\$ | 0,05 %  |
| Vermögenswerte über 2.000 Mio. US\$      | 0,04 %  |

Mit Wirkung zum 1. Januar 2024 zahlt der Fonds an die Verwaltungsstelle Verwaltungsgebühren auf der Grundlage des Nettoinventarwertes am Monatsende, und zwar für jedes von der Verwaltungsstelle verwaltete Portfolio und mit den folgenden Sätzen:

|   |          |
|---|----------|
| Vermögenswerte von 0 – 25.000 Mio. US\$ | 0,0055 % |
| Vermögenswerte über 25.000 Mio. US\$    | 0,0025 % |

Die oben genannten Gebühren unterliegen einer monatlichen Mindestgebühr von 1.900 US\$ pro Portfolio und umfassen fünf Anteilklassen pro Portfolio. Bei Portfolios, die mehr als fünf Anteilklassen haben, wird für jede zusätzliche Anteilklasse eine monatliche Gebühr von 100 US\$ erhoben.

Für das zum 31. Dezember 2023 endende Geschäftsjahr zahlte der Fonds an die Verwaltungsstelle Verwaltungsgebühren auf der Grundlage des Nettoinventarwertes am Monatsende, und zwar für jedes von der Verwaltungsstelle verwaltete Portfolio und mit den folgenden Sätzen:

|   |         |
|---|---------|
| Vermögenswerte von 0 – 25.000 Mio. US\$ | 0,008 % |
| Vermögenswerte über 25.000 Mio. US\$    | 0,005 % |

Die oben genannten Gebühren unterliegen einer monatlichen Mindestgebühr von 4.000 USD pro Portfolio und umfassen vier Anteilklassen pro Portfolio. Bei Portfolios, die mehr als vier Anteilklassen hatten, wurde für jede zusätzliche Anteilklasse eine monatliche Gebühr von 150 US\$ erhoben.

Darüber hinaus hat die Verwaltungsstelle Anspruch auf eine weitere Gebühr in Bezug auf die Transferstellendienste, die sie für das Portfolio erbringt.

In Bezug auf Anteile der Klassen B, C, E, C1 und C2 des jeweiligen Portfolios hat/haben der Manager und/oder die betreffende Vertriebsstelle für ihre Vertriebsdienstleistungen, die er/sie für diese Klassen erbringt/erbringen, Anspruch auf eine Vertriebsgebühr zu einem jährlichen Satz von 1,00 % des NIW der betreffenden Klassen. Diese wird taggenau berechnet und monatlich rückwirkend am Ende eines jeden Kalendermonats gezahlt. In Bezug auf Anteile der Klasse M des jeweiligen Portfolios hat/haben der Manager und/oder die betreffende Vertriebsstelle für seine/ihre Vertriebsdienstleistungen, die er/sie für diese Klassen erbringt/erbringen, Anspruch auf eine Vertriebsgebühr zu einem jährlichen Satz in Höhe eines Prozentsatzes des NIW der jeweiligen Klasse. Diese wird taggenau berechnet und monatlich rückwirkend am Ende eines jeden Kalendermonats gezahlt. Der Satz für diese Vertriebsgebühr variiert zwischen den Portfolios und ist im Nachtrag für die einzelnen Portfolios aufgeführt. In Bezug auf alle anderen Klassen kann der Manager der Vertriebsstelle für ihre Vertriebsdienste eine Gebühr (zu normalen kommerziellen Sätzen) zahlen, die ebenfalls durch Managementgebühr abgedeckt wird.

**FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR**

**6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)**

*Gebühren der nicht verbundenen Unterberater*

Die an die vom Manager und/oder Sub-Investment-Manager ernannten nicht verbundenen Unterberater gezahlten Gebühren werden mit Ausnahme der Green Court Capital Management Limited und den Unterberatern zu Uncorrelated Strategies aus dem Portfoliovermögen bestritten. Die insgesamt an alle Berater gezahlten Gebühren lagen zwischen 0,65 % und 1,50 % des NIW des Portfolios. Die aggregierten Beratungsgebühren für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024 betragen null US\$ (31. Dezember 2023: 1.145.544 US\$).

**Erfolgsabhängige Gebühren**

Für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr wird eine erfolgsabhängige Gebühr für den US Long Short Equity, den Tactical Macro, den Global High Yield Engagement und den Event Driven berechnet.

*An den Manager und einen Sub-Investment-Manager gezahlte erfolgsabhängige Gebühr*

Der Manager und ein Sub-Investment-Manager haben unter Umständen Anspruch auf eine erfolgsabhängige Gebühr (die „erfolgsabhängige Gebühr“) die aus dem Portfoliovermögen in Bezug auf jede PF-Klasse des betreffenden Portfolios zahlbar ist. Die Verwahrstelle überprüft die Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühr. Die Direktoren können mit Zustimmung des Managers die erfolgsabhängige Gebühr, die von einer Anteilklasse zu zahlen ist, reduzieren. Erfolgsabhängige Gebühren fallen auf realisierte und nicht realisierte Kapitalerträge unter Berücksichtigung der realisierten und nicht realisierten Verluste zum Ende des unten für jedes Portfolio definierten Berechnungszeitraums an. Daher können erfolgsabhängige Gebühren auf nicht realisierte Gewinne gezahlt werden, die in der Folge niemals realisiert werden.

Anteilhaber werden darauf hingewiesen, dass die erfolgsabhängige Gebühr auf Anteilklassenebene und nicht auf Ebene des individuellen Anteilhabers berechnet wird und ihnen daher eine erfolgsabhängige Gebühr in Rechnung gestellt werden kann, auch wenn der NIW ihrer Anteile gleichgeblieben oder zurückgegangen ist. Dies ist unter Umständen der Fall, wenn Anteilhaber Anteile zu einem Zeitpunkt kaufen oder verkaufen, bei dem es sich nicht um den Beginn oder das Ende des Berechnungszeitraums handelt.

Wird der Managementvertrag in einem beliebigen Jahr vor Ende des Berechnungszeitraums beendet oder dem Sub-Investment-Manager gekündigt, dann wird die erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf den laufenden Berechnungszeitraum so berechnet und ausbezahlt, als ob das Datum, zu dem dieser Vertrag beendet wird, dem Ende des betreffenden Berechnungszeitraums entspräche.

Die erfolgsabhängige Gebühr läuft an jedem Handelstag im NIW auf und ist gewöhnlich an den Manager oder einen Sub-Investment-Manager rückwirkend innerhalb von 30 Geschäftstagen am Ende eines jeden Berechnungszeitraums zu zahlen. Im Falle von während des Berechnungszeitraums zurückgenommenen Anteilen ist die aufgelaufene erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf diese Anteile jedoch an den Manager oder einen Sub-Investment-Manager innerhalb von 30 Geschäftstagen des Rücknahmedatums zahlbar. Festgestellte erfolgsabhängige Gebühren verbleiben in der betreffenden Klasse (partizipieren jedoch nicht an darauffolgenden Gewinnen und Verlusten der betreffenden Klasse), bis sie an den Manager oder einen Sub-Investment-Manager gezahlt werden, und werden nicht zur Bedienung von Rücknahmeanträgen oder zur Zahlung von Gebühren und Aufwendungen der betreffenden Klasse herangezogen oder zur Verfügung gestellt.

Die zur Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühr verwendete Methode für jedes betreffenden Portfolio gestaltet sich wie folgt:

**US Long Short Equity**

Der Manager hat unter Umständen Anspruch auf eine erfolgsabhängige Gebühr, die aus dem Portfoliovermögen in Bezug auf jede PF-Klasse des betreffenden Portfolios zahlbar ist.

Definitionen

|                               |  |
|-------------------------------|--|
| Berechnungszeitraum           | <p>Der Berechnungszeitraum geht normalerweise jährlich vom 1. Januar bis zum 31. Dezember, mit Ausnahme, dass:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• im Fall der Erstaussgabe von Anteilen in jeder PF-Klasse der erste Berechnungszeitraum vom Ausgabedatum bis zum 31. Dezember geht;</li> <li>• im Fall der Auflösung einer PF-Klasse der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet; und</li> <li>• im Fall der Auflösung des Managementvertrags während eines Jahres der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet.</li> </ul> <p>Der erste Wert, auf dessen Grundlage die erste erfolgsabhängige Gebühr für alle PF-Klassen ermittelt wird, ist der Erstangebotspreis.</p> |
| Festlegung (Kristallisierung) | <p>Der Punkt, an dem eine erfolgsabhängige Gebühr an den Manager zahlbar wird. Die Festlegung erfolgt entweder am Ende des Berechnungszeitraums oder an einem Handelstag, an dem ein Anteilhaber den gesamten oder einen Teil seines Anteilsbestands zurückgibt oder umtauscht.</p>  |
| High Water Mark (Höchstmarke) | <p>Ist entweder (i) der Erstangebotspreis je Anteil oder (ii) der NIW je Anteil am Ende des vorherigen Berechnungszeitraums, in Bezug auf den eine erfolgsabhängige Gebühr gezahlt wurde, je nachdem, welcher Wert höher ist.</p>  |

**FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR****6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)****Erfolgsabhängige Gebühren (Fortsetzung)**

*An den Manager und einen Sub-Investment-Manager gezahlte erfolgsabhängige Gebühr (Fortsetzung)*

**US Long Short Equity (Fortsetzung)**Methode

Für jeden Berechnungszeitraum wird eine erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf jede im Umlauf befindliche PF-Klasse fällig, wenn der NIW je Anteil am Ende des Berechnungszeitraums die High Water Mark für diese spezielle PF-Klasse übersteigt.

Die erfolgsabhängige Gebühr wird an jedem Handelstag berechnet und entspricht 15 % des Betrags, um den das prozentuale Wachstum im NIW je Anteil im Berechnungszeitraum das der High Water Mark übersteigt. Die erfolgsabhängige Gebühr läuft an jedem Handelstag auf und bildet Teil des NIW je Anteil für jede PF-Klasse, wo zutreffend. Jede an einem Handelstag aufgelaufene erfolgsabhängige Gebühr wird von einem am folgenden Handelstag erfolgten Zuwachs bis zum letzten Handelstag des Berechnungszeitraums ersetzt.

In allen Fällen erfolgte beim zur Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühr angewandten NIW je Anteil keine vorherige Verwässerungsanpassung, d. h. er enthält keine Swing-Pricing-Anpassung.

Eine erfolgsabhängige Gebühr wird erst gezahlt, wenn der NIW je Anteil die High Water Mark überschreitet, und derlei Gebühr wird nur bei einer Outperformance des über die Hurdle Rate (Mindestrendite) hinausgehenden NIW je Anteil, wie vorstehend beschrieben, zahlbar.

Anteilinhaber werden darauf hingewiesen, dass die erfolgsabhängige Gebühr auf Anteilklassenebene und nicht auf Ebene des individuellen Anteilinhabers berechnet wird und ihnen daher eine erfolgsabhängige Gebühr in Rechnung gestellt werden kann, auch wenn der NIW ihrer Anteile gleichgeblieben oder zurückgegangen ist. Dies ist unter Umständen der Fall, wenn Anteilinhaber Anteile zu einem Zeitpunkt kaufen oder verkaufen, bei dem es sich nicht um den Beginn oder das Ende des Berechnungszeitraums handelt.

Die erfolgsabhängige Gebühr läuft an jedem Handelstag im NIW auf und ist gewöhnlich an den Manager rückwirkend innerhalb von 30 Geschäftstagen am Ende eines jeden Berechnungszeitraums zu zahlen. Im Falle von während des Berechnungszeitraums zurückgenommenen Anteilen ist die aufgelaufene erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf diese Anteile jedoch an den Manager innerhalb von 30 Geschäftstagen des Rücknahmedatums zahlbar.

Festgestellte erfolgsabhängige Gebühren verbleiben in der betreffenden PF-Klasse (partizipieren jedoch nicht an darauffolgenden Gewinnen und Verlusten der betreffenden Klasse), bis sie an den Manager gezahlt werden, und werden nicht zur Bedienung von Rücknahmeanträgen oder zur Zahlung von Gebühren und Aufwendungen der betreffenden PF-Klasse herangezogen oder zur Verfügung gestellt.

Die Verwahrstelle überprüft die Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühr.

Die Direktoren können mit Zustimmung des Managers die erfolgsabhängige Gebühr, die von einer PF-Klasse zu zahlen ist, reduzieren. Erfolgsabhängige Gebühren fallen auf realisierte und nicht realisierte Kapitalerträge (zur Klarstellung: einschließlich Anlageerträgen) unter Berücksichtigung der realisierten und nicht realisierten Verluste zum Ende des Berechnungszeitraums an. Daher können erfolgsabhängige Gebühren auf nicht realisierte Gewinne gezahlt werden, die in der Folge niemals realisiert werden.

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024 verdiente der Manager eine erfolgsabhängige Gebühr in Höhe von 381.344 US\$ (31. Dezember 2023: 284.324 US\$).

**FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR**

**6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)**

**Erfolgsabhängige Gebühren (Fortsetzung)**

An den Manager und einen Sub-Investment-Manager gezahlte erfolgsabhängige Gebühr (Fortsetzung)

**Global High Yield Engagement**

Der Manager hat unter Umständen Anspruch auf eine erfolgsabhängige Gebühr, die aus dem Portfoliovermögen in Bezug auf jede PF-Klasse des betreffenden Portfolios zahlbar ist.

Definitionen

|                               |   |
|-------------------------------|---|
| Benchmark                     | ICE BofA Global High Yield Constrained Index in der entsprechenden Klassenwährung (wie nachstehend beschrieben)   |
| Berechnungszeitraum           | <p>Der Berechnungszeitraum geht normalerweise jährlich vom 1. Januar bis zum 31. Dezember, mit Ausnahme, dass:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• im Fall der Erstausgabe von Anteilen in jeder PF-Klasse der erste Berechnungszeitraum vom Ausgabedatum bis zum 31. Dezember geht;</li> <li>• im Fall der Auflösung einer PF-Klasse der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet; und</li> <li>• im Fall der Auflösung des Managementvertrags während eines Jahres der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet.</li> </ul> <p>Der erste Wert, auf dessen Grundlage die erste erfolgsabhängige Gebühr für alle PF-Klassen ermittelt wird, ist der Erstangebotspreis.</p> |
| Festlegung (Kristallisierung) | Der Punkt, an dem eine erfolgsabhängige Gebühr an den Manager zahlbar wird. Die Festlegung erfolgt entweder am Ende des Berechnungszeitraums oder an einem Handelstag, an dem ein Anteilinhaber den gesamten oder einen Teil seines Anteilsbestands zurückgibt oder umwandelt.  |
| Outperformance                | Die überdurchschnittlich positive Entwicklung des NIW je Anteil über der Performance der Benchmark im Berechnungszeitraum.  |

Methode

Für jeden Berechnungszeitraum wird eine erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf jede im Umlauf befindliche PF-Klasse bei einer Outperformance, d. h. einer überdurchschnittlich positiven Entwicklung des NIW je Anteil gegenüber der Performance der für diese spezielle PF-Klasse im Berechnungszeitraum geltenden Benchmark, fällig. Die prozentuale Gebühr wird an jedem Handelstag berechnet und entspricht 20 % der für diese spezielle PF-Klasse im selben Zeitraum geltenden Outperformance.

In allen Fällen erfolgte beim zur Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühr angewandten NIW je Anteil keine vorherige Verwässerungsanpassung, d. h. er enthält keine Swing-Pricing-Anpassung.

Für den Fall, dass die Performance einer PF-Klasse über einen Berechnungszeitraum geringer ist als die der Benchmark, fällt in Bezug auf diese PF-Klasse keine erfolgsabhängige Gebühr an, bis eine solche kumulative Underperformance gegenüber ihrer Benchmark hereingeholt wurde.

Im Fall, dass die PF-Klasse eine Outperformance in einem Berechnungszeitraum erzielt hat, wird eine erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf diese PF-Klasse zahlbar. Nach der Zahlung wird die Benchmark angepasst, dieser Prozess gewährleistet, dass der NIW je Anteil und die Benchmark zu Beginn des Berechnungszeitraums von derselben Stelle ausgehen. Folglich entspricht der anfängliche Benchmark-Wert für den nächsten Berechnungszeitraum dem NIW in Bezug auf die PF-Klasse, für die die erfolgsabhängige Gebühr gezahlt wurde, d. h., wenn der NIW 110 entsprechen würde, läge der Benchmark-Wert ebenfalls bei 110.

## FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

## Erfolgsabhängige Gebühren (Fortsetzung)

An den Manager und einen Sub-Investment-Manager gezahlte erfolgsabhängige Gebühr (Fortsetzung)

## Global High Yield Engagement (Fortsetzung)

## Benchmarkindizes

| Klassen                     | Index   | Code                         |
|-----------------------------|---|------------------------------|
| USD PF-Klassen:             | ICE BofA Global High Yield Constrained Index                      | HW0C ausgewählte Währung USD |
| Abgesicherte PF-Klassen EUR | ICE BofA Global High Yield Constrained Index – in EUR abgesichert | HW0C ausgewählte Währung EUR |
| Abgesicherte PF-Klassen GBP | ICE BofA Global High Yield Constrained Index – in GBP abgesichert | HW0C ausgewählte Währung GBP |

Anteilinhaber werden darauf hingewiesen, dass im Falle einer zahlbaren erfolgsabhängigen Gebühr auf die Outperformance gegenüber der Benchmark ihnen auch dann eine erfolgsabhängige Gebühr in Rechnung gestellt wird, wenn der NIW ihrer Anteile zurückgegangen ist, allerdings in einem geringeren Ausmaß als die Benchmark.

Anteilinhaber werden darauf hingewiesen, dass die erfolgsabhängige Gebühr auf Anteilklassenebene und nicht auf Ebene des individuellen Anteilinhabers berechnet wird und ihnen daher eine erfolgsabhängige Gebühr in Rechnung gestellt werden kann, auch wenn der NIW ihrer Anteile gleichgeblieben oder zurückgegangen ist. Dies ist unter Umständen der Fall, wenn Anteilinhaber Anteile zu einem Zeitpunkt kaufen oder verkaufen, bei dem es sich nicht um den Beginn oder das Ende eines Berechnungszeitraums handelt.

Die erfolgsabhängige Gebühr läuft an jedem Handelstag im NIW auf und ist gewöhnlich an den Manager rückwirkend innerhalb von 30 Geschäftstagen am Ende eines jeden Berechnungszeitraums zu zahlen. Im Falle von während des Berechnungszeitraums zurückgenommenen Anteilen ist die aufgelaufene erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf diese Anteile jedoch an den Manager innerhalb von 30 Geschäftstagen des Rücknahmedatums zahlbar.

Festgestellte erfolgsabhängige Gebühren verbleiben in der betreffenden PF-Klasse (partizipieren jedoch nicht an darauffolgenden Gewinnen und Verlusten der betreffenden Klasse), bis sie an den Manager gezahlt werden, und werden nicht zur Bedienung von Rücknahmeanträgen oder zur Zahlung von Gebühren und Aufwendungen der betreffenden PF-Klasse herangezogen oder zur Verfügung gestellt.

Die Verwahrstelle überprüft die Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühr.

Die Direktoren können mit Zustimmung des Managers die erfolgsabhängige Gebühr, die von einer PF-Klasse zu zahlen ist, reduzieren. Erfolgsabhängige Gebühren fallen auf realisierte und nicht realisierte Kapitalerträge (zur Klarstellung: einschließlich Anlageerträgen) unter Berücksichtigung der realisierten und nicht realisierten Verluste zum Ende des Berechnungszeitraums an. Daher können erfolgsabhängige Gebühren auf nicht realisierte Gewinne gezahlt werden, die in der Folge niemals realisiert werden.

Für die Geschäftsjahre zum 31. Dezember 2024 und 31. Dezember 2023 wurden vom Portfolio keine erfolgsabhängigen Gebühren an den Manager gezahlt.

## Event Driven

Der Manager hat unter Umständen Anspruch auf eine erfolgsabhängige Gebühr, die aus dem Portfoliovermögen in Bezug auf jede PF-Klasse des betreffenden Portfolios zahlbar ist. Alle Anteilkassen im Portfolio sind PF-Klassen.

**FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR**

**6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)**

**Erfolgsabhängige Gebühren (Fortsetzung)**

*An den Manager und einen Sub-Investment-Manager gezahlte erfolgsabhängige Gebühr (Fortsetzung)*

**Event Driven (Fortsetzung)**

Definitionen

|                               |   |
|-------------------------------|---|
| Berechnungszeitraum           | <p>Der Berechnungszeitraum geht normalerweise jährlich vom 1. Januar bis zum 31. Dezember, mit Ausnahme, dass:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• im Fall der Erstausgabe von Anteilen in jeder PF-Klasse der erste Berechnungszeitraum vom Ausgabedatum bis zum 31. Dezember geht;</li> <li>• im Fall der Auflösung einer PF-Klasse der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet; und</li> <li>• im Fall der Auflösung des Managementvertrags während eines Jahres der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet.</li> </ul> <p>Der erste Wert, auf dessen Grundlage die erste erfolgsabhängige Gebühr für alle PF-Klassen ermittelt wird, ist der Erstangebotspreis.</p> |
| Festlegung (Kristallisierung) | <p>Der Punkt, an dem eine erfolgsabhängige Gebühr an den Manager zahlbar wird. Die Festlegung erfolgt entweder am Ende des Berechnungszeitraums oder an einem Handelstag, an dem ein Anteilinhaber den gesamten oder einen Teil seines Anteilsbestands zurückgibt oder umtauscht.</p>   |
| High Water Mark (Höchstmarke) | <p>Ist entweder (i) der Erstangebotspreis je Anteil oder (ii) der NIW je Anteil am Ende des vorherigen Berechnungszeitraums, in Bezug auf den eine erfolgsabhängige Gebühr gezahlt wurde, je nachdem, welcher Wert höher ist.</p>   |

Methode

Für jeden Berechnungszeitraum wird eine erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf jede im Umlauf befindliche PF-Klasse fällig, wenn der NIW je Anteil am Ende des Berechnungszeitraums die High Water Mark (nach Abzug aller Kosten vor dem Abzug einer aufgelaufenen erfolgsabhängigen Gebühr, sofern dies im besten Interesse des Anteilinhabers liegt) für diese spezielle PF-Klasse übersteigt.

Die erfolgsabhängige Gebühr wird an jedem Handelstag berechnet und entspricht 15 % des Betrags, um den das prozentuale Wachstum im Nettoinventarwert je Anteil im Berechnungszeitraum das der High Water Mark übersteigt, mit Ausnahme der Klassen I5, für die die erfolgsabhängige Gebühr 15 % des Betrags, um den das prozentuale Wachstum im Nettoinventarwert je Anteil im Berechnungszeitraum das der High Water Mark übersteigt, entspricht.

Die erfolgsabhängige Gebühr läuft an jedem Handelstag auf und bildet Teil des Nettoinventarwerts je Anteil für jede PF-Klasse, wo zutreffend. Jede an einem Handelstag aufgelaufene erfolgsabhängige Gebühr wird von einem am folgenden Handelstag erfolgten Zuwachs bis zum letzten Handelstag des Berechnungszeitraums ersetzt.

In allen Fällen erfolgte beim zur Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühr angewandten Nettoinventarwert je Anteil keine vorherige Verwässerungsanpassung, d. h. er enthält keine Swing-Pricing-Anpassung.

Es wird keine erfolgsabhängige Gebühr gezahlt, wenn der Nettoinventarwert je Anteil die High Water Mark überschreitet, und derlei Gebühr wird nur bei einer Outperformance des über die High Water Mark hinausgehenden Nettoinventarwerts je Anteil, wie vorstehend beschrieben, zahlbar.

Anteilinhaber werden darauf hingewiesen, dass die erfolgsabhängige Gebühr auf Anteilklassenebene und nicht auf Ebene des individuellen Anteilinhabers berechnet wird und ihnen daher unter Umständen eine erfolgsabhängige Gebühr in Rechnung gestellt wird, selbst wenn der Nettoinventarwert ihrer Anteile gleich geblieben oder zurückgegangen ist, zum Beispiel, wenn Anteilinhaber Anteile zu einem Zeitpunkt kaufen oder verkaufen, bei dem es sich nicht um den Beginn oder das Ende des Berechnungszeitraums handelt.

**FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR****6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)****Erfolgsabhängige Gebühren (Fortsetzung)**

An den Manager und einen Sub-Investment-Manager gezahlte erfolgsabhängige Gebühr (Fortsetzung)

**Event Driven (Fortsetzung)**Methode (Fortsetzung)

Die erfolgsabhängige Gebühr läuft an jedem Handelstag im Nettoinventarwert auf und ist gewöhnlich an den Manager rückwirkend innerhalb von 30 Geschäftstagen am Ende eines jeden Berechnungszeitraums zu zahlen. Im Falle von während des Berechnungszeitraums zurückgenommenen Anteilen ist die aufgelaufene erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf diese Anteile jedoch an den Manager innerhalb von 30 Geschäftstagen des Rücknahmedatums zahlbar.

Festgestellte erfolgsabhängige Gebühren verbleiben in der betreffenden PF-Klasse (partizipieren jedoch nicht an darauffolgenden Gewinnen und Verlusten der betreffenden Klasse), bis sie an den Manager gezahlt werden, und werden nicht zur Bedienung von Rücknahmeanträgen oder zur Zahlung von Gebühren und Aufwendungen der betreffenden PF-Klasse herangezogen oder zur Verfügung gestellt.

Die Verwahrstelle prüft die Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühr und stellt sicher, dass sie nicht manipuliert werden kann.

Die Direktoren können mit Zustimmung des Managers die erfolgsabhängige Gebühr, die von einer PF-Klasse zu zahlen ist, reduzieren. Erfolgsabhängige Gebühren fallen auf realisierte und nicht realisierte Kapitalerträge (zur Klarstellung: einschließlich Anlageerträgen) unter Berücksichtigung der realisierten und nicht realisierten Verluste zum Ende des Berechnungszeitraums an. Daher können erfolgsabhängige Gebühren auf nicht realisierte Gewinne gezahlt werden, die in der Folge niemals realisiert werden.

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024 verdiente der Manager eine erfolgsabhängige Gebühr in Höhe von 3.671.667 US\$ (31. Dezember 2023: 1.269.230 US\$).

**Tactical Macro**

Der Sub-Investment-Manager hat unter Umständen Anspruch auf eine erfolgsabhängige Gebühr, die aus dem Portfoliovermögen in Bezug auf jede PF-Klasse des betreffenden Portfolios zahlbar ist. Alle Anteilkassen im Portfolio sind PF-Klassen.

Definitionen

|                               |  |
|-------------------------------|--|
| Berechnungszeitraum           | <p>Der Berechnungszeitraum geht normalerweise jährlich vom 1. Januar bis zum 31. Dezember, mit Ausnahme, dass:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>im Fall der Erstausgabe von Anteilen in jeder Klasse der erste Berechnungszeitraum vom Ausgabedatum bis zum 31. Dezember des folgenden Jahres geht;</li> <li>im Fall der Auflösung einer Klasse der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet; und</li> <li>im Fall der Auflösung des Vertrags des Sub-Investment-Managers während eines Jahres, der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet.</li> </ul> |
| Festlegung (Kristallisierung) | <p>Der Punkt, an dem eine erfolgsabhängige Gebühr an den Sub-Investment-Manager zahlbar wird. Die Festlegung erfolgt entweder (i) am Ende des Berechnungszeitraums, (ii) bei Beendigung der Bestellung des Sub-Investment-Managers oder (iii) an einem Handelstag, an dem ein Anteilinhaber den gesamten oder einen Teil seines Anteilsbestands zurückgibt oder umtauscht.</p>   |
| Outperformance                | <p>Die überdurchschnittlich positive Entwicklung des Nettoinventarwerts je Anteil über der Performance der Benchmark im Berechnungszeitraum.</p>   |

**FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR**

**6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)**

**Erfolgsabhängige Gebühren (Fortsetzung)**

*An den Manager und einen Sub-Investment-Manager gezahlte erfolgsabhängige Gebühr (Fortsetzung)*

**Tactical Macro (Fortsetzung)**

Benchmarkindizes

| Klassen                  | Index   |
|--------------------------|---|
| USD-Klassen              | ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return, USD)         |
| Abgesicherte Klassen EUR | ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return - EUR Hedged) |
| Abgesicherte Klassen GBP | ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return - GBP Hedged) |
| Abgesicherte Klassen CHF | ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return - CHF Hedged) |
| Abgesicherte Klassen JPY | ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return - JPY Hedged) |

Die Benchmark ist ein weit verbreiteter Richtwert für kurzfristige Zinssätze, der einen Anhaltspunkt für die Durchschnittskurse liefert, zu denen Banken für bestimmte Zeiträume in bestimmten Währungen ungesicherte Interbankkredite aufnehmen können.

Für Klassen, die in anderen als die oben genannten Währungen denominated sind, wird der ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return, USD) die Benchmark sein. Der Index ist gegenüber der jeweiligen Klassenwährung abgesichert und stellt für die Anleger dieser Klassen eine besser geeignete Vergleichsgröße dar.

Methode

Für jeden Berechnungszeitraum wird bzgl. jeder ausgegebenen Klasse eine erfolgsabhängige Gebühr für eine Outperformance fällig, d. h. die überdurchschnittlich positive Wertentwicklung des Nettoinventarwerts je Anteil (nach Abzug aller Kosten vor dem Abzug einer aufgelaufenen erfolgsabhängigen Gebühr, sofern dies im besten Interesse des Anteilinhabers liegt) gegenüber der Wertentwicklung der für die jeweilige Klasse geltenden Benchmark während des Berechnungszeitraums. Die erfolgsabhängige Gebühr wird an jedem Handelstag berechnet und entspricht bis zu 20 % der für diese spezielle Klasse im selben Zeitraum geltenden Outperformance.

Für den Fall, dass die Performance einer Klasse über einen Berechnungszeitraum geringer ist als die der Benchmark, fällt in Bezug auf diese Klasse keine erfolgsabhängige Gebühr an, bis eine solche kumulative Underperformance gegenüber ihrer Benchmark hereingeholt wurde.

Im Fall, dass die Klasse eine Outperformance in einem Berechnungszeitraum erzielt hat, wird eine erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf diese Klasse zahlbar. Nach der Zahlung wird die Benchmark angepasst, dieser Prozess gewährleistet, dass der Nettoinventarwert je Anteil und die Benchmark zu Beginn des Berechnungszeitraums von derselben Stelle ausgehen. Folglich entspricht der anfängliche Benchmarkwert für den nächsten Berechnungszeitraum dem Nettoinventarwert in Bezug auf die Klasse, für die die erfolgsabhängige Gebühr gezahlt wurde, d. h. wenn der Nettoinventarwert am Ende eines Berechnungszeitraums, in dem eine erfolgsabhängige Gebühr gezahlt wurde, 110 betragen würde, würde der Benchmarkwert zu Beginn des folgenden Berechnungszeitraums ebenfalls 110 betragen.

Anteilinhaber werden darauf hingewiesen, dass im Falle einer zahlbaren erfolgsabhängigen Gebühr auf die Outperformance gegenüber der Benchmark ihnen auch dann eine erfolgsabhängige Gebühr in Rechnung gestellt wird, wenn der Nettoinventarwert je Anteil zurückgegangen ist, allerdings in einem geringeren Ausmaß als die Benchmark.

Anteilinhaber werden darauf hingewiesen, dass die erfolgsabhängige Gebühr auf Anteilklassenebene und nicht auf Ebene des individuellen Anteilinhabers berechnet wird, und da in Bezug auf die erfolgsabhängige Gebühr kein Series Accounting Anwendung findet ihnen daher unter Umständen eine erfolgsabhängige Gebühr in Rechnung gestellt wird, selbst wenn der Nettoinventarwert ihrer Anteile gleich geblieben oder zurückgegangen ist, zum Beispiel, wenn Anteilinhaber Anteile zu einem Zeitpunkt kaufen oder verkaufen, bei dem es sich nicht um den Beginn oder das Ende des Berechnungszeitraums handelt.

Die erfolgsabhängige Gebühr wird täglich zu jedem Bewertungszeitpunkt ermittelt und läuft zu diesem auf. Die erfolgsabhängige Gebühr wird auf den nicht für eine Verwässerungsgebühr angepassten Nettoinventarwert je Anteil berechnet, d. h. bevor eine Swing-Pricing-Anpassung erfolgte (weitere Informationen in Bezug auf „Swing Pricing“ sind im Abschnitt „Ermittlung des Nettoinventarwerts – Bewertungsanpassungen und Swing Pricing“ des Verkaufsprospekts enthalten).

Die erfolgsabhängige Gebühr wird gewöhnlich rückwirkend innerhalb von 30 Geschäftstagen nach dem 31. Dezember jeden Jahres an den Sub-Investment-Manager gezahlt. Für den Fall der Feststellung einer erfolgsabhängigen Gebühr während eines Berechnungszeitraums wird die aufgelaufene erfolgsabhängige Gebühr für solche Beträge innerhalb von 30 Geschäftstagen nach Ende des Kalenderquartals zahlbar, in dem die Feststellung erfolgte.

**FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR****6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)****Erfolgsabhängige Gebühren (Fortsetzung)**

*An den Manager und einen Sub-Investment-Manager gezahlte erfolgsabhängige Gebühr (Fortsetzung)*

**Tactical Macro (Fortsetzung)**Methode (Fortsetzung)

Festgestellte erfolgsabhängige Gebühren verbleiben im Portfolio, bis sie an den Sub-Investment-Manager gezahlt werden, und partizipieren nicht an darauffolgenden Gewinnen oder Verlusten des Portfolios. Festgestellte erfolgsabhängige Gebühren werden nicht zur Bedienung von Rücknahmeanträgen oder zur Zahlung von Gebühren und Aufwendungen des Portfolios oder des Fonds (außer den an den Sub-Investment-Manager zahlbaren Gebühren) herangezogen oder zu Verfügung gestellt.

Die Verwahrstelle prüft die Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühr und stellt sicher, dass sie nicht manipuliert werden kann.

Erfolgsabhängige Gebühren fallen auf realisierte und nicht realisierte Kapitalerträge (zur Klarstellung: einschließlich Anlageerträgen) unter Berücksichtigung der realisierten und nicht realisierten Verluste zum Ende des Berechnungszeitraums an. Daher können erfolgsabhängige Gebühren auf nicht realisierte Gewinne gezahlt werden, die in der Folge niemals realisiert werden.

Für die am 31. Dezember 2024 und am 31. Dezember 2023 beendeten Geschäftsjahre wurden vom Portfolio keine erfolgsabhängigen Gebühren an den Sub-Investment-Manager gezahlt.

*Gebühren der Verwahrstelle*

Die Gesellschaft bezahlt der Verwahrstelle eine Gebühr für Treuhanddienstleistungen für jedes Portfolio die maximal 0,02 % pro Jahr des NIW des jeweiligen Portfolios beträgt und monatlich anfällt und monatlich rückwirkend zahlbar ist. Die Verwahrstelle hat auch Anspruch auf Erstattung von dem Fonds aus dem Portfoliosvermögen von Verwahrgebühren, Transaktionsgebühren und angemessenen Auslagen („Depotbankgebühren“), die zugunsten des Portfolios entstehen, einschließlich der Gebühren (die normale kommerzielle Sätze nicht übersteigen werden) und angemessener Auslagen von Unter-Depotbanken, die von der Verwahrstelle beauftragt werden.

**FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR**

**7. HONORARE UND AUFWENDUNGEN DER DIREKTOREN**

Die Direktoren haben als Vergütung für ihre Dienste Anspruch auf ein Honorar, dessen Höhe von Zeit zu Zeit von den Direktoren festgelegt wird, wobei der an einen Direktor jährlich in Bezug auf den Fonds zu zahlende Betrag der Vergütung 75.000 EUR (oder 85.000 EUR im Falle eines Vorsitzenden des Fonds) oder einen anderen Betrag, den die Direktoren jeweils ggf. festlegen, nicht überschreiten wird. Die Direktoren sowie diese ggf. vertretende Direktoren haben Anspruch auf die Erstattung sämtlicher angemessener Reise-, Hotel- und anderer Kosten, die ihnen bei der Teilnahme an Sitzungen der Direktoren oder der Anteilinhaber oder anderen Versammlungen im Zusammenhang mit dem Geschäftsbetrieb des Fonds entstehen. Sämtliche auf die Honorare der Direktoren gezahlten Lohnsteuern sind in den Gesamtkosten enthalten. Keiner der Direktoren hat einen Dienstvertrag mit dem Fonds abgeschlossen, derartige Verträge sind auch nicht vorgesehen, und kein Direktor ist in der Unternehmensleitung des Fonds tätig. Die Direktoren, die zugleich Mitarbeiter von Neuberger Berman Europe Limited sind, erhalten für ihre Dienstleistungen als Direktoren der Gesellschaft kein Honorar.

Die Gesamtbezüge der Direktoren (einschließlich Spesen) für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024 betragen insgesamt 155.612 US\$ (31. Dezember 2023: 234.165 US\$), von denen 43.578 US\$ am Jahresende noch ausstanden (31. Dezember 2023: 19.272 US\$).

In dem am 31. Dezember 2024 beendeten Geschäftsjahr waren Michelle Green und Alex Duncan Direktoren und ebenfalls bei der Neuberger Berman Europe Limited („NBEL“), dem Sub-Investment-Manager und der Vertriebsstelle des Fonds, angestellt. Mit Wirkung vom 26. November 2024 trat Alex Duncan als Direktor des Fonds zurück. Frau Gráinne Alexander ist eine Direktorin der Neuberger Berman Asset Management Ireland Limited („NBAMIL“), dem Manager des Fonds. Michelle Green und Alex Duncan haben sich freiwillig bereit erklärt auf ihren Anspruch auf eine Vergütung in Hinblick auf ihre Pflichten als Direktoren für das zum 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr zu verzichten (31. Dezember 2023: ebenso).

Die Honorare der Direktoren werden vor Abzug der Einkommensteuer ausgewiesen. Von den Direktoren wurden keine Sachleistungen bezogen.

**8. VERGÜTUNG DER ABSCHLUSSPRÜFER**

Ernst & Young, Chartered Accountants haben für ihre im Geschäftsjahr geleistete Arbeit für den Fonds folgende Vergütung (ohne MwSt.) erhalten:

|  |                               | 31. Dezember 2024 | 31. Dezember 2023 |
|--|-------------------------------|-------------------|-------------------|
|  |                               | US\$              | US\$              |
| Gesetzliches Prüfungshonorar:            | - Ernst & Young (Irland):     | 505.121           | 481.925           |
| Sonstige Honorare ohne Prüfungshonorare: | - Ernst & Young (Österreich): | 134.074           | 130.939           |
|  | - Ernst & Young (Schweiz):    | 140.000           | 130.000           |

**9. SONSTIGE GEBÜHREN UND KOSTEN**

Die Transaktionskosten sind die beim Kauf, bei der Emission oder beim Verkauf von finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten anfallenden Kosten. Zu den Transaktionskosten gehören Gebühren und Provisionen für Makler und Händler, die an Aufsichtsbehörden und Börsen zahlbaren Gebühren und bei der Übertragung fällig werdenden Steuern und Abgaben. Die Transaktionskosten erstrecken sich nicht auf Auf- oder Abschläge auf Fremdkapitalanlagen, Finanzierungskosten oder interne Verwaltungs- bzw. Haltekosten. Diese Kosten werden verbucht, sobald sie anfallen und für die Zwecke der Finanzberichterstattung in der Gewinn- und Verlustrechnung als Aufwand erfasst.

Der Fonds und die Portfolios zahlen auch bestimmte sonstige Kosten, Gebühren, Honorare und Aufwendungen, die im Rahmen ihres Betriebs entstehen. Diese können insbesondere Gebühren und Kosten enthalten, die im Zusammenhang mit Bank- und Maklerdienstleistungen beim Kauf und Verkauf von Wertpapieren der Portfolios entstehen, Steuern, Versicherungen, die Kosten und Aufwendungen für die Buchführung und die Abfassung, den Druck, die Veröffentlichung und Verteilung der Verkaufsprospekte, Nachträge, Jahres- und Halbjahresberichte und sonstiger Dokumente und Informationen (in den jeweils notwendigen Sprachen) für bestehende oder potenzielle Anteilinhaber (einschließlich der Kosten für die Entwicklung und Verbesserung von Software und elektronischen Übertragungstechniken zur Verteilung dieser Dokumente oder Informationen), die Kosten für die Veröffentlichung von Preis- und Renditeinformationen in den relevanten Medien, die Kosten und Aufwendungen für das Einholen von Genehmigungen oder Registrierungen der Gesellschaft oder von Anteilen bei den Aufsichtsbehörden verschiedener Rechtsordnungen, einschließlich etwaiger von der Central Bank of Ireland erhobener Abgaben, die Kosten für die Notierung und Aufrechterhaltung der Notierung von Anteilen an einer Börse, Marketing- und Werbekosten, die Kosten für die Einberufung und Abhaltung der Versammlungen der Direktoren und der Anteilinhaber, die Kosten für die Ausübung der Stimmrechte im Zusammenhang mit der Anlage der Gesellschaft im besten Interesse der Anteilinhaber und die Honorare und Aufwendungen für Rechts-, Rechnungsprüfungs- und andere Beratungsleistungen, sämtliche Kosten, die durch die Auflösung oder Liquidierung der Gesellschaft entstehen, sowie alle weiteren Kosten und Aufwendungen (einmalige und außerordentliche Kosten und Aufwendungen eingeschlossen), die von Zeit zu Zeit entstehen und von den Direktoren als notwendig oder angemessen für den fortdauernden Geschäftsbetrieb der Gesellschaft oder eines Portfolios genehmigt wurden. Im Zusammenhang mit der Registrierung des Fonds oder der Anteile zum Verkauf in bestimmten Rechtsordnungen zahlt der Fonds die Gebühren und Kosten von Zahl- und Informationsstellen und/oder Korrespondenzbanken. Diese Zahlungen erfolgen zu marktüblichen Sätzen.

Der Manager begleicht alle Kosten für von ihm bezogenes Research direkt, ungeachtet der Bezugsquelle. Sub-Investment-Manager mit Sitz außerhalb der EU, die bezogenes Research nicht in die EU weiterleiten, können dem betreffenden Portfolio durch Bereitstellung eines jährlichen Research-Budgets für jedes Portfolio Research-Kosten in Rechnung stellen. Die Abgrenzungen für Research-Kosten für Uncorrelated Strategies für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr beliefen sich auf 1.808.526 USD (31. Dezember 2023: 4.979.140 US\$). Die Kostenabgrenzungen für Uncorrelated Trading für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr betragen USD 50.854.

## FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN

Gemäß FRS 102 „Transaktionen mit nahe stehenden Parteien“ gelten Parteien als nahe stehend, wenn eine Partei die Möglichkeit hat, die Kontrolle über die andere Partei auszuüben oder bei finanziellen oder betrieblichen Entscheidungen entscheidenden Einfluss auf die andere Partei auszuüben.

Michelle Green ist Direktorin des Fonds und ebenfalls Direktorin und Angestellte der NBEL, des Sub-Investment-Managers und der Vertriebsstelle des Fonds. Gráinne Alexander ist Direktorin von NBAMIL, der Manager der Gesellschaft.

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024 war Alex Duncan Direktor des Fonds und auch Direktor und Angestellter von NBEL. Mit Wirkung vom 26. November 2024 trat Alex Duncan als Direktor des Fonds zurück. Die von NBEL und NBAMIL in den Jahren zum 31. Dezember 2024 und zum 31. Dezember 2023 erhällichen Gebühren sind in der nachstehenden Tabelle aufgeführt. Nähere Angaben zu den in den zum 31. Dezember 2024 und 31. Dezember 2023 gezahlten Honoraren der Direktoren finden sich in Anmerkung 7.

| Managementgebühren, Gebühren der Verwaltungsstelle und erfolgsabhängige Gebühren*          | 31. Dezember 2024 | 31. Dezember 2023 |
|--|-------------------|-------------------|
|  | US\$              | US\$              |
| Von NBAMIL erhaltene Managementgebühren und Gebühren der Verwaltungsstelle, ohne Verzichte | 207.800.481       | 197.829.109       |
| Beratungsgebühren  | 7.705.554         | 17.684.684        |
| Kostenverzichte  | (2.245.492)       | (3.529.280)       |
| Verzicht auf Beratungsgebühren   | (9.406)           | (105.092)         |
| Ausstehende Managementgebühren   | 18.806.673        | 16.054.874        |
| Von NBAMIL erhaltene erfolgsabhängige Gebühren**   | 4.053.011         | 1.553.554         |

\*Weitere Informationen zu den Managementgebühren und erfolgsabhängigen Gebühren finden sich in Anmerkung 6.

\*\*Erfolgsabhängige Gebühren werden gewöhnlich rückwirkend innerhalb von 30 Geschäftstagen nach Ende des Berechnungszeitraums an den Manager gezahlt. Weitere Angaben siehe „Erfolgsabhängige Gebühren“ in Anmerkung 6.

Zum 31. Dezember 2024 und 31. Dezember 2023 hielten folgende Portfolios Anteile an anderen, von mit dem Manager verbundenen Unternehmen verwalteten Portfolios:

| Portfolio                             | Bestand*                            | Verwaltet von | 31. Dezember 2024 |            | 31. Dezember 2023 |            |
|---------------------------------------|-------------------------------------|---------------|-------------------|------------|-------------------|------------|
|                                       |                                     |               | Anteile           | Wert       | Anteile           | Wert       |
| Corporate Hybrid Bond                 | Global Investment Grade Credit      | NBAMIL        | 1.300.000         | 12.265.572 | 1.300.000         | 10.956.412 |
| Emerging Market Debt - Hard Currency  | Short Duration Euro Bond            | NBAMIL        | -                 | -          | 150.000           | 17.580.000 |
| Emerging Market Debt - Local Currency | China Bond                          | NBAMIL        | 370.676           | 4.040.368  | 1.595.000         | 16.173.300 |
| Emerging Market Debt Blend            | China Bond                          | NBAMIL        | 367.123           | 4.001.641  | 1.409.964         | 14.297.035 |
| Global Flexible Credit Income         | NB Global Monthly Income Fund Ltd** | NBEL          | 9.642             | 6.944      | 75.108            | 66.832     |
| Global Opportunistic Bond             | NB Global Monthly Income Fund Ltd** | NBEL          | 3.054             | 2.199      | 23.786            | 21.165     |
| High Yield Bond                       | NB Global Monthly Income Fund Ltd** | NBEL          | 520.942           | 375.146    | 4.058.488         | 3.611.285  |
| Short Duration Emerging Market Debt   | Short Duration Euro Bond            | NBAMIL        | -                 | -          | 425.000           | 49.810.000 |
| Short Duration Euro Bond              | Euro Bond                           | NBAMIL        | 1.410.000         | 14.805.000 | -                 | -          |
| Short Duration Euro Bond              | Euro Bond Absolute Return           | NBAMIL        | 1.810.000         | 19.149.800 | -                 | -          |
| Short Duration High Yield Engagement  | CLO Income                          | NBAMIL        | 303.860           | 5.086.623  | -                 | -          |
| Short Duration High Yield Engagement  | NB Global Monthly Income Fund Ltd** | NBEL          | 34.770            | 25.039     | 270.876           | 241.028    |
| Strategic Income                      | China Bond                          | NBAMIL        | 383.815           | 3.841.993  | 1.208.113         | 11.936.155 |

FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio (Fortsetzung) | Bestand*                            | Verwaltet von | 31. Dezember 2024 |            | 31. Dezember 2023 |            |
|-------------------------|-------------------------------------|---------------|-------------------|------------|-------------------|------------|
|                         |                                     |               | Anteile           | Wert       | Anteile           | Wert       |
| Strategic Income        | Euro Bond Absolute Return           | NBAMIL        | 760.691           | 10.109.588 | 760.691           | 9.158.724  |
| Strategic Income        | European High Yield Bond            | NBAMIL        | 486.855           | 7.137.293  | 486.855           | 6.382.668  |
| Strategic Income        | Global Flexible Credit Income       | NBAMIL        | 459.982           | 6.076.356  | 459.982           | 5.570.377  |
| Strategic Income        | Global High Yield Engagement        | NBAMIL        | 654.438           | 9.777.308  | 654.438           | 8.952.716  |
| Strategic Income        | Global Investment Grade Credit      | NBAMIL        | 2.000.000         | 19.540.000 | 2.000.000         | 18.620.000 |
| Strategic Income        | NB Global Monthly Income Fund Ltd** | NBEL          | 21.035            | 15.148     | 163.871           | 145.814    |

\*Zum 31. Dezember 2024 (ggf. 31. Dezember 2023) betrug die effektive Managementgebühr nach Ermäßigung(en) für jede der oben genannten Bestände in jedem Portfolio 0,00 %.

\*\* Die Managementgebühr für den NB Global Monthly Income Fund Ltd beträgt 0,75 %.

Der Manager gewährte den vorstehend genannten Portfolios im Zusammenhang mit ihren Anlagen einen Rabatt, so dass ihre effektiven Managementgebührensätze für die Anlagen 0,00 % betragen (31. Dezember 2023: gleich). Der von jedem Portfolio gewährte Gebührenverzicht wird unter „Verzicht auf Beratungsgebühren“ in den Gewinn- und Verlustrechnungen ausgewiesen.

Zum 31. Dezember 2024 und 31. Dezember 2023 wurden die Überkreuzinvestitionen zwischen den Portfolios der Gesellschaft vom konsolidierten Abschluss ausgeschlossen.

## FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

Den Direktoren sind mit Ausnahme der in diesem Jahresabschluss angegebenen keine Transaktionen mit nahe stehenden Parteien im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024 bekannt (31. Dezember 2023: ebenso).

Zum 31. Dezember 2024 und 31. Dezember 2023 hatten die folgenden Anteilinhaber, die als nahe stehende Parteien galten, folgende Anlagen im Fonds getätigt.

| Portfolio                        | Anteilklasse  | Anteilinhaber                             | 31. Dezember 2024<br>Anzahl der Anteile | 31. Dezember 2023<br>Anzahl der Anteile |
|----------------------------------|---|---|---|---|
| Asia Responsible Transition Bond | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)                | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 1.046                                   | -                                       |
| Asia Responsible Transition Bond | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)                | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | -                                       | 1.046                                   |
| Asia Responsible Transition Bond | Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich)               | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 1.000                                   | 1.000                                   |
| Asia Responsible Transition Bond | Thesaurierende Klasse USD I4                          | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 1.000                                   | 1.000                                   |
| Asia Responsible Transition Bond | Ausschüttende Klasse USD X (Monatlich)                | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 1.000                                   | 1.000                                   |
| Asia Responsible Transition Bond | Thesaurierende Klasse USD X                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 2.193                                   | 2.193                                   |
| Asia Responsible Transition Bond | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Neuberger Berman Asia Holdings LLC        | -                                       | 3.887.269                               |
| Asia Responsible Transition Bond | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd | 2.061.511                               | -                                       |
| Asia Responsible Transition Bond | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 302.527                                 | -                                       |
| Asia Responsible Transition Bond | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | -                                       | 1.004.281                               |
| Asia Responsible Transition Bond | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Neuberger Berman Group LLC                | -                                       | 848.201                                 |
| China A-Share Equity             | Thesaurierende Klasse CNY I                           | Neuberger Berman Asia Holdings LLC        | -                                       | 688                                     |
| China A-Share Equity             | Thesaurierende Klasse CNY I                           | Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd | 688                                     | -                                       |
| China A-Share Equity             | Thesaurierende Klasse CNY I                           | Mitarbeiter von Neuberger Berman          | 774                                     | 774                                     |
| China A-Share Equity             | Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Asia Holdings LLC        | -                                       | 1.000                                   |
| China A-Share Equity             | Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd | 1.000                                   | -                                       |
| China A-Share Equity             | Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) | Mitarbeiter von Neuberger Berman          | -                                       | 1.934                                   |
| China A-Share Equity             | Ausschüttende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)  | Neuberger Berman Asia Holdings LLC        | -                                       | 250.091                                 |
| China A-Share Equity             | Ausschüttende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)  | Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd | 250.091                                 | -                                       |
| China Bond                       | Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)                | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 1.993                                   | 1.993                                   |
| China Bond                       | Ausschüttende Klasse CNY I                            | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 2.347                                   | 2.347                                   |
| China Bond                       | Thesaurierende Klasse CNY Z                           | Mitarbeiter von Neuberger Berman          | 1.218                                   | 1.218                                   |

FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio           | Anteilklasse  | Anteilinhaber                             | 31. Dezember 2024<br>Anzahl der Anteile | 31. Dezember 2023<br>Anzahl der Anteile |
|---------------------|---|---|---|---|
| China Bond          | Thesaurierende Klasse CNY Z                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | -                                       | 614                                     |
| China Bond          | Thesaurierende Klasse GBP I2                          | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | -                                       | 2.176                                   |
| China Bond          | Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | -                                       | 1.003                                   |
| China Bond          | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Emerging Market Debt - Local Currency     | 370.676                                 | 1.595.000                               |
| China Bond          | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Emerging Market Debt Blend                | 367.123                                 | 1.409.964                               |
| China Bond          | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Multi-Asset Income                        | 0*                                      | 0*                                      |
| China Bond          | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Mitarbeiter von Neuberger Berman          | 40.000                                  | 40.000                                  |
| China Bond          | Thesaurierende Klasse USD Z (nicht währungsgesichert) | Mitarbeiter von Neuberger Berman          | 196                                     | 196                                     |
| China Bond          | Thesaurierende Klasse USD Z (nicht währungsgesichert) | Strategic Income                          | 383.815                                 | 1.208.113                               |
| China Equity        | Thesaurierende Klasse EUR Z                           | Mitarbeiter von Neuberger Berman          | 891                                     | 891                                     |
| China Equity        | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Mitarbeiter von Neuberger Berman          | 16.177                                  | 16.177                                  |
| Climate Innovation1 | Thesaurierende Klasse USD A                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 1.000                                   | 1.000                                   |
| Climate Innovation1 | Thesaurierende Klasse USD I                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 1.000                                   | 1.000                                   |
| Climate Innovation1 | Thesaurierende Klasse USD I5                          | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 1.000                                   | 1.000                                   |
| Climate Innovation1 | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 300.000                                 | -                                       |
| Climate Innovation1 | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | -                                       | 300.000                                 |
| CLO Income          | Thesaurierende Klasse EUR A                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 2.824                                   | 2.824                                   |
| CLO Income          | Thesaurierende Klasse GBP Z                           | Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd | 1.631                                   | -                                       |
| CLO Income          | Thesaurierende Klasse USD A                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 3.144                                   | 3.144                                   |
| CLO Income          | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Mitarbeiter von Neuberger Berman          | 86.773                                  | 51.167                                  |
| CLO Income          | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Short Duration High Yield Engagement      | 303.860                                 | -                                       |
| Commodities         | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | -                                       | 806                                     |
| Commodities         | Thesaurierende Klasse GBP I2                          | Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd | 2.363                                   | -                                       |
| Commodities         | Thesaurierende Klasse GBP P                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 2.349                                   | -                                       |
| Commodities         | Thesaurierende Klasse USD I                           | Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd | -                                       | 1.431                                   |

## FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio   | Anteilklasse                           | Anteilinhaber                             | 31. Dezember 2024  | 31. Dezember 2023  |
|---|--|---|--------------------|--------------------|
|   |  |   | Anzahl der Anteile | Anzahl der Anteile |
| Commodities   | Thesaurierende Klasse USD I3           | Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd | 1.000              | -                  |
| Commodities   | Thesaurierende Klasse USD Z            | Mitarbeiter von Neuberger Berman          | 12.574             | 15.263             |
| Corporate Hybrid Bond                               | Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | -                  | 1.390              |
| Corporate Hybrid Bond                               | Thesaurierende Klasse CHF I3           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 2.690              | -                  |
| Corporate Hybrid Bond                               | Thesaurierende Klasse EUR I            | Mitarbeiter von Neuberger Berman          | 15.690             | 15.690             |
| Corporate Hybrid Bond                               | Thesaurierende Klasse GBP I            | Mitarbeiter von Neuberger Berman          | 973                | 973                |
| Corporate Hybrid Bond                               | Ausschüttende Klasse USD A             | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 3.000              | 3.000              |
| Corporate Hybrid Bond                               | Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 3.000              | -                  |
| Corporate Hybrid Bond                               | Ausschüttende Klasse USD I             | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | -                  | 3.000              |
| Corporate Hybrid Bond                               | Ausschüttende Klasse USD I2            | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 1.128              | -                  |
| Corporate Hybrid Bond                               | Ausschüttende Klasse USD I2            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | -                  | 1.128              |
| Corporate Hybrid Bond                               | Thesaurierende Klasse USD Z            | Mitarbeiter von Neuberger Berman          | 34.810             | 33.729             |
| EMD Corporate – Social and Environmental Transition | Thesaurierende Klasse GBP I            | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 787                | -                  |
| EMD Corporate – Social and Environmental Transition | Thesaurierende Klasse GBP I            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | -                  | 787                |
| EMD Corporate – Social and Environmental Transition | Thesaurierende Klasse SEK A            | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 2.409              | -                  |
| EMD Corporate – Social and Environmental Transition | Thesaurierende Klasse SEK A            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | -                  | 2.409              |
| Emerging Market Debt - Hard Currency                | Thesaurierende Klasse CHF I2           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | -                  | 2.911              |
| Emerging Market Debt - Hard Currency                | Thesaurierende Klasse CHF P            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | -                  | 1.118              |
| Emerging Market Debt - Hard Currency                | Thesaurierende Klasse EUR I4           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 2.644              | 2.644              |
| Emerging Market Debt - Hard Currency                | Thesaurierende Klasse EUR Z            | Mitarbeiter von Neuberger Berman          | 71.279             | 59.506             |
| Emerging Market Debt - Hard Currency                | Ausschüttende Klasse USD A             | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | -                  | 1.000              |
| Emerging Market Debt - Hard Currency                | Thesaurierende Klasse USD Z            | Mitarbeiter von Neuberger Berman          | 5.318              | 9.752              |
| Emerging Market Debt - Local Currency               | Thesaurierende Klasse AUD B            | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 824                | -                  |
| Emerging Market Debt - Local Currency               | Thesaurierende Klasse AUD B            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | -                  | 824                |

FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio                             | Anteilklasse                           | Anteilinhaber   | 31. Dezember 2024<br>Anzahl der Anteile | 31. Dezember 2023<br>Anzahl der Anteile |
|---------------------------------------|--|---|---|---|
| Emerging Market Debt - Local Currency | Thesaurierende Klasse AUD C2           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                    | -                                       | 925                                     |
| Emerging Market Debt - Local Currency | Thesaurierende Klasse AUD E            | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                    | 1.494                                   | -                                       |
| Emerging Market Debt - Local Currency | Thesaurierende Klasse AUD E            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC                                    | -                                       | 1.494                                   |
| Emerging Market Debt - Local Currency | Thesaurierende Klasse AUD T            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC                                    | -                                       | 1.472                                   |
| Emerging Market Debt - Local Currency | Thesaurierende Klasse EUR I            | Mitarbeiter von Neuberger Berman  | 14.328                                  | 14.328                                  |
| Emerging Market Debt - Local Currency | Thesaurierende Klasse GBP I            | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                    | 1.011                                   | -                                       |
| Emerging Market Debt - Local Currency | Thesaurierende Klasse GBP I            | Mitarbeiter von Neuberger Berman  | 25.991                                  | 25.991                                  |
| Emerging Market Debt - Local Currency | Thesaurierende Klasse GBP I            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC                                    | -                                       | 1.011                                   |
| Emerging Market Debt - Local Currency | Thesaurierende Klasse SEK A            | Mitarbeiter von Neuberger Berman  | 11.535                                  | 11.535                                  |
| Emerging Market Debt - Local Currency | Thesaurierende Klasse USD B            | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                    | 1.000                                   | -                                       |
| Emerging Market Debt - Local Currency | Thesaurierende Klasse USD B            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC                                    | -                                       | 1.000                                   |
| Emerging Market Debt - Local Currency | Thesaurierende Klasse USD E            | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                    | 1.000                                   | -                                       |
| Emerging Market Debt - Local Currency | Thesaurierende Klasse USD E            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC                                    | -                                       | 1.000                                   |
| Emerging Market Debt - Local Currency | Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) | Bond-Plus Income & Growth Multi-Asset Class Securities Investment Trust | 1.147.176                               | 4.340.412                               |
| Emerging Market Debt - Local Currency | Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) | Neuberger Berman Global Strategic Income Securities Investment Trust    | 192.560                                 | 192.560                                 |
| Emerging Market Debt - Local Currency | Thesaurierende Klasse USD I5           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                    | 1.579                                   | -                                       |
| Emerging Market Debt - Local Currency | Thesaurierende Klasse USD I5           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC                                    | -                                       | 1.579                                   |
| Emerging Market Debt - Local Currency | Thesaurierende Klasse USD T            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC                                    | -                                       | 950                                     |
| Emerging Market Debt - Local Currency | Thesaurierende Klasse ZAR C2           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                    | -                                       | 1.596                                   |
| Emerging Market Debt - Local Currency | Thesaurierende Klasse ZAR E            | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                    | 855                                     | -                                       |
| Emerging Market Debt - Local Currency | Thesaurierende Klasse ZAR E            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC                                    | -                                       | 855                                     |
| Emerging Market Debt - Local Currency | Thesaurierende Klasse ZAR T            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC                                    | -                                       | 1.683                                   |
| Emerging Market Debt Blend            | Ausschüttende Klasse EUR I3            | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                    | 3.000                                   | -                                       |

## FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio   | Anteilklasse  | Anteilinhaber                        | 31. Dezember 2024<br>Anzahl der Anteile | 31. Dezember 2023<br>Anzahl der Anteile |
|---|---|--------------------------------------|---|---|
| Emerging Market Debt Blend                              | Ausschüttende Klasse EUR I3                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                                       | 3.000                                   |
| Emerging Market Debt Blend                              | Thesaurierende Klasse EUR Z                           | Mitarbeiter von Neuberger Berman     | 18.544                                  | 13.085                                  |
| Emerging Market Debt Blend                              | Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)  | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 746                                     | -                                       |
| Emerging Market Debt Blend                              | Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)  | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                                       | 746                                     |
| Emerging Market Debt Blend                              | Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 772                                     | 772                                     |
| Emerging Market Debt Blend                              | Thesaurierende Klasse GBP Z                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.876                                   | -                                       |
| Emerging Market Debt Blend                              | Thesaurierende Klasse NOK U                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.286                                   | 2.286                                   |
| Emerging Market Debt Blend                              | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)                | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                                       | 699                                     |
| Emerging Market Debt Blend                              | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)                | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                                       | 1.025                                   |
| Emerging Market Debt Blend                              | Ausschüttende Klasse USD I                            | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 9                                       | -                                       |
| Emerging Market Debt Blend                              | Ausschüttende Klasse USD I                            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                                       | 9                                       |
| Emerging Market Debt Blend                              | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Mitarbeiter von Neuberger Berman     | 8.827                                   | 9.460                                   |
| Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend | Thesaurierende Klasse NOK I                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 808                                     | -                                       |
| Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend | Thesaurierende Klasse NOK I                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                                       | 808                                     |
| Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend | Thesaurierende Klasse NOK I3                          | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 3.219                                   | -                                       |
| Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend | Thesaurierende Klasse NOK I3                          | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                                       | 3.219                                   |
| Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend | Thesaurierende Klasse USD I                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.648                                   | -                                       |
| Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 325                                     | -                                       |
| Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Mitarbeiter von Neuberger Berman     | 81                                      | 81                                      |
| Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                                       | 155.674                                 |
| Emerging Markets Equity                                 | Thesaurierende Klasse AUD B                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.356                                   | -                                       |
| Emerging Markets Equity                                 | Thesaurierende Klasse AUD B                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                                       | 1.356                                   |
| Emerging Markets Equity                                 | Thesaurierende Klasse AUD C2                          | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                                       | 1.575                                   |
| Emerging Markets Equity                                 | Thesaurierende Klasse AUD E                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.356                                   | -                                       |

FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio                 | Anteilklasse   | Anteilinhaber                             | 31. Dezember 2024<br>Anzahl der Anteile | 31. Dezember 2023<br>Anzahl der Anteile |
|---------------------------|--|---|---|---|
| Emerging Markets Equity   | Thesaurierende Klasse AUD E                          | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | -                                       | 1.356                                   |
| Emerging Markets Equity   | Thesaurierende Klasse AUD T                          | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | -                                       | 2.662                                   |
| Emerging Markets Equity   | Ausschüttende Klasse CAD I (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 8.283                                   | 8.283                                   |
| Emerging Markets Equity   | Thesaurierende Klasse EUR M                          | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 901                                     | -                                       |
| Emerging Markets Equity   | Thesaurierende Klasse EUR M                          | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | -                                       | 901                                     |
| Emerging Markets Equity   | Thesaurierende Klasse EUR Z                          | Mitarbeiter von Neuberger Berman          | 22.279                                  | 22.279                                  |
| Emerging Markets Equity   | Thesaurierende Klasse GBP Z                          | Mitarbeiter von Neuberger Berman          | -                                       | 800                                     |
| Emerging Markets Equity   | Thesaurierende Klasse USD C2                         | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | -                                       | 967                                     |
| Emerging Markets Equity   | Thesaurierende Klasse USD T                          | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | -                                       | 670                                     |
| Emerging Markets Equity   | Thesaurierende Klasse USD Z                          | Mitarbeiter von Neuberger Berman          | 19.050                                  | 22.606                                  |
| Emerging Markets Equity   | Thesaurierende Klasse ZAR B                          | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 1.410                                   | -                                       |
| Emerging Markets Equity   | Thesaurierende Klasse ZAR B                          | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | -                                       | 1.410                                   |
| Emerging Markets Equity   | Thesaurierende Klasse ZAR E                          | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 1.410                                   | -                                       |
| Emerging Markets Equity   | Thesaurierende Klasse ZAR E                          | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | -                                       | 1.410                                   |
| Emerging Markets Equity   | Thesaurierende Klasse ZAR T                          | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | -                                       | 2.765                                   |
| Euro Bond                 | Thesaurierende Klasse EUR A                          | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 2.695                                   | -                                       |
| Euro Bond                 | Thesaurierende Klasse EUR I                          | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | -                                       | 3.000                                   |
| Euro Bond                 | Ausschüttende Klasse EUR I                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 978.926                                 | -                                       |
| Euro Bond                 | Ausschüttende Klasse EUR I                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | -                                       | 978.926                                 |
| Euro Bond                 | Thesaurierende Klasse EUR M                          | Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd | 963                                     | -                                       |
| Euro Bond                 | Thesaurierende Klasse EUR Z                          | Short Duration Euro Bond                  | 1.410.000                               | -                                       |
| Euro Bond Absolute Return | Thesaurierende Klasse EUR A                          | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 962                                     | -                                       |
| Euro Bond Absolute Return | Thesaurierende Klasse EUR I                          | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 28.155                                  | -                                       |
| Euro Bond Absolute Return | Thesaurierende Klasse EUR I                          | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | -                                       | 28.155                                  |

## FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio                   | Anteilklasse                | Anteilinhaber                             | 31. Dezember 2024<br>Anzahl der Anteile | 31. Dezember 2023<br>Anzahl der Anteile |
|-----------------------------|-----------------------------|---|---|---|
| Euro Bond Absolute Return   | Ausschüttende Klasse EUR I  | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 930                                     | 930                                     |
| Euro Bond Absolute Return   | Thesaurierende Klasse EUR Z | Mitarbeiter von Neuberger Berman          | 2.000                                   | -                                       |
| Euro Bond Absolute Return   | Thesaurierende Klasse EUR Z | Short Duration Euro Bond                  | 1.810.000                               | -                                       |
| Euro Bond Absolute Return   | Thesaurierende Klasse USD Z | Neuberger Berman Asia Holdings LLC        | -                                       | 247.390                                 |
| Euro Bond Absolute Return   | Thesaurierende Klasse USD Z | Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd | 247.390                                 | -                                       |
| Euro Bond Absolute Return   | Thesaurierende Klasse USD Z | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 1.146.064                               | -                                       |
| Euro Bond Absolute Return   | Thesaurierende Klasse USD Z | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | -                                       | 1.146.064                               |
| Euro Bond Absolute Return   | Thesaurierende Klasse USD Z | Strategic Income                          | 760.691                                 | 760.691                                 |
| European High Yield Bond    | Thesaurierende Klasse EUR I | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | -                                       | 1.947                                   |
| European High Yield Bond    | Thesaurierende Klasse EUR X | Mitarbeiter von Neuberger Berman          | 16.919                                  | 13.224                                  |
| European High Yield Bond    | Thesaurierende Klasse USD X | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 3.639                                   | -                                       |
| European High Yield Bond    | Thesaurierende Klasse USD X | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | -                                       | 3.639                                   |
| European High Yield Bond    | Thesaurierende Klasse USD Z | Mitarbeiter von Neuberger Berman          | 8.937                                   | 386                                     |
| European High Yield Bond    | Thesaurierende Klasse USD Z | Strategic Income                          | 486.855                                 | 486.855                                 |
| European Sustainable Equity | Ausschüttende Klasse EUR A  | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 2.627                                   | 2.627                                   |
| European Sustainable Equity | Thesaurierende Klasse EUR I | Neuberger Berman Asia Holdings LLC        | -                                       | 825                                     |
| European Sustainable Equity | Thesaurierende Klasse EUR I | Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd | 825                                     | -                                       |
| European Sustainable Equity | Ausschüttende Klasse EUR I  | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 1.027                                   | 1.027                                   |
| European Sustainable Equity | Ausschüttende Klasse EUR I3 | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 2.593                                   | 2.593                                   |
| European Sustainable Equity | Thesaurierende Klasse EUR M | Neuberger Berman Asia Holdings LLC        | -                                       | 1.649                                   |
| European Sustainable Equity | Thesaurierende Klasse EUR M | Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd | 1.649                                   | -                                       |
| European Sustainable Equity | Thesaurierende Klasse EUR Z | Neuberger Berman Asia Holdings LLC        | -                                       | 408.530                                 |
| European Sustainable Equity | Thesaurierende Klasse EUR Z | Neuberger Berman Capital (Cayman) Ltd     | 4.772.441                               | -                                       |
| European Sustainable Equity | Thesaurierende Klasse EUR Z | Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd | 408.530                                 | -                                       |

FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio                   | Anteilklasse   | Anteilinhaber                        | 31. Dezember 2024<br>Anzahl der Anteile | 31. Dezember 2023<br>Anzahl der Anteile |
|-----------------------------|--|--------------------------------------|---|---|
| European Sustainable Equity | Thesaurierende Klasse EUR Z  | Mitarbeiter von Neuberger Berman     | 28.495                                  | 31.579                                  |
| European Sustainable Equity | Thesaurierende Klasse EUR Z  | Neuberger Berman Group LLC           | -                                       | 4.772.441                               |
| European Sustainable Equity | Thesaurierende Klasse USD A (nicht währungsgesichert)              | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.000                                   | 1.000                                   |
| European Sustainable Equity | Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)              | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.000                                   | 1.000                                   |
| European Sustainable Equity | Thesaurierende Klasse USD M (nicht währungsgesichert)              | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.000                                   | 1.000                                   |
| Event Driven                | Thesaurierende Klasse EUR I  | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 922                                     | -                                       |
| Event Driven                | Thesaurierende Klasse EUR I  | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                                       | 922                                     |
| Event Driven                | Ausschüttende Klasse EUR I5  | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.761                                   | -                                       |
| Event Driven                | Ausschüttende Klasse GBP I5  | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | -                                       | 2.584                                   |
| Event Driven                | Thesaurierende Klasse GBP P  | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.584                                   | 2.584                                   |
| Event Driven                | Thesaurierende Klasse USD I  | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.000                                   | 1.000                                   |
| Global Bond                 | Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)                             | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | -                                       | 3.937                                   |
| Global Bond                 | Thesaurierende Klasse EUR I Benchmark<br>Währungsgesicherte Klasse | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.766                                   | 2.766                                   |
| Global Bond                 | Ausschüttende Klasse GBP P   | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.331                                   | -                                       |
| Global Bond                 | Thesaurierende Klasse USD I Benchmark<br>Währungsgesicherte Klasse | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 3.000                                   | 3.000                                   |
| Global Bond                 | Thesaurierende Klasse USD I Benchmark<br>Währungsgesicherte Klasse | Mitarbeiter von Neuberger Berman     | 2.405                                   | -                                       |
| Global Bond                 | Thesaurierende Klasse USD I  | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                                       | 888                                     |
| Global Bond                 | Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)                             | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | -                                       | 3.000                                   |
| Global Bond                 | Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)                             | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | -                                       | 4.481                                   |
| Global Equity Megatrends    | Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)              | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 913                                     | -                                       |
| Global Equity Megatrends    | Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)             | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.361                                   | -                                       |
| Global Equity Megatrends    | Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)              | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 789                                     | -                                       |
| Global Equity Megatrends    | Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)              | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 786                                     | 786                                     |
| Global Equity Megatrends    | Thesaurierende Klasse HKD A  | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 23.311                                  | -                                       |

## FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio                     | Anteilklasse                           | Anteilinhaber                             | 31. Dezember 2024<br>Anzahl der Anteile | 31. Dezember 2023<br>Anzahl der Anteile |
|-------------------------------|--|---|---|---|
| Global Equity Megatrends      | Thesaurierende Klasse SGD A            | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 2.010                                   | -                                       |
| Global Equity Megatrends      | Thesaurierende Klasse SGD A            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | -                                       | 2.010                                   |
| Global Equity Megatrends      | Thesaurierende Klasse USD I            | Mitarbeiter von Neuberger Berman          | 678                                     | 12.401                                  |
| Global Equity Megatrends      | Thesaurierende Klasse USD I4           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 3.000                                   | -                                       |
| Global Equity Megatrends      | Thesaurierende Klasse USD Z            | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 1.000                                   | 1.000                                   |
| Global Equity Megatrends      | Thesaurierende Klasse USD Z            | Mitarbeiter von Neuberger Berman          | 32.058                                  | -                                       |
| Global Flexible Credit Income | Thesaurierende Klasse EUR M            | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 2.359                                   | 2.359                                   |
| Global Flexible Credit Income | Ausschüttende Klasse GBP P             | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 2.331                                   | -                                       |
| Global Flexible Credit Income | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 3.000                                   | -                                       |
| Global Flexible Credit Income | Ausschüttende Klasse USD I             | Neuberger Berman Asia Holdings LLC        | -                                       | 7.763                                   |
| Global Flexible Credit Income | Ausschüttende Klasse USD I             | Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd | 7.763                                   | -                                       |
| Global Flexible Credit Income | Thesaurierende Klasse USD Z            | Mitarbeiter von Neuberger Berman          | 48.058                                  | 32.935                                  |
| Global Flexible Credit Income | Thesaurierende Klasse USD Z            | Strategic Income                          | 459.982                                 | 459.982                                 |
| Global High Yield Engagement  | Ausschüttende Klasse AUD I             | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 4.223                                   | -                                       |
| Global High Yield Engagement  | Ausschüttende Klasse AUD I             | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | -                                       | 4.223                                   |
| Global High Yield Engagement  | Thesaurierende Klasse AUD I4           | Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd | 4.589                                   | -                                       |
| Global High Yield Engagement  | Thesaurierende Klasse CHF I4           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 2.931                                   | -                                       |
| Global High Yield Engagement  | Thesaurierende Klasse CHF I4           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | -                                       | 2.931                                   |
| Global High Yield Engagement  | Ausschüttende Klasse CHF I4            | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 2.931                                   | -                                       |
| Global High Yield Engagement  | Ausschüttende Klasse CHF I4            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | -                                       | 2.931                                   |
| Global High Yield Engagement  | Thesaurierende Klasse CHF X            | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 2.931                                   | -                                       |
| Global High Yield Engagement  | Thesaurierende Klasse CHF X            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | -                                       | 2.931                                   |
| Global High Yield Engagement  | Thesaurierende Klasse EUR I4           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 2.846                                   | -                                       |
| Global High Yield Engagement  | Thesaurierende Klasse EUR I4           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | -                                       | 2.846                                   |

FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio                    | Anteilklasse                     | Anteilinhaber                        | 31. Dezember 2024<br>Anzahl der Anteile | 31. Dezember 2023<br>Anzahl der Anteile |
|------------------------------|----------------------------------|--------------------------------------|---|---|
| Global High Yield Engagement | Ausschüttende Klasse EUR I4      | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.846                                   | -                                       |
| Global High Yield Engagement | Ausschüttende Klasse EUR I4      | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                                       | 2.846                                   |
| Global High Yield Engagement | Thesaurierende Klasse EUR X      | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.846                                   | -                                       |
| Global High Yield Engagement | Thesaurierende Klasse EUR X      | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                                       | 2.846                                   |
| Global High Yield Engagement | Thesaurierende Klasse EUR Z (PF) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.539                                   | -                                       |
| Global High Yield Engagement | Thesaurierende Klasse EUR Z (PF) | Mitarbeiter von Neuberger Berman     | 13.678                                  | 13.678                                  |
| Global High Yield Engagement | Thesaurierende Klasse EUR Z (PF) | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                                       | 2.539                                   |
| Global High Yield Engagement | Thesaurierende Klasse GBP I4     | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.398                                   | -                                       |
| Global High Yield Engagement | Thesaurierende Klasse GBP I4     | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                                       | 2.398                                   |
| Global High Yield Engagement | Thesaurierende Klasse GBP X      | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.398                                   | -                                       |
| Global High Yield Engagement | Thesaurierende Klasse GBP X      | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                                       | 2.398                                   |
| Global High Yield Engagement | Thesaurierende Klasse USD A      | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                                       | 1.796                                   |
| Global High Yield Engagement | Thesaurierende Klasse USD I      | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 816                                     | -                                       |
| Global High Yield Engagement | Thesaurierende Klasse USD I      | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                                       | 816                                     |
| Global High Yield Engagement | Thesaurierende Klasse USD I4     | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.000                                   | -                                       |
| Global High Yield Engagement | Thesaurierende Klasse USD I4     | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                                       | 1.000                                   |
| Global High Yield Engagement | Ausschüttende Klasse USD M       | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.208                                   | -                                       |
| Global High Yield Engagement | Ausschüttende Klasse USD M       | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                                       | 1.208                                   |
| Global High Yield Engagement | Thesaurierende Klasse USD X      | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.013                                   | 1.000                                   |
| Global High Yield Engagement | Thesaurierende Klasse USD X      | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                                       | 1.013                                   |
| Global High Yield Engagement | Thesaurierende Klasse USD Z      | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 789                                     | -                                       |
| Global High Yield Engagement | Thesaurierende Klasse USD Z      | Mitarbeiter von Neuberger Berman     | -                                       | 2.226                                   |
| Global High Yield Engagement | Thesaurierende Klasse USD Z      | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                                       | 789                                     |
| Global High Yield Engagement | Thesaurierende Klasse USD Z      | Strategic Income                     | 654.438                                 | 654.438                                 |

## FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio                      | Anteilklasse  | Anteilinhaber                             | 31. Dezember 2024<br>Anzahl der Anteile | 31. Dezember 2023<br>Anzahl der Anteile |
|--------------------------------|---|---|---|---|
| Global Investment Grade Credit | Thesaurierende Klasse EUR I                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 2.730                                   | 2.730                                   |
| Global Investment Grade Credit | Ausschüttende Klasse GBP P                            | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 2.330                                   | -                                       |
| Global Investment Grade Credit | Ausschüttende Klasse GBP X                            | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 2.283                                   | -                                       |
| Global Investment Grade Credit | Thesaurierende Klasse USD I                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 1.000                                   | -                                       |
| Global Investment Grade Credit | Thesaurierende Klasse USD I                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | -                                       | 1.000                                   |
| Global Investment Grade Credit | Thesaurierende Klasse USD X                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 1.000                                   | -                                       |
| Global Investment Grade Credit | Thesaurierende Klasse USD X                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | -                                       | 1.000                                   |
| Global Investment Grade Credit | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Corporate Hybrid Bond                     | 1.300.000                               | 1.300.000                               |
| Global Investment Grade Credit | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Mitarbeiter von Neuberger Berman          | 535                                     | 535                                     |
| Global Investment Grade Credit | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | -                                       | 1.498.000                               |
| Global Investment Grade Credit | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Strategic Income                          | 2.000.000                               | 2.000.000                               |
| Global Opportunistic Bond      | Thesaurierende Klasse EUR I                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 1.530                                   | -                                       |
| Global Opportunistic Bond      | Thesaurierende Klasse EUR I                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | -                                       | 1.530                                   |
| Global Opportunistic Bond      | Thesaurierende Klasse GBP P                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 2.295                                   | 2.295                                   |
| Global Opportunistic Bond      | Thesaurierende Klasse USD A                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 1.175                                   | -                                       |
| Global Opportunistic Bond      | Thesaurierende Klasse USD A                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | -                                       | 1.175                                   |
| Global Opportunistic Bond      | Thesaurierende Klasse USD I                           | Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd | 669                                     | -                                       |
| Global Opportunistic Bond      | Thesaurierende Klasse USD I                           | Neuberger Berman Group LLC                | -                                       | 669                                     |
| Global Opportunistic Bond      | Ausschüttende Klasse USD I                            | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 1.083                                   | -                                       |
| Global Opportunistic Bond      | Ausschüttende Klasse USD I                            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | -                                       | 1.083                                   |
| Global Real Estate Securities  | Thesaurierende Klasse EUR M                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | -                                       | 1.000                                   |
| Global Real Estate Securities  | Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert) | Mitarbeiter von Neuberger Berman          | -                                       | 18.144                                  |
| Global Real Estate Securities  | Thesaurierende Klasse GBP Z                           | Mitarbeiter von Neuberger Berman          | -                                       | 500                                     |
| Global Real Estate Securities  | Ausschüttende Klasse USD I5                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | -                                       | 3.315                                   |

FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio                     | Anteilklasse   | Anteilinhaber   | 31. Dezember 2024<br>Anzahl der Anteile | 31. Dezember 2023<br>Anzahl der Anteile |
|-------------------------------|--|---|---|---|
| Global Real Estate Securities | Thesaurierende Klasse USD Z                                      | Mitarbeiter von Neuberger Berman  | -                                       | 9.811                                   |
| Global Sustainable Equity     | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)            | Neuberger Berman Asia Holdings LLC                                      | -                                       | 1.649                                   |
| Global Sustainable Equity     | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)            | Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd                               | 1.649                                   | -                                       |
| Global Sustainable Equity     | Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert)            | Mitarbeiter von Neuberger Berman  | 120.430                                 | 120.430                                 |
| Global Sustainable Equity     | Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                    | 722                                     | 722                                     |
| Global Sustainable Equity     | Thesaurierende Klasse USD A                                      | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                    | -                                       | 1.000                                   |
| Global Sustainable Equity     | Thesaurierende Klasse USD I                                      | Mitarbeiter von Neuberger Berman  | -                                       | 9.518                                   |
| Global Sustainable Equity     | Ausschüttende Klasse USD I                                       | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                    | 1.131                                   | 1.131                                   |
| Global Sustainable Equity     | Thesaurierende Klasse USD Z                                      | Neuberger Berman Asia Holdings LLC                                      | -                                       | 528.063                                 |
| Global Sustainable Equity     | Thesaurierende Klasse USD Z                                      | Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd                               | 3.009.214                               | -                                       |
| Global Sustainable Equity     | Thesaurierende Klasse USD Z                                      | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                    | 1.000                                   | 1.000                                   |
| Global Sustainable Equity     | Thesaurierende Klasse USD Z                                      | Mitarbeiter von Neuberger Berman  | -                                       | 160                                     |
| Global Sustainable Equity     | Thesaurierende Klasse USD Z                                      | Neuberger Berman Group LLC  | -                                       | 2.481.151                               |
| Global Value                  | Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                    | 927                                     | 927                                     |
| Global Value                  | Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)            | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                    | 823                                     | -                                       |
| Global Value                  | Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC                                    | -                                       | 823                                     |
| Global Value                  | Thesaurierende Klasse USD Z                                      | Mitarbeiter von Neuberger Berman  | 3.166                                   | 3.166                                   |
| High Yield Bond               | Ausschüttende Klasse AUD T (Wöchentlich)                         | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                    | 1.675                                   | -                                       |
| High Yield Bond               | Ausschüttende Klasse AUD T (Wöchentlich)                         | Neuberger Berman Europe Holdings LLC                                    | -                                       | 1.675                                   |
| High Yield Bond               | Thesaurierende Klasse EUR Z                                      | Mitarbeiter von Neuberger Berman  | 16.506                                  | 15.211                                  |
| High Yield Bond               | Thesaurierende Klasse GBP Z                                      | Mitarbeiter von Neuberger Berman  | 2.729                                   | 2.729                                   |
| High Yield Bond               | Ausschüttende Klasse JPY A (Monatlich) (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                    | 1.458                                   | -                                       |
| High Yield Bond               | Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)                           | Bond-Plus Income & Growth Multi-Asset Class Securities Investment Trust | 2.134.918                               | 3.907.647                               |

## FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio       | Anteilklasse  | Anteilinhaber  | 31. Dezember 2024<br>Anzahl der Anteile | 31. Dezember 2023<br>Anzahl der Anteile |
|-----------------|---|--|---|---|
| High Yield Bond | Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)                | Neuberger Berman Global Strategic Income Securities Investment Trust | 124.531                                 | 259.531                                 |
| High Yield Bond | Thesaurierende Klasse USD P                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                 | 1.208                                   | -                                       |
| High Yield Bond | Thesaurierende Klasse USD P                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC                                 | -                                       | 1.208                                   |
| High Yield Bond | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Mitarbeiter von Neuberger Berman                                     | 5.615                                   | 7.741                                   |
| High Yield Bond | Thesaurierende Klasse ZAR T                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC                                 | -                                       | 1.308                                   |
| InnovAsia       | Thesaurierende Klasse CHF I4                          | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                 | 2.747                                   | -                                       |
| InnovAsia       | Thesaurierende Klasse CHF I4                          | Neuberger Berman Europe Holdings LLC                                 | -                                       | 2.747                                   |
| InnovAsia       | Thesaurierende Klasse EUR A                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                 | 2.539                                   | -                                       |
| InnovAsia       | Thesaurierende Klasse EUR A                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC                                 | -                                       | 2.539                                   |
| InnovAsia       | Thesaurierende Klasse EUR I4                          | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                 | 2.539                                   | -                                       |
| InnovAsia       | Thesaurierende Klasse EUR I4                          | Neuberger Berman Europe Holdings LLC                                 | -                                       | 2.539                                   |
| InnovAsia       | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                 | 2.584                                   | 2.584                                   |
| InnovAsia       | Thesaurierende Klasse EUR X                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                 | 2.539                                   | -                                       |
| InnovAsia       | Thesaurierende Klasse EUR X                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC                                 | -                                       | 2.539                                   |
| InnovAsia       | Thesaurierende Klasse SGD A                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                 | 2.031                                   | -                                       |
| InnovAsia       | Thesaurierende Klasse SGD A                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC                                 | -                                       | 2.031                                   |
| InnovAsia       | Thesaurierende Klasse SGD I4                          | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                 | 2.031                                   | -                                       |
| InnovAsia       | Thesaurierende Klasse SGD I4                          | Neuberger Berman Europe Holdings LLC                                 | -                                       | 2.031                                   |
| InnovAsia       | Thesaurierende Klasse SGD X                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                 | 2.031                                   | -                                       |
| InnovAsia       | Thesaurierende Klasse SGD X                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC                                 | -                                       | 2.031                                   |
| InnovAsia       | Thesaurierende Klasse USD A                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC                                 | -                                       | 1.000                                   |
| InnovAsia       | Thesaurierende Klasse USD I                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                 | 4.272                                   | -                                       |
| InnovAsia       | Thesaurierende Klasse USD I                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC                                 | -                                       | 476.000                                 |
| InnovAsia       | Thesaurierende Klasse USD I4                          | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                 | 1.000                                   | -                                       |

FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio                    | Anteilklasse  | Anteilinhaber                         | 31. Dezember 2024<br>Anzahl der Anteile | 31. Dezember 2023<br>Anzahl der Anteile |
|------------------------------|---|---------------------------------------|---|---|
| InnovAsia                    | Thesaurierende Klasse USD I4                              | Mitarbeiter von Neuberger Berman      | -                                       | 2.037                                   |
| InnovAsia                    | Thesaurierende Klasse USD I4                              | Neuberger Berman Europe Holdings LLC  | -                                       | 1.000                                   |
| InnovAsia                    | Thesaurierende Klasse USD M                               | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd  | 1.000                                   | 1.000                                   |
| InnovAsia                    | Thesaurierende Klasse USD X                               | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd  | 1.000                                   | -                                       |
| InnovAsia                    | Thesaurierende Klasse USD X                               | Neuberger Berman Europe Holdings LLC  | -                                       | 1.000                                   |
| Japan Equity Engagement      | Ausschüttende Klasse EUR I5                               | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd  | 2.662                                   | -                                       |
| Japan Equity Engagement      | Ausschüttende Klasse EUR I5                               | Neuberger Berman Europe Holdings LLC  | -                                       | 2.662                                   |
| Japan Equity Engagement      | Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht<br>währungsgesichert) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd  | 787                                     | 787                                     |
| Japan Equity Engagement      | Thesaurierende Klasse GBP P (nicht<br>währungsgesichert)  | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd  | -                                       | 2.242                                   |
| Japan Equity Engagement      | Thesaurierende Klasse JPY A                               | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd  | 4.678                                   | -                                       |
| Japan Equity Engagement      | Thesaurierende Klasse JPY I                               | Mitarbeiter von Neuberger Berman      | 3.576                                   | 3.576                                   |
| Japan Equity Engagement      | Thesaurierende Klasse JPY Z                               | Neuberger Berman Asia Holdings LLC    | -                                       | 778.814                                 |
| Japan Equity Engagement      | Thesaurierende Klasse JPY Z                               | Neuberger Berman Capital (Cayman) Ltd | 23.645                                  | -                                       |
| Japan Equity Engagement      | Thesaurierende Klasse JPY Z                               | Mitarbeiter von Neuberger Berman      | 141.708                                 | 147.815                                 |
| Japan Equity Engagement      | Thesaurierende Klasse JPY Z                               | Neuberger Berman Group LLC            | -                                       | 2.005.146                               |
| Japan Equity Engagement      | Thesaurierende Klasse USD A                               | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd  | 3.000                                   | -                                       |
| Japan Equity Engagement      | Thesaurierende Klasse USD I                               | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd  | 3.000                                   | -                                       |
| Macro Opportunities FX       | Thesaurierende Klasse EUR I                               | Neuberger Berman Asia Holdings LLC    | -                                       | 1.000                                   |
| Macro Opportunities FX       | Thesaurierende Klasse GBP Z                               | Mitarbeiter von Neuberger Berman      | -                                       | 2.005                                   |
| Macro Opportunities FX       | Thesaurierende Klasse SEK I                               | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd  | -                                       | 2.830                                   |
| Macro Opportunities FX       | Thesaurierende Klasse USD I                               | Neuberger Berman Asia Holdings LLC    | -                                       | 1.081                                   |
| Macro Opportunities FX       | Thesaurierende Klasse USD Z                               | Mitarbeiter von Neuberger Berman      | -                                       | 7.959                                   |
| Next Generation Connectivity | Thesaurierende Klasse AUD I2                              | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd  | 4.665                                   | -                                       |
| Next Generation Connectivity | Thesaurierende Klasse AUD I2                              | Neuberger Berman Europe Holdings LLC  | -                                       | 4.665                                   |

## FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio                    | Anteilklasse  | Anteilinhaber                        | 31. Dezember 2024<br>Anzahl der Anteile | 31. Dezember 2023<br>Anzahl der Anteile |
|------------------------------|---|--------------------------------------|---|---|
| Next Generation Connectivity | Thesaurierende Klasse CHF A                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.627                                   | 2.627                                   |
| Next Generation Connectivity | Thesaurierende Klasse CHF I                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.627                                   | 2.627                                   |
| Next Generation Connectivity | Thesaurierende Klasse CHF I2                          | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.675                                   | -                                       |
| Next Generation Connectivity | Thesaurierende Klasse CHF I2                          | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                                       | 2.675                                   |
| Next Generation Connectivity | Thesaurierende Klasse CNY I2                          | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.181                                   | -                                       |
| Next Generation Connectivity | Thesaurierende Klasse CNY I2                          | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                                       | 2.181                                   |
| Next Generation Connectivity | Thesaurierende Klasse EUR I2                          | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.791                                   | -                                       |
| Next Generation Connectivity | Thesaurierende Klasse EUR I2                          | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                                       | 2.791                                   |
| Next Generation Connectivity | Thesaurierende Klasse EUR I5                          | Mitarbeiter von Neuberger Berman     | 1.965                                   | 1.965                                   |
| Next Generation Connectivity | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.326                                   | 2.326                                   |
| Next Generation Connectivity | Thesaurierende Klasse GBP I2                          | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.400                                   | -                                       |
| Next Generation Connectivity | Thesaurierende Klasse GBP I2                          | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                                       | 2.400                                   |
| Next Generation Connectivity | Thesaurierende Klasse HKD I2                          | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 23.473                                  | -                                       |
| Next Generation Connectivity | Thesaurierende Klasse HKD I2                          | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                                       | 23.473                                  |
| Next Generation Connectivity | Thesaurierende Klasse SGD I2                          | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.039                                   | -                                       |
| Next Generation Connectivity | Thesaurierende Klasse SGD I2                          | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                                       | 2.039                                   |
| Next Generation Connectivity | Thesaurierende Klasse USD I3                          | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.000                                   | 1.000                                   |
| Next Generation Connectivity | Thesaurierende Klasse USD I5                          | Mitarbeiter von Neuberger Berman     | 9.953                                   | 9.953                                   |
| Next Generation Connectivity | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Mitarbeiter von Neuberger Berman     | 32.201                                  | 108.423                                 |
| Next Generation Mobility     | Thesaurierende Klasse EUR A                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.000                                   | -                                       |
| Next Generation Mobility     | Thesaurierende Klasse EUR A                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                                       | 1.000                                   |
| Next Generation Mobility     | Thesaurierende Klasse EUR I                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.459                                   | 2.459                                   |
| Next Generation Mobility     | Thesaurierende Klasse USD C1                          | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 10                                      | 10                                      |
| Next Generation Mobility     | Thesaurierende Klasse USD I                           | Mitarbeiter von Neuberger Berman     | 638                                     | 738                                     |

FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio                           | Anteilklasse   | Anteilinhaber                             | 31. Dezember 2024<br>Anzahl der Anteile | 31. Dezember 2023<br>Anzahl der Anteile |
|-------------------------------------|--|---|---|---|
| Next Generation Mobility            | Ausschüttende Klasse USD I                             | Neuberger Berman Asia Holdings LLC        | -                                       | 730                                     |
| Next Generation Mobility            | Thesaurierende Klasse USD X                            | Neuberger Berman Asia Holdings LLC        | -                                       | 3.000                                   |
| Next Generation Mobility            | Thesaurierende Klasse USD X                            | Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd | 3.000                                   | -                                       |
| Next Generation Mobility            | Thesaurierende Klasse USD X                            | Mitarbeiter von Neuberger Berman          | 588                                     | 588                                     |
| Next Generation Space Economy       | Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)  | Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd | 921                                     | -                                       |
| Next Generation Space Economy       | Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 94.928                                  | -                                       |
| Next Generation Space Economy       | Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | -                                       | 94.928                                  |
| Next Generation Space Economy       | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)  | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 94.928                                  | -                                       |
| Next Generation Space Economy       | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)  | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | -                                       | 94.928                                  |
| Next Generation Space Economy       | Thesaurierende Klasse USD A                            | Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd | 1.000                                   | -                                       |
| Next Generation Space Economy       | Thesaurierende Klasse USD I                            | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 266.193                                 | -                                       |
| Next Generation Space Economy       | Thesaurierende Klasse USD I                            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | -                                       | 300.000                                 |
| Short Duration Emerging Market Debt | Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich)                 | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 1.365                                   | -                                       |
| Short Duration Emerging Market Debt | Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich)                 | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | -                                       | 1.365                                   |
| Short Duration Emerging Market Debt | Thesaurierende Klasse SEK A                            | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 2.374                                   | -                                       |
| Short Duration Emerging Market Debt | Thesaurierende Klasse SEK A                            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | -                                       | 2.374                                   |
| Short Duration Emerging Market Debt | Thesaurierende Klasse USD Z                            | Mitarbeiter von Neuberger Berman          | 35.402                                  | 31.591                                  |
| Short Duration Euro Bond            | Thesaurierende Klasse CHF U                            | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | -                                       | 294                                     |
| Short Duration Euro Bond            | Ausschüttende Klasse EUR I                             | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | -                                       | 119                                     |
| Short Duration Euro Bond            | Thesaurierende Klasse EUR M                            | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | -                                       | 252                                     |
| Short Duration Euro Bond            | Thesaurierende Klasse EUR U                            | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | -                                       | 79                                      |
| Short Duration Euro Bond            | Thesaurierende Klasse EUR Z                            | Mitarbeiter von Neuberger Berman          | 15.840                                  | 19.030                                  |
| Short Duration Euro Bond            | Thesaurierende Klasse USD Z                            | Emerging Market Debt - Hard Currency      | -                                       | 150.000                                 |
| Short Duration Euro Bond            | Thesaurierende Klasse USD Z                            | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 250                                     | -                                       |

## FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio                            | Anteilklasse   | Anteilinhaber  | 31. Dezember 2024  | 31. Dezember 2023  |
|--------------------------------------|--|--|--------------------|--------------------|
|                                      |  |  | Anzahl der Anteile | Anzahl der Anteile |
| Short Duration Euro Bond             | Thesaurierende Klasse USD Z                                      | Mitarbeiter von Neuberger Berman                                     | 245                | -                  |
| Short Duration Euro Bond             | Thesaurierende Klasse USD Z                                      | Short Duration Emerging Market Debt                                  | -                  | 425.000            |
| Short Duration High Yield Engagement | Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                 | 23.546             | 23.546             |
| Short Duration High Yield Engagement | Thesaurierende Klasse USD I4                                     | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                 | 1.000              | 1.000              |
| Short Duration High Yield Engagement | Thesaurierende Klasse USD Z                                      | Neuberger Berman Asia Holdings LLC                                   | -                  | 7.984              |
| Short Duration High Yield Engagement | Thesaurierende Klasse USD Z                                      | Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd                            | 11.883             | 2.654              |
| Short Duration High Yield Engagement | Thesaurierende Klasse USD Z                                      | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                 | 104                | 876                |
| Short Duration High Yield Engagement | Thesaurierende Klasse USD Z                                      | Mitarbeiter von Neuberger Berman                                     | 40.583             | 40.341             |
| Short Duration High Yield Engagement | Thesaurierende Klasse USD Z                                      | Neuberger Berman Europe Holdings LLC                                 | -                  | 3.422              |
| Short Duration High Yield Engagement | Thesaurierende Klasse USD Z                                      | Neuberger Berman Group LLC   | -                  | 5.823              |
| Strategic Income                     | Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                 | -                  | 2.137              |
| Strategic Income                     | Thesaurierende Klasse EUR A                                      | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                 | 2.861              | 2.861              |
| Strategic Income                     | Thesaurierende Klasse EUR I                                      | Mitarbeiter von Neuberger Berman                                     | 83.400             | 83.400             |
| Strategic Income                     | Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC                                 | -                  | 11.473             |
| Strategic Income                     | Ausschüttende Klasse JPY A (Monatlich)                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                 | 4.505              | -                  |
| Strategic Income                     | Ausschüttende Klasse JPY A (Monatlich) (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                 | 4.375              | -                  |
| Strategic Income                     | Ausschüttende Klasse JPY E (Monatlich) (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                 | 1.467              | -                  |
| Strategic Income                     | Ausschüttende Klasse JPY I                                       | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                 | 5.300              | 5.300              |
| Strategic Income                     | Thesaurierende Klasse SGD A                                      | Neuberger Berman Europe Holdings LLC                                 | -                  | 682                |
| Strategic Income                     | Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich)                          | Neuberger Berman Overseas Strategic Income Fixed Income Private Fund | 35.870.941         | -                  |
| Strategic Income                     | Thesaurierende Klasse USD Z                                      | Mitarbeiter von Neuberger Berman                                     | 70.928             | 20.836             |
| Sustainable Asia High Yield          | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                 | 1.000              | -                  |
| Sustainable Asia High Yield          | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)                           | Neuberger Berman Group LLC   | -                  | 1.000              |
| Sustainable Asia High Yield          | Thesaurierende Klasse USD A                                      | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                 | 1.000              | -                  |

FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio  | Anteilklasse   | Anteilinhaber                         | 31. Dezember 2024<br>Anzahl der Anteile | 31. Dezember 2023<br>Anzahl der Anteile |
|--|--|---------------------------------------|---|---|
| Sustainable Asia High Yield                      | Thesaurierende Klasse USD A                            | Neuberger Berman Group LLC            | -                                       | 1.000                                   |
| Sustainable Asia High Yield                      | Thesaurierende Klasse USD I                            | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd  | 1.225                                   | 1.225                                   |
| Sustainable Asia High Yield                      | Thesaurierende Klasse USD Z                            | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd  | 2.395.262                               | -                                       |
| Sustainable Asia High Yield                      | Thesaurierende Klasse USD Z                            | Mitarbeiter von Neuberger Berman      | 7.191                                   | 11.395                                  |
| Sustainable Asia High Yield                      | Thesaurierende Klasse USD Z                            | Neuberger Berman Group LLC            | -                                       | 2.395.262                               |
| Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency | Thesaurierende Klasse USD I                            | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd  | 1.000                                   | 1.000                                   |
| Tactical Macro1                                  | Thesaurierende Klasse USD I                            | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd  | 1.000                                   | 1.000                                   |
| Tactical Macro1                                  | Thesaurierende Klasse USD I5                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd  | 1.000                                   | 1.000                                   |
| Tactical Macro1                                  | Thesaurierende Klasse USD Z                            | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd  | 500.000                                 | -                                       |
| Tactical Macro1                                  | Thesaurierende Klasse USD Z                            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC  | -                                       | 500.000                                 |
| Uncorrelated Strategies                          | Thesaurierende Klasse EUR P                            | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd  | 2.931                                   | 2.931                                   |
| Uncorrelated Strategies                          | Ausschüttende Klasse GBP I2                            | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd  | 858                                     | 858                                     |
| Uncorrelated Strategies                          | Thesaurierende Klasse GBP Z                            | Mitarbeiter von Neuberger Berman      | 21.992                                  | 21.992                                  |
| Uncorrelated Strategies                          | Thesaurierende Klasse USD Z                            | Mitarbeiter von Neuberger Berman      | 20.480                                  | 24.926                                  |
| US Equity  | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)  | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd  | 917                                     | -                                       |
| US Equity  | Thesaurierende Klasse EUR I5                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd  | 2.799                                   | -                                       |
| US Equity  | Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd  | 933                                     | -                                       |
| US Equity  | Ausschüttende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)  | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd  | 933                                     | -                                       |
| US Equity  | Thesaurierende Klasse EUR X (nicht währungsgesichert)  | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd  | 921                                     | -                                       |
| US Equity  | Thesaurierende Klasse EUR X (nicht währungsgesichert)  | Mitarbeiter von Neuberger Berman      | 20.250                                  | -                                       |
| US Equity  | Ausschüttende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)  | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd  | 788                                     | -                                       |
| US Equity  | Thesaurierende Klasse GBP X (nicht währungsgesichert)  | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd  | 786                                     | -                                       |
| US Equity  | Thesaurierende Klasse USD I                            | Mitarbeiter von Neuberger Berman      | 415                                     | 415                                     |
| US Equity  | Ausschüttende Klasse USD I                             | Neuberger Berman Capital (Cayman) Ltd | 229.104                                 | -                                       |

## FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio          | Anteilklasse  | Anteilinhaber                             | 31. Dezember 2024<br>Anzahl der Anteile | 31. Dezember 2023<br>Anzahl der Anteile |
|--------------------|---|---|---|---|
| US Equity          | Ausschüttende Klasse USD I                            | Neuberger Berman Group LLC                | -                                       | 229.104                                 |
| US Equity          | Ausschüttende Klasse USD I5                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 3.000                                   | -                                       |
| US Equity          | Thesaurierende Klasse USD M                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | -                                       | 1.000                                   |
| US Equity          | Thesaurierende Klasse USD X                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 1.000                                   | -                                       |
| US Equity Premium  | Thesaurierende Klasse EUR I                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 2.132                                   | -                                       |
| US Equity Premium  | Thesaurierende Klasse EUR I                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | -                                       | 2.132                                   |
| US Equity Premium  | Ausschüttende Klasse EUR I3                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | -                                       | 2.655                                   |
| US Equity Premium  | Thesaurierende Klasse EUR I4                          | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 1.111                                   | -                                       |
| US Equity Premium  | Thesaurierende Klasse EUR I4                          | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | -                                       | 1.111                                   |
| US Equity Premium  | Ausschüttende Klasse EUR I4                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 2.748                                   | -                                       |
| US Equity Premium  | Ausschüttende Klasse EUR I4                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | -                                       | 2.748                                   |
| US Equity Premium  | Thesaurierende Klasse EUR M                           | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | -                                       | 1.143                                   |
| US Equity Premium  | Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 785                                     | -                                       |
| US Equity Premium  | Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | -                                       | 785                                     |
| US Equity Premium  | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)                | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | -                                       | 809                                     |
| US Equity Premium  | Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)                | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 890                                     | -                                       |
| US Equity Premium  | Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)                | Neuberger Berman Europe Holdings LLC      | -                                       | 890                                     |
| US Equity Premium  | Ausschüttende Klasse USD I3                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | -                                       | 1.000                                   |
| US Equity Premium  | Thesaurierende Klasse USD Z                           | Mitarbeiter von Neuberger Berman          | 113.178                                 | 102.917                                 |
| US Large Cap Value | Thesaurierende Klasse EUR A                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 3.066                                   | 3.066                                   |
| US Large Cap Value | Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd | 947                                     | -                                       |
| US Large Cap Value | Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Group LLC                | -                                       | 947                                     |
| US Large Cap Value | Thesaurierende Klasse GBP I                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 2.528                                   | 2.528                                   |
| US Large Cap Value | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd      | 843                                     | 843                                     |

FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio                  | Anteilklasse   | Anteilinhaber   | 31. Dezember 2024  | 31. Dezember 2023  |
|----------------------------|--|---|--------------------|--------------------|
|                            |  |   | Anzahl der Anteile | Anzahl der Anteile |
| US Large Cap Value         | Ausschüttende Klasse GBP I                             | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                    | 2.528              | 2.528              |
| US Large Cap Value         | Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)   | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                    | 843                | 843                |
| US Large Cap Value         | Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)  | Neuberger Berman Group LLC  | -                  | 797                |
| US Large Cap Value         | Ausschüttende Klasse GBP P                             | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                    | 2.678              | 2.678              |
| US Large Cap Value         | Ausschüttende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)   | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                    | 858                | 858                |
| US Large Cap Value         | Thesaurierende Klasse USD Y                            | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                    | 1.000              | 1.000              |
| US Large Cap Value         | Thesaurierende Klasse USD Z                            | Mitarbeiter von Neuberger Berman  | 20.291             | 20.291             |
| US Long Short Equity       | Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                    | 933                | -                  |
| US Long Short Equity       | Ausschüttende Klasse GBP I3                            | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                    | 2.302              | 2.302              |
| US Long Short Equity       | Thesaurierende Klasse USD I                            | Neuberger Berman US Long Short Equity Private Fund                      | 1.754.812          | -                  |
| US Long Short Equity       | Thesaurierende Klasse USD I3                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                    | -                  | 1.000              |
| US Long Short Equity       | Thesaurierende Klasse USD M                            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC                                    | -                  | 1.115              |
| US Long Short Equity       | Thesaurierende Klasse USD Z                            | Mitarbeiter von Neuberger Berman  | 13.080             | 13.313             |
| US Multi Cap Opportunities | Thesaurierende Klasse AUD T                            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC                                    | -                  | 516                |
| US Multi Cap Opportunities | Ausschüttende Klasse GBP I3                            | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                    | 2.367              | -                  |
| US Multi Cap Opportunities | Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert)  | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                    | 1.065              | -                  |
| US Multi Cap Opportunities | Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert)  | Neuberger Berman Europe Holdings LLC                                    | -                  | 1.065              |
| US Multi Cap Opportunities | Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)  | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                    | 761                | -                  |
| US Multi Cap Opportunities | Thesaurierende Klasse USD I2                           | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                    | 1.000              | 1.000              |
| US Multi Cap Opportunities | Thesaurierende Klasse USD Z                            | Mitarbeiter von Neuberger Berman  | 11.481             | 12.011             |
| US Multi Cap Opportunities | Thesaurierende Klasse USD1 I                           | Bond-Plus Income & Growth Multi-Asset Class Securities Investment Trust | 252.835            | -                  |
| US Multi Cap Opportunities | Ausschüttende Klasse USD1 I                            | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                    | 268                | -                  |
| US Multi Cap Opportunities | Ausschüttende Klasse USD1 I                            | Neuberger Berman Europe Holdings LLC                                    | -                  | 268                |
| US Real Estate Securities  | Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich)                 | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd                                    | 1.418              | -                  |

## FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio                 | Anteilklasse   | Anteilinhaber                        | 31. Dezember 2024<br>Anzahl der Anteile | 31. Dezember 2023<br>Anzahl der Anteile |
|---------------------------|--|--------------------------------------|---|---|
| US Real Estate Securities | Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich)                   | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                                       | 1.418                                   |
| US Real Estate Securities | Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)                   | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.586                                   | -                                       |
| US Real Estate Securities | Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)                   | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                                       | 1.586                                   |
| US Real Estate Securities | Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)                   | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                                       | 1.424                                   |
| US Real Estate Securities | Thesaurierende Klasse AUD T                              | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                                       | 1.140                                   |
| US Real Estate Securities | Thesaurierende Klasse EUR I                              | Mitarbeiter von Neuberger Berman     | 10.360                                  | -                                       |
| US Real Estate Securities | Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)                   | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 943                                     | 943                                     |
| US Real Estate Securities | Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)                   | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                                       | 985                                     |
| US Real Estate Securities | Thesaurierende Klasse USD Z                              | Mitarbeiter von Neuberger Berman     | 18.955                                  | 15.120                                  |
| US Real Estate Securities | Thesaurierende Klasse ZAR C2                             | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | -                                       | 1.776                                   |
| US Real Estate Securities | Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)                   | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 1.790                                   | -                                       |
| US Real Estate Securities | Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)                   | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                                       | 1.790                                   |
| US Real Estate Securities | Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)                   | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                                       | 1.208                                   |
| US Small Cap              | Thesaurierende Klasse AUD B                              | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 727                                     | -                                       |
| US Small Cap              | Thesaurierende Klasse AUD B                              | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                                       | 727                                     |
| US Small Cap              | Thesaurierende Klasse AUD C2                             | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                                       | 1.010                                   |
| US Small Cap              | Thesaurierende Klasse AUD E                              | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 756                                     | -                                       |
| US Small Cap              | Thesaurierende Klasse AUD E                              | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                                       | 756                                     |
| US Small Cap              | Thesaurierende Klasse AUD T                              | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                                       | 1.329                                   |
| US Small Cap              | Thesaurierende Klasse EUR A (nicht<br>währungsgesichert) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 2.531                                   | 2.531                                   |
| US Small Cap              | Thesaurierende Klasse EUR Z                              | Mitarbeiter von Neuberger Berman     | 28.136                                  | 19.268                                  |
| US Small Cap              | Thesaurierende Klasse GBP P (nicht<br>währungsgesichert) | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 769                                     | -                                       |
| US Small Cap              | Thesaurierende Klasse USD C2                             | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                                       | 153                                     |
| US Small Cap              | Thesaurierende Klasse USD Z                              | Mitarbeiter von Neuberger Berman     | 11.707                                  | 8.635                                   |

FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

| Portfolio                    | Anteilklasse                | Anteilinhaber                        | 31. Dezember 2024<br>Anzahl der Anteile | 31. Dezember 2023<br>Anzahl der Anteile |
|------------------------------|-----------------------------|--------------------------------------|---|---|
| US Small Cap                 | Thesaurierende Klasse ZAR E | Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd | 105                                     | -                                       |
| US Small Cap                 | Thesaurierende Klasse ZAR E | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                                       | 745                                     |
| US Small Cap                 | Thesaurierende Klasse ZAR T | Neuberger Berman Europe Holdings LLC | -                                       | 1.812                                   |
| US Small Cap Intrinsic Value | Thesaurierende Klasse USD I | Mitarbeiter von Neuberger Berman     | 958                                     | 958                                     |

<sup>1</sup>Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.  
\*Anteilsbruchteile.

## FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET

## Beizulegender Zeitwert von Anlagen

|  | Absolute Return Multi Strategy* |                   | Asia Responsible Transition Bond |                   |
|--|---------------------------------|-------------------|----------------------------------|-------------------|
|  | 31. Dezember 2024               | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2024                | 31. Dezember 2023 |
|  | US\$                            | US\$              | US\$                             | US\$              |
| <b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>  |                                 |                   |                                  |                   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen  | 1.852                           | (18.814)          | 2.162.520                        | (1.467.912)       |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)  | (30)                            | (145)             | 19.009                           | (48.888)          |
|  | 1.822                           | (18.959)          | 2.181.529                        | (1.516.800)       |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen  | (6.311)                         | (452)             | (495.045)                        | 2.387.666         |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)   | 198                             | 19                | (112.339)                        | 48.869            |
|  | (6.113)                         | (433)             | (607.384)                        | 2.436.535         |
| <b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b> | (4.291)                         | (19.392)          | 1.574.145                        | 919.735           |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

\* Der Absolute Return Multi Strategy wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst. Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) entstanden ausschließlich aus eingestellter Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

|  | China A-Share Equity |                   | China Bond        |                   |
|--|----------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
|  | 31. Dezember 2024    | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2024 | 31. Dezember 2023 |
|  | CNY                  | CNY               | CNY               | CNY               |
| <b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>  |                      |                   |                   |                   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen  | (2.041.772)          | (4.404.478)       | 11.350.092        | 3.576.296         |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)  | 10.298               | 108.671           | 3.339.508         | 465.916           |
|  | (2.031.474)          | (4.295.807)       | 14.689.600        | 4.042.212         |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen  | 2.435.339            | 2.301.488         | (570.767)         | 16.943.620        |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)   | 29.613               | (83.806)          | (953.166)         | 3.901.574         |
|  | 2.464.952            | 2.217.682         | (1.523.933)       | 20.845.194        |
| <b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b> | 433.478              | (2.078.125)       | 13.165.667        | 24.887.406        |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

## FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

## Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

|  | China Equity      |                     | Climate Innovation <sup>1</sup> |                   |
|--|-------------------|---------------------|---------------------------------|-------------------|
|  | 31. Dezember 2024 | 31. Dezember 2023   | 31. Dezember 2024               | 31. Dezember 2023 |
|  | US\$              | US\$                | US\$                            | US\$              |
| <b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>  |                   |                     |                                 |                   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen  | (34.718.604)      | (60.500.162)        | (26.429)                        | (170.258)         |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)  | (5.660.953)       | (8.498.656)         | (15.740)                        | (3.990)           |
|  | (40.379.557)      | (68.998.818)        | (42.169)                        | (174.248)         |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen  | 59.520.697        | 1.062.218           | 238.289                         | 75.353            |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)   | 4.331.832         | 2.551.593           | (73.871)                        | 15.562            |
|  | 63.852.529        | 3.613.811           | 164.418                         | 90.915            |
| <b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b> | <b>23.472.972</b> | <b>(65.385.007)</b> | <b>122.249</b>                  | <b>(83.333)</b>   |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

|  | CLO Income        |                   | Commodities       |                   |
|--|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
|  | 31. Dezember 2024 | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2024 | 31. Dezember 2023 |
|  | US\$              | US\$              | US\$              | US\$              |
| <b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>  |                   |                   |                   |                   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen  | (2.413.307)       | (602.334)         | 7.134.473         | (10.452.143)      |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)  | 1.210.960         | (110.614)         | (1.954)           | (13.702)          |
|  | (1.202.347)       | (712.948)         | 7.132.519         | (10.465.845)      |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen  | 42.605.253        | 14.494.255        | (3.185.684)       | 1.021.047         |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)   | (21.292.386)      | 1.515.407         | 144               | (151)             |
|  | 21.312.867        | 16.009.662        | (3.185.540)       | 1.020.896         |
| <b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b> | 20.110.520        | 15.296.714        | 3.946.979         | (9.444.949)       |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

|  | Corporate Hybrid Bond |                   | Developed Market FMP – 2027 <sup>1</sup> |                   |
|--|-----------------------|-------------------|--|-------------------|
|  | 31. Dezember 2024     | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2024                        | 31. Dezember 2023 |
|  | EUR                   | EUR               | US\$                                     | US\$              |
| <b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>  |                       |                   |  |                   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen  | (21.598.924)          | (152.927.709)     | 471.616                                  | (21.479)          |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)  | 12.867.094            | 4.348.385         | 11                                       | (542)             |
|  | (8.731.830)           | (148.579.324)     | 471.627                                  | (22.021)          |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen  | 95.499.675            | 229.282.682       | 1.185.085                                | 3.780.658         |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)   | 28.251.826            | (4.304.724)       | 35                                       | (35)              |
|  | 123.751.501           | 224.977.958       | 1.185.120                                | 3.780.623         |
| <b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b> | 115.019.671           | 76.398.634        | 1.656.747                                | 3.758.602         |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

|  | EMD Corporate – Social and Environmental Transition |                   | Emerging Market Debt - Hard Currency |                    |
|--|---|-------------------|--------------------------------------|--------------------|
|  | 31. Dezember 2024                                   | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2024                    | 31. Dezember 2023  |
|  | US\$  | US\$              | US\$                                 | US\$               |
| <b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>  |   |                   |                                      |                    |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen  | (2.184.912)   | (3.653.040)       | (148.302.913)                        | (158.287.937)      |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)  | 26.001  | (66.913)          | (12.706.565)                         | (3.381.435)        |
|  | (2.158.911)   | (3.719.953)       | (161.009.478)                        | (161.669.372)      |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen  | (614.882)   | 8.342.056         | 292.648.834                          | 348.695.906        |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)   | (238.523)   | 132.111           | (23.659.866)                         | 24.401.986         |
|  | (853.405)   | 8.474.167         | 268.988.968                          | 373.097.892        |
| <b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b> | <b>(3.012.316)</b>                                  | <b>4.754.214</b>  | <b>107.979.490</b>                   | <b>211.428.520</b> |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

|  | Emerging Market Debt - Local Currency |                   | Emerging Market Debt Blend |                   |
|--|---------------------------------------|-------------------|----------------------------|-------------------|
|  | 31. Dezember 2024                     | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2024          | 31. Dezember 2023 |
|  | US\$                                  | US\$              | US\$                       | US\$              |
| <b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>  |                                       |                   |                            |                   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen  | (26.162.450)                          | (44.584.131)      | (24.473.209)               | (21.580.799)      |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)  | (17.483.944)                          | (48.092.632)      | (6.382.631)                | (4.256.866)       |
|  | (43.646.394)                          | (92.676.763)      | (30.855.840)               | (25.837.665)      |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen  | (11.468.900)                          | 110.241.381       | 13.028.468                 | 50.206.109        |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)   | (55.559.778)                          | 80.456.531        | (12.278.707)               | 12.011.863        |
|  | (67.028.678)                          | 190.697.912       | 749.761                    | 62.217.972        |
| <b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b> | <b>(110.675.072)</b>                  | <b>98.021.149</b> | <b>(30.106.079)</b>        | <b>36.380.307</b> |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

|  | Emerging Market Debt Sustainable Investment<br>Grade Blend |                   | Emerging Markets Equity |                   | Emerging Markets<br>Select Equity* |
|--|--|-------------------|-------------------------|-------------------|------------------------------------|
|  | 31. Dezember 2024  | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2024       | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2023                  |
|  | US\$   | US\$              | US\$                    | US\$              | US\$                               |
| <b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>  |  |                   |                         |                   |                                    |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen  | (1.696.361)  | (5.791.115)       | 14.716.179              | (20.729.912)      | 814.528                            |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)  | (594.353)  | (198.927)         | (1.589.384)             | (9.655.337)       | (4.139.010)                        |
|  | (2.290.714)  | (5.990.042)       | 13.126.795              | (30.385.249)      | (3.324.482)                        |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen  | (2.790.164)  | 5.676.743         | 9.680.323               | 31.028.370        | 2.969.544                          |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)   | (1.853.193)  | 1.563.693         | (2.755.890)             | 9.356.867         | 3.013.801                          |
|  | (4.643.357)  | 7.240.436         | 6.924.433               | 40.385.237        | 5.983.345                          |
| <b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b> | (6.934.071)  | 1.250.394         | 20.051.228              | 9.999.988         | 2.658.863                          |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

\* Der Emerging Markets Select Equity wurde am 7. September 2023 aufgelöst.

## FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

## Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

|  | Euro Bond         |                   | Euro Bond Absolute Return |                   |
|--|-------------------|-------------------|---------------------------|-------------------|
|  | 31. Dezember 2024 | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2024         | 31. Dezember 2023 |
|  | EUR               | EUR               | EUR                       | EUR               |
| <b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>  |                   |                   |                           |                   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen  | 439.120           | (341.755)         | 111.429                   | (537.540)         |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)  | (44)              | (38)              | 9.093                     | 32.645            |
|  | 439.076           | (341.793)         | 120.522                   | (504.895)         |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen  | 901.866           | 1.045.890         | 4.902.213                 | 2.177.741         |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)   | (234)             | (191)             | 100.952                   | 33.333            |
|  | 901.632           | 1.045.699         | 5.003.165                 | 2.211.074         |
| <b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b> | 1.340.708         | 703.906           | 5.123.687                 | 1.706.179         |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

|  | European High Yield Bond |                   | European Sustainable Equity |                   |
|--|--------------------------|-------------------|-----------------------------|-------------------|
|  | 31. Dezember 2024        | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2024           | 31. Dezember 2023 |
|  | EUR                      | EUR               | EUR                         | EUR               |
| <b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>  |                          |                   |                             |                   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen  | 14.795.385               | (2.829.393)       | 2.269.077                   | (13.057.162)      |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)  | 1.372.782                | (37.181)          | 328.810                     | (216.771)         |
|  | 16.168.167               | (2.866.574)       | 2.597.887                   | (13.273.933)      |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen  | 5.677.679                | 19.988.179        | 5.662.547                   | 41.047.636        |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)   | 2.061.023                | 136.601           | 349.044                     | 2.003.562         |
|  | 7.738.702                | 20.124.780        | 6.011.591                   | 43.051.198        |
| <b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b> | <b>23.906.869</b>        | <b>17.258.206</b> | <b>8.609.478</b>            | <b>29.777.265</b> |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

## FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

## Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

|  | Event Driven      |                   | Global Bond        |                   |
|--|-------------------|-------------------|--------------------|-------------------|
|  | 31. Dezember 2024 | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2024  | 31. Dezember 2023 |
|  | US\$              | US\$              | US\$               | US\$              |
| <b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>  |                   |                   |                    |                   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen  | 22.247.937        | 4.556.622         | (1.322.275)        | (8.533.831)       |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)  | 2.623             | (1.737)           | (460.758)          | (1.255.928)       |
|  | 22.250.560        | 4.554.885         | (1.783.033)        | (9.789.759)       |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen  | (15.619.607)      | 5.050.324         | (352.255)          | 10.407.766        |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)   | (14)              | 22                | (3.134.894)        | 2.216.541         |
|  | (15.619.621)      | 5.050.346         | (3.487.149)        | 12.624.307        |
| <b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b> | <b>6.630.939</b>  | <b>9.605.231</b>  | <b>(5.270.182)</b> | <b>2.834.548</b>  |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

|  | Global Diversified Income FMP – 2024* |                   | Global Equity Megatrends |                   |
|--|---------------------------------------|-------------------|--------------------------|-------------------|
|  | 31. Dezember 2024                     | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2024        | 31. Dezember 2023 |
|  | US\$                                  | US\$              | US\$                     | US\$              |
| <b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>  |                                       |                   |                          |                   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen  | (2.159.078)                           | (673.325)         | 17.414.588               | 4.899.408         |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)  | (462)                                 | (734)             | (56.303)                 | (32.081)          |
|  | (2.159.540)                           | (674.059)         | 17.358.285               | 4.867.327         |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen  | 3.744.103                             | 4.129.633         | 27.343.880               | 14.946.198        |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)   | 1                                     | (1)               | (1.370.884)              | 472.026           |
|  | 3.744.104                             | 4.129.632         | 25.972.996               | 15.418.224        |
| <b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b> | 1.584.564                             | 3.455.573         | 43.331.281               | 20.285.551        |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

\* Der Global Diversified Income FMP – 2024 wurde am 28. Juni 2024 aufgelöst. Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) entstanden ausschließlich aus eingestellter Geschäftstätigkeit.

## FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

## Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

|  | Global Flexible Credit Income |                   | Global High Yield Engagement |                   | Global High Yield Sustainable Action* |
|--|-------------------------------|-------------------|------------------------------|-------------------|---------------------------------------|
|  | 31. Dezember 2024             | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2024            | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2023                     |
|  | US\$                          | US\$              | US\$                         | US\$              | US\$                                  |
| <b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>  |                               |                   |                              |                   |                                       |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen  | 2.225.865                     | (1.617.442)       | 15.592.127                   | (6.863.220)       | (2.101.169)                           |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)  | (668.648)                     | (1.344.080)       | 385.267                      | 1.189.384         | (135.475)                             |
|  | 1.557.217                     | (2.961.522)       | 15.977.394                   | (5.673.836)       | (2.236.644)                           |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen  | 7.457.171                     | 33.775.896        | (11.303.381)                 | 29.380.435        | 2.276.456                             |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)   | (4.686.997)                   | 4.829.687         | (7.238.787)                  | 2.518.689         | 261.475                               |
|  | 2.770.174                     | 38.605.583        | (18.542.168)                 | 31.899.124        | 2.537.931                             |
| <b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b> | 4.327.391                     | 35.644.061        | (2.564.774)                  | 26.225.288        | 301.287                               |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

\* Der Global High Yield Sustainable Action wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

|  | Global Investment Grade Credit |                   | Global Opportunistic Bond |                   |
|--|--------------------------------|-------------------|---------------------------|-------------------|
|  | 31. Dezember 2024              | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2024         | 31. Dezember 2023 |
|  | US\$                           | US\$              | US\$                      | US\$              |
| <b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>  |                                |                   |                           |                   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen  | (2.819.989)                    | (8.106.722)       | (4.152.417)               | (8.077.899)       |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)  | 6.507                          | (493.689)         | (410.990)                 | (717.866)         |
|  | (2.813.482)                    | (8.600.411)       | (4.563.407)               | (8.795.765)       |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen  | 1.067.795                      | 11.728.916        | 6.382.422                 | 8.023.365         |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)   | (2.920.242)                    | 1.480.461         | (2.789.870)               | 2.587.374         |
|  | (1.852.447)                    | 13.209.377        | 3.592.552                 | 10.610.739        |
| <b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b> | (4.665.929)                    | 4.608.966         | (970.855)                 | 1.814.974         |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

## FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

## Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

|  | Global Real Estate Securities* |                   | Global Sustainable Equity |                   |
|--|--------------------------------|-------------------|---------------------------|-------------------|
|  | 31. Dezember 2024              | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2024         | 31. Dezember 2023 |
|  | US\$                           | US\$              | US\$                      | US\$              |
| <b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>  |                                |                   |                           |                   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen  | 192.837                        | (5.663.439)       | 3.674.602                 | (6.450.382)       |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)  | (437.458)                      | (796.662)         | (451.552)                 | (697.687)         |
|  | (244.621)                      | (6.460.101)       | 3.223.050                 | (7.148.069)       |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen  | (554.624)                      | 6.035.750         | 10.611.585                | 35.469.091        |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)   | (82.763)                       | 729.660           | (2.290.361)               | 2.465.642         |
|  | (637.387)                      | 6.765.410         | 8.321.224                 | 37.934.733        |
| <b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b> | <b>(882.008)</b>               | <b>305.309</b>    | <b>11.544.274</b>         | <b>30.786.664</b> |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

\* Der Global Real Estate Securities wurde am 31. Dezember 2024 aufgelöst. Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) entstanden ausschließlich aus eingestellter Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

|  | Global Value      |                   | High Yield Bond   |                   |
|--|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
|  | 31. Dezember 2024 | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2024 | 31. Dezember 2023 |
|  | US\$              | US\$              | US\$              | US\$              |
| <b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>  |                   |                   |                   |                   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen  | 8.900.994         | 768.987           | 20.919.024        | (162.753.558)     |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)  | (383.098)         | (281.087)         | (6.584)           | (4.742.596)       |
|  | 8.517.896         | 487.900           | 20.912.440        | (167.496.154)     |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen  | (1.490.218)       | 5.771.035         | (23.241.209)      | 269.412.476       |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)   | (1.025.052)       | 604.492           | (16.977)          | 6.186.033         |
|  | (2.515.270)       | 6.375.527         | (23.258.186)      | 275.598.509       |
| <b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b> | 6.002.626         | 6.863.427         | (2.345.746)       | 108.102.355       |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

## FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

## Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

|  | InnovAsia         |                   | Japan Equity Engagement |                   |
|--|-------------------|-------------------|-------------------------|-------------------|
|  | 31. Dezember 2024 | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2024       | 31. Dezember 2023 |
|  | US\$              | US\$              | JPY                     | JPY               |
| <b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>  |                   |                   |                         |                   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen  | 3.158.519         | 2.460.434         | 1.709.757.005           | 1.662.662.886     |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)  | (795.550)         | (473.540)         | (4.727.222)             | 2.045.222         |
|  | 2.362.969         | 1.986.894         | 1.705.029.783           | 1.664.708.108     |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen  | (201.405)         | 3.222.419         | 818.392.278             | 3.022.617.990     |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)   | (488.157)         | 109.786           | 110.431                 | 909.739           |
|  | (689.562)         | 3.332.205         | 818.502.709             | 3.023.527.729     |
| <b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b> | 1.673.407         | 5.319.099         | 2.523.532.492           | 4.688.235.837     |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

|  | Macro Opportunities FX* |                   | Multi-Asset Income** |
|--|-------------------------|-------------------|----------------------|
|  | 31. Dezember 2024       | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2023    |
|  | EUR                     | EUR               | US\$                 |
| <b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>  |                         |                   |                      |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen  | 47.041                  | (1.665.613)       | (1.243.160)          |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)  | 4.007                   | (6.824)           | (17.230)             |
|  | 51.048                  | (1.672.437)       | (1.260.390)          |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen  | (40.265)                | 938.724           | 1.261.196            |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)   | 698                     | (629)             | 121.256              |
|  | (39.567)                | 938.095           | 1.382.452            |
| <b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b> | 11.481                  | (734.342)         | 122.062              |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

\* Der Macro Opportunities FX wurde am 8. Februar 2024 aufgelöst. Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) entstanden ausschließlich aus eingestellter Geschäftstätigkeit.

\*\*Der Multi-Asset Income wurde am 6. Juli 2023 aufgelöst.

## FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

## Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

|  | Next Generation Connectivity |                    | Next Generation Mobility |                   |
|--|------------------------------|--------------------|--------------------------|-------------------|
|  | 31. Dezember 2024            | 31. Dezember 2023  | 31. Dezember 2024        | 31. Dezember 2023 |
|  | US\$                         | US\$               | US\$                     | US\$              |
| <b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>  |                              |                    |                          |                   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen  | 305.703.590                  | (90.236.077)       | 11.118.215               | 3.899.437         |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)  | (5.953.330)                  | (15.038.937)       | (2.625.205)              | (214.899)         |
|  | 299.750.260                  | (105.275.014)      | 8.493.010                | 3.684.538         |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen  | 35.309.668                   | 437.989.861        | (8.470.455)              | 37.448.812        |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)   | (15.487.545)                 | 9.973.331          | (634.943)                | 293.795           |
|  | 19.822.123                   | 447.963.192        | (9.105.398)              | 37.742.607        |
| <b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b> | <b>319.572.383</b>           | <b>342.688.178</b> | <b>(612.388)</b>         | <b>41.427.145</b> |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

|  | Next Generation Space Economy |                   | Short Duration Emerging Market Debt |                    |
|--|-------------------------------|-------------------|-------------------------------------|--------------------|
|  | 31. Dezember 2024             | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2024                   | 31. Dezember 2023  |
|  | US\$                          | US\$              | US\$                                | US\$               |
| <b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>  |                               |                   |                                     |                    |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen  | 2.286.270                     | 444.429           | (178.173.212)                       | (159.534.063)      |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)  | (24.618)                      | (7.147)           | (370.772)                           | 444.634            |
|  | 2.261.652                     | 437.282           | (178.543.984)                       | (159.089.429)      |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen  | 5.755.968                     | 2.752.444         | 133.911.494                         | 311.280.105        |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)   | (786.755)                     | 96.177            | (15.912.543)                        | 13.548.869         |
|  | 4.969.213                     | 2.848.621         | 117.998.951                         | 324.828.974        |
| <b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b> | <b>7.230.865</b>              | <b>3.285.903</b>  | <b>(60.545.033)</b>                 | <b>165.739.545</b> |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

|  | Short Duration Euro Bond |                   | Short Duration High Yield Engagement |                   |
|--|--------------------------|-------------------|--------------------------------------|-------------------|
|  | 31. Dezember 2024        | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2024                    | 31. Dezember 2023 |
|  | EUR                      | EUR               | US\$                                 | US\$              |
| <b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>  |                          |                   |                                      |                   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen  | 9.256.878                | (20.393.493)      | 8.289.720                            | (27.392.333)      |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)  | 2.736                    | (2.536)           | 203.829                              | (510.093)         |
|  | 9.259.614                | (20.396.029)      | 8.493.549                            | (27.902.426)      |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen  | 47.035.753               | 58.327.536        | (30.770.963)                         | 38.039.009        |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)   | 8.454                    | (478)             | (112.010)                            | 742.261           |
|  | 47.044.207               | 58.327.058        | (30.882.973)                         | 38.781.270        |
| <b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b> | 56.303.821               | 37.931.029        | (22.389.424)                         | 10.878.844        |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

|  | Strategic Income  |                   | Sustainable Asia High Yield |                   |
|--|-------------------|-------------------|-----------------------------|-------------------|
|  | 31. Dezember 2024 | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2024           | 31. Dezember 2023 |
|  | US\$              | US\$              | US\$                        | US\$              |
| <b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>  |                   |                   |                             |                   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen  | (784.513)         | (57.265.475)      | 932.241                     | (2.256.424)       |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)  | (5.755.856)       | (2.600.408)       | (59)                        | (296)             |
|  | (6.540.369)       | (59.865.883)      | 932.182                     | (2.256.720)       |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen  | (29.796.238)      | 114.117.019       | 1.694.187                   | 1.626.567         |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)   | (27.060.112)      | 6.891.526         | (116)                       | (71)              |
|  | (56.856.350)      | 121.008.545       | 1.694.071                   | 1.626.496         |
| <b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b> | (63.396.719)      | 61.142.662        | 2.626.253                   | (630.224)         |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

## FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

## Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

|  | Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency |                   | Tactical Macro <sup>1</sup> |                   |
|--|--|-------------------|-----------------------------|-------------------|
|  | 31. Dezember 2024                                | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2024           | 31. Dezember 2023 |
|  | US\$   | US\$              | US\$                        | US\$              |
| <b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>  |  |                   |                             |                   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen  | 6.012.290  | (27.069.296)      | 1.174.271                   | 491.415           |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)  | (321.650)  | (326.864)         | 44.221                      | (17.348)          |
|  | 5.690.640  | (27.396.160)      | 1.218.492                   | 474.067           |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen  | (5.198.813)                                      | 50.768.827        | (158.805)                   | 136.401           |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)   | (10.702.672)                                     | 2.287.533         | 4.166                       | (2.219)           |
|  | (15.901.485)                                     | 53.056.360        | (154.639)                   | 134.182           |
| <b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b> | (10.210.845)                                     | 25.660.200        | 1.063.853                   | 608.249           |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

|  | Uncorrelated Strategies |                   | Uncorrelated Trading* |
|--|-------------------------|-------------------|-----------------------|
|  | 31. Dezember 2024       | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2023     |
|  | US\$                    | US\$              | US\$                  |
| <b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>  |                         |                   |                       |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen  | 106.074.198             | 24.004.335        | 38.237.119            |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)  | (3.054.596)             | (2.592.765)       | 5.955.369             |
|  | 103.019.602             | 21.411.570        | 44.192.488            |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen  | (95.762.067)            | (132.790.013)     | (59.155.154)          |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)   | 11.480.294              | (9.003.026)       | 2.274.940             |
|  | (84.281.773)            | (141.793.039)     | (56.880.214)          |
| <b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b> | 18.737.829              | (120.381.469)     | (12.687.726)          |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

\* Der Uncorrelated Trading wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

## FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

## Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

|  | US Equity         |                   | US Equity Premium |                   |
|--|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
|  | 31. Dezember 2024 | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2024 | 31. Dezember 2023 |
|  | US\$              | US\$              | US\$              | US\$              |
| <b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>  |                   |                   |                   |                   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen  | 12.604.860        | (1.250.349)       | 100.942.395       | 89.267.388        |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)  | 5.145             | (795)             | (68.409)          | (109.858)         |
|  | 12.610.005        | (1.251.144)       | 100.873.986       | 89.157.530        |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen  | (2.018.474)       | 10.370.420        | (40.525.719)      | 18.479.312        |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)   | (3.038)           | 3.038             | 81                | (315)             |
|  | (2.021.512)       | 10.373.458        | (40.525.638)      | 18.478.997        |
| <b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b> | 10.588.493        | 9.122.314         | 60.348.348        | 107.636.527       |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

|  | US Large Cap Value |                   | US Long Short Equity |                   |
|--|--------------------|-------------------|----------------------|-------------------|
|  | 31. Dezember 2024  | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2024    | 31. Dezember 2023 |
|  | US\$               | US\$              | US\$                 | US\$              |
| <b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>  |                    |                   |                      |                   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen  | 46.747.019         | (24.835.964)      | (9.576.503)          | 4.533.923         |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)  | (1.123.589)        | (177.799)         | (637)                | (8.186)           |
|  | 45.623.430         | (25.013.763)      | (9.577.140)          | 4.525.737         |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen  | 54.696.665         | (46.789.502)      | 16.090.709           | 22.537.173        |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)   | 594                | (1.747)           | (75.160)             | 38.528            |
|  | 54.697.259         | (46.791.249)      | 16.015.549           | 22.575.701        |
| <b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b> | 100.320.689        | (71.805.012)      | 6.438.409            | 27.101.438        |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

## FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

## Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

|  | US Multi Cap Opportunities |                   | US Real Estate Securities |                   |
|--|----------------------------|-------------------|---------------------------|-------------------|
|  | 31. Dezember 2024          | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2024         | 31. Dezember 2023 |
|  | US\$                       | US\$              | US\$                      | US\$              |
| <b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>  |                            |                   |                           |                   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen  | 46.186.159                 | 39.332.501        | (26.684.608)              | (63.830.929)      |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)  | (6.665)                    | (702)             | 354                       | (2.165)           |
|  | 46.179.494                 | 39.331.799        | (26.684.254)              | (63.833.094)      |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen  | 18.459.539                 | 30.693.036        | 29.013.355                | 104.804.373       |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)   | (160)                      | 108               | (491)                     | (52)              |
|  | 18.459.379                 | 30.693.144        | 29.012.864                | 104.804.321       |
| <b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b> | 64.638.873                 | 70.024.943        | 2.328.610                 | 40.971.227        |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. Dezember 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

|  | US Small Cap      |                   | US Small Cap Intrinsic Value |                   |
|--|-------------------|-------------------|------------------------------|-------------------|
|  | 31. Dezember 2024 | 31. Dezember 2023 | 31. Dezember 2024            | 31. Dezember 2023 |
|  | US\$              | US\$              | US\$                         | US\$              |
| <b>Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen</b>  |                   |                   |                              |                   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen  | 10.415.049        | (8.421.635)       | 16.960.174                   | 7.330.787         |
| Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)  | (8.865)           | (26.746)          | (20.213)                     | (3.585)           |
|  | 10.406.184        | (8.448.381)       | 16.939.961                   | 7.327.202         |
| Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen  | 25.608.577        | 94.608.303        | 10.026.989                   | 26.969.758        |
| Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)   | (36.117)          | 1.970             | (378)                        | 170               |
|  | 25.572.460        | 94.610.273        | 10.026.611                   | 26.969.928        |
| <b>Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet</b> | 35.978.644        | 86.161.892        | 26.966.572                   | 34.297.130        |

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN

In Verfolgung seiner Anlageziele investiert der Fonds mit dem Ziel der Risikostreuung in übertragbare Wertpapiere. Durch die Anlage in Aktien und festverzinslichen Wertpapieren ergeben sich verschiedene Risiken für den Fonds, u. a. Markt-, Liquiditäts- und Kredit-/Gegenparteirisiken. Eine Darstellung der verschiedenen Risiken und der Strategien des Risikomanagements wird weiter unten gegeben. Zudem können die Folgen politischer, sozialer, wirtschaftlicher und diplomatischer Veränderungen oder der Zustand des Gesundheitswesens eine störende Wirkung auf die Marktpreise oder fairen Bewertungen von ausländischen Anlagen haben. Der beizulegende Zeitwert wird nach der in der Beschreibung der wesentlichen Bilanzierungsgrundsätze umrissenen Methode ermittelt. Die Aufstellungen des Wertpapierbestands der Portfolios zum Ende des Geschäftsjahres sind repräsentativ für die im Geschäftsjahr gehaltenen Anlageformen.

**Marktrisiko**

Das Marktrisiko verkörpert das Potenzial für sowohl Verluste als auch Gewinne und beinhaltet das Preisrisiko, das Zinsrisiko und das Fremdwährungsrisiko.

Alle Wertpapieranlagen unterliegen dem Risiko eines Kapitalverlustes. Der Manager und der Sub-Investment-Manager mindern dieses Risiko durch eine sorgfältige Auswahl der Wertpapiere und sonstigen Finanzinstrumente innerhalb vorgegebener Grenzen. Die gesamten Marktpositionen des Fonds werden vom Manager des Portfolios auf täglicher Basis überwacht und vierteljährlich von den Direktoren überprüft. Die Dividendenpapiere und Schuldtitel und zu Handelszwecken gehaltenen derivativen Finanzinstrumente des Fonds unterliegen einem Marktpreisänderungsrisiko, das sich aus der Ungewissheit hinsichtlich der künftigen Kursentwicklung der Instrumente ergibt.

**(a) Preisänderungsrisiko**

Das Preisänderungsrisiko ist das Risiko, dass die beizulegenden Zeitwerte von Wertpapieren infolge von Änderungen in den Indexständen und den Werten einzelner Wertpapiere fallen. Das Risikoexposure in Bezug auf den Handelspreis entsteht durch die Anlageportfolios des Fonds.

Der Großteil der Anlagen des Fonds ist gemäß Angabe im Verkaufsprospekt an anerkannten Börsen notiert oder wird an regulierten Märkten gehandelt. Zum 31. Dezember 2024 und 31. Dezember 2023 hätte ein 10%iger Anstieg der Wertpapierkurse einen Anstieg des Nettovermögens und der Veränderungen des Nettovermögens eines jeden Portfolios wie in der nachstehenden Tabelle aufgeführt zur Folge gehabt. Eine entgegengesetzte Änderung in gleicher Höhe hätte zu einer Abnahme des Nettovermögens in gleicher Höhe geführt.

| Portfolio   | Währung | 31. Dezember 2024 | % des Nettovermögens | 31. Dezember 2023 | % des Nettovermögens |
|---|---------|-------------------|----------------------|-------------------|----------------------|
| Absolute Return Multi Strategy*                         | USD     | –                 | –                    | 631               | 0,00 %               |
| Asia Responsible Transition Bond                        | USD     | 2.608.999         | 9,14 %               | 6.033.418         | 9,44 %               |
| China A-Share Equity                                    | CNY     | 1.468.283         | 10,01 %              | 1.348.094         | 9,48 %               |
| China Bond  | CNY     | 11.696.481        | 9,30 %               | 44.475.518        | 9,69 %               |
| China Equity  | USD     | 13.458.699        | 9,77 %               | 17.204.023        | 9,65 %               |
| Climate Innovation <sup>1</sup>                         | USD     | 294.918           | 9,57 %               | 283.140           | 9,69 %               |
| CLO Income  | USD     | 111.906.950       | 10,45 %              | 17.672.631        | 9,52 %               |
| Commodities   | USD     | 13.159.229        | 8,48 %               | 12.233.622        | 7,96 %               |
| Corporate Hybrid Bond                                   | EUR     | 218.577.191       | 9,33 %               | 175.890.908       | 9,41 %               |
| Developed Market FMP – 2027 <sup>1</sup>                | USD     | 12.561.062        | 9,86 %               | 13.581.666        | 9,88 %               |
| EMD Corporate – Social and Environmental Transition     | USD     | 10.990.324        | 9,66 %               | 9.209.439         | 9,42 %               |
| Emerging Market Debt - Hard Currency                    | USD     | 260.971.421       | 9,65 %               | 257.273.790       | 9,71 %               |
| Emerging Market Debt - Local Currency                   | USD     | 101.976.883       | 9,47 %               | 121.669.557       | 9,46 %               |
| Emerging Market Debt Blend                              | USD     | 45.302.586        | 8,77 %               | 49.557.893        | 9,41 %               |
| Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend | USD     | 5.131.388         | 8,92 %               | 6.082.402         | 9,35 %               |
| Emerging Markets Equity                                 | USD     | 10.522.209        | 10,06 %              | 8.826.906         | 9,73 %               |
| Euro Bond   | EUR     | 6.741.891         | 9,58 %               | 1.013.836         | 9,59 %               |
| Euro Bond Absolute Return                               | EUR     | 8.370.093         | 9,46 %               | 3.177.057         | 9,34 %               |
| European High Yield Bond                                | EUR     | 53.480.168        | 9,54 %               | 38.635.380        | 9,46 %               |
| European Sustainable Equity                             | EUR     | 14.723.816        | 9,92 %               | 17.122.579        | 9,95 %               |
| Event Driven  | USD     | 26.678.156        | 9,39 %               | 11.990.183        | 9,48 %               |
| Global Bond   | USD     | 9.689.518         | 9,52 %               | 10.728.468        | 9,87 %               |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

| Portfolio  | Währung | 31. Dezember 2024 | % des Nettovermögens | 31. Dezember 2023 | % des Nettovermögens |
|--|---------|-------------------|----------------------|-------------------|----------------------|
| Global Diversified Income FMP – 2024**           | USD     | –                 | –                    | 14.423.960        | 9,23 %               |
| Global Equity Megatrends                         | USD     | 49.324.213        | 9,51 %               | 14.149.305        | 9,79 %               |
| Global Flexible Credit Income                    | USD     | 43.477.711        | 9,77 %               | 35.947.816        | 9,20 %               |
| Global High Yield Engagement                     | USD     | 60.418.130        | 9,85 %               | 53.770.185        | 9,63 %               |
| Global Investment Grade Credit                   | USD     | 17.234.126        | 9,58 %               | 8.235.244         | 9,49 %               |
| Global Opportunistic Bond                        | USD     | 6.121.485         | 9,02 %               | 6.290.059         | 9,62 %               |
| Global Real Estate Securities***                 | USD     | –                 | –                    | 2.025.945         | 9,90 %               |
| Global Sustainable Equity                        | USD     | 13.963.583        | 9,94 %               | 15.360.342        | 9,94 %               |
| Global Value                                     | USD     | 4.663.798         | 10,00 %              | 5.494.503         | 9,91 %               |
| High Yield Bond                                  | USD     | 187.110.526       | 9,85 %               | 211.826.233       | 9,41 %               |
| InnovAsia  | USD     | 1.377.866         | 9,75 %               | 2.276.389         | 9,58 %               |
| Japan Equity Engagement                          | JPY     | 2.400.215.970     | 9,90 %               | 1.604.837.483     | 9,92 %               |
| Macro Opportunities FX****                       | EUR     | –                 | –                    | 276.814           | 9,61 %               |
| Next Generation Connectivity                     | USD     | 102.967.870       | 9,68 %               | 99.582.421        | 9,54 %               |
| Next Generation Mobility                         | USD     | 12.142.687        | 9,89 %               | 15.282.479        | 9,30 %               |
| Next Generation Space Economy                    | USD     | 5.520.274         | 9,38 %               | 1.867.472         | 9,46 %               |
| Short Duration Emerging Market Debt              | USD     | 369.995.109       | 9,80 %               | 387.324.439       | 9,79 %               |
| Short Duration Euro Bond                         | EUR     | 177.570.216       | 9,44 %               | 95.746.144        | 9,64 %               |
| Short Duration High Yield Engagement             | USD     | 53.839.285        | 9,87 %               | 68.981.565        | 9,27 %               |
| Strategic Income                                 | USD     | 456.635.991       | 9,85 %               | 213.789.986       | 10,59 %              |
| Sustainable Asia High Yield                      | USD     | 2.937.337         | 9,22 %               | 2.685.127         | 9,40 %               |
| Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency | USD     | 57.525.371        | 9,61 %               | 42.646.780        | 9,56 %               |
| Tactical Macro <sup>1</sup>                      | USD     | 3.307.266         | 9,19 %               | 2.316.731         | 8,53 %               |
| Uncorrelated Strategies                          | USD     | 42.541.487        | 5,27 %               | 97.630.396        | 6,00 %               |
| US Equity  | USD     | 10.513.576        | 9,82 %               | 4.700.718         | 9,55 %               |
| US Equity Premium                                | USD     | 61.262.426        | 9,30 %               | 66.969.604        | 9,19 %               |
| US Large Cap Value                               | USD     | 99.549.098        | 9,77 %               | 185.257.981       | 9,55 %               |
| US Long Short Equity                             | USD     | 19.311.274        | 8,53 %               | 17.344.585        | 8,87 %               |
| US Multi Cap Opportunities                       | USD     | 38.489.813        | 9,97 %               | 39.850.146        | 9,95 %               |
| US Real Estate Securities                        | USD     | 42.948.813        | 9,84 %               | 52.190.980        | 9,79 %               |
| US Small Cap                                     | USD     | 87.325.032        | 9,83 %               | 62.290.214        | 9,83 %               |
| US Small Cap Intrinsic Value                     | USD     | 39.475.580        | 9,86 %               | 30.173.640        | 9,38 %               |

\* Das Portfolio wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

\*\* Das Portfolio wurde am 28. Juni 2024 aufgelöst.

\*\*\* Das Portfolio wurde am 31. Dezember 2024 aufgelöst.

\*\*\*\* Das Portfolio wurde am 8. Februar 2024 aufgelöst.

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

Das sonstige Preisrisiko ist das Risiko, dass sich der Wert der Finanzinstrumente aufgrund von Marktpreisschwankungen (mit Ausnahme solcher, die von Zinsänderungs- oder Währungsrisiken hervorgerufen werden) verändert, sei es, dass diese Änderungen spezifischen Faktoren eines einzelnen Instruments oder seinem Emittenten zuzuordnen sind, oder dass sich alle Faktoren auf alle am Markt gehandelten Instrumente auswirken. Da der Großteil der Finanzinstrumente des Fonds zum beizulegenden Zeitwert ausgewiesen und die Veränderungen des beizulegenden Zeitwerts in der Gewinn- und Verlustrechnung erfasst werden, wirken sich Veränderungen der Marktbedingungen unmittelbar auf den Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten aus.

Das Preisrisiko wird durch den Manager gesteuert, indem er in ein diversifiziertes Spektrum von Wertpapieren auf verschiedenen Märkten investiert.

In den nachstehenden Tabellen sind die Preisrisiken der betreffenden Portfolios insgesamt zusammengefasst.

| Absolute Return Multi Strategy*  | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|----------------------------------|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|                                  | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien: |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar                        | 0                 | 0,00                      | 6.311             | 0,00                      |
|                                  | 0                 | 0,00                      | 6.311             | 0,00                      |

\* Das Portfolio wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

| Asia Responsible Transition Bond               | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|  | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Schatzwechsel:        |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar                                      | –                 | –                         | 2.496.736         | 3,90                      |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen: |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar                                      | 21.012.411        | 73,63                     | 45.692.223        | 71,46                     |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:       |                   |                           |                   |                           |
| Euro   | 968.841           | 3,40                      | 2.185.563         | 3,42                      |
| US-Dollar                                      | 4.124.660         | 14,45                     | 9.839.633         | 15,39                     |
|  | 5.093.501         | 17,85                     | 12.025.196        | 18,81                     |
|  | 26.105.912        | 91,48                     | 60.214.155        | 94,17                     |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto    | (15.927)          | (0,06)                    | 120.024           | 0,19                      |

| China A-Share Equity             | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|----------------------------------|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|                                  | Marktwert<br>CNY  | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>CNY  | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien: |                   |                           |                   |                           |
| Chinesischer Yuan Renminbi       | 14.041.820        | 95,77                     | 11.693.754        | 82,27                     |
| Hongkong-Dollar                  | 641.005           | 4,37                      | 1.787.183         | 12,57                     |
|                                  | 14.682.825        | 100,14                    | 13.480.937        | 94,84                     |

| China Bond                                       | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|  | Marktwert<br>CNY  | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>CNY  | % des Netto-<br>vermögens |
| Zu Handelszwecken gehaltene Einlagenzertifikate: |                   |                           |                   |                           |
| Chinesischer Yuan Renminbi                       | –                 | –                         | 58.557.000        | 12,76                     |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

| China Bond (Fortsetzung)                       | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|  | Marktwert<br>CNY  | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>CNY  | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen: |                   |                           |                   |                           |
| Chinesischer Yuan Renminbi                     | 37.954.821        | 30,18                     | 176.348.979       | 38,43                     |
| US-Dollar                                      | 31.460.831        | 25,02                     | 113.805.135       | 24,81                     |
|  | 69.415.652        | 55,20                     | 290.154.114       | 63,24                     |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:       |                   |                           |                   |                           |
| Chinesischer Yuan Renminbi                     | 47.383.173        | 37,69                     | 95.858.682        | 20,89                     |
|  | 116.798.825       | 92,89                     | 444.569.796       | 96,89                     |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto    | 165.980           | 0,14                      | 185.388           | 0,04                      |

| China Equity                                  | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|---|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|   | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien:              |                   |                           |                   |                           |
| Chinesischer Yuan Renminbi                    | 49.972.029        | 36,26                     | 74.424.135        | 41,76                     |
| Hongkong-Dollar                               | 75.988.557        | 55,14                     | 76.902.453        | 43,15                     |
| US-Dollar                                     | 8.552.100         | 6,20                      | 20.589.763        | 11,55                     |
|   | 134.512.686       | 97,60                     | 171.916.351       | 96,46                     |
| Für den Handel gehaltene Participatory Notes: |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar                                     | 255.378           | 0,19                      | –                 | –                         |
|   | 134.768.064       | 97,79                     | 171.916.351       | 96,46                     |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto   | (181.071)         | (0,13)                    | 123.876           | 0,07                      |

| Climate Innovation <sup>1</sup>  | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|----------------------------------|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|                                  | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien: |                   |                           |                   |                           |
| Chinesischer Yuan Renminbi       | 83.334            | 2,70                      | 22.928            | 0,78                      |
| Euro                             | 432.815           | 14,05                     | 423.545           | 14,49                     |
| Hongkong-Dollar                  | 120.122           | 3,90                      | 106.861           | 3,66                      |
| Indische Rupie                   | 109.562           | 3,55                      | –                 | –                         |
| Japanischer Yen                  | 171.632           | 5,57                      | 86.566            | 2,96                      |
| Neuer taiwanesischer Dollar      | 102.503           | 3,33                      | –                 | –                         |
| Norwegische Krone                | –                 | –                         | 7.036             | 0,24                      |
| Britisches Pfund                 | –                 | –                         | 91.036            | 3,12                      |
| Südkoreanischer Won              | 224.299           | 7,28                      | 228.261           | 7,81                      |
| Schweizer Franken                | 55.103            | 1,79                      | 59.474            | 2,04                      |
| US-Dollar                        | 1.649.812         | 53,54                     | 1.805.691         | 61,78                     |
|                                  | 2.949.182         | 95,71                     | 2.831.398         | 96,88                     |

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

| CLO Income  | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|---|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|   | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Schatzwechsel:                                   |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar   | 80.045.443        | 7,47                      | 4.994.906         | 2,69                      |
| Für den Handel gehaltene forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen): |                   |                           |                   |                           |
| Euro  | 513.677.981       | 47,96                     | 51.280.871        | 27,62                     |
| US-Dollar   | 420.440.999       | 39,25                     | 108.406.204       | 58,40                     |
|   | 934.118.980       | 87,21                     | 159.687.075       | 86,02                     |
| Für den Handel gehaltene Investmentfonds:                                 |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar   | –                 | –                         | 12.221.060        | 6,58                      |
| Für den Handel gehaltene Pensionsgeschäfte:                               |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar   | 84.500.000        | 7,89                      | –                 | –                         |
|   | 1.098.664.423     | 102,57                    | 176.903.041       | 95,29                     |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto                               | 20.405.072        | 1,90                      | (176.733)         | (0,09)                    |

| Commodities                                    | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|  | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Schatzwechsel:        |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar                                      | 47.615.993        | 30,70                     | 43.941.161        | 28,60                     |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen: |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar                                      | 85.264.336        | 54,97                     | 77.031.796        | 50,14                     |
|  | 132.880.329       | 85,67                     | 120.972.957       | 78,74                     |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto    | (1.288.042)       | (0,83)                    | 1.363.262         | 0,88                      |

| Corporate Hybrid Bond                          | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|  | Marktwert<br>EUR  | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>EUR  | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen: |                   |                           |                   |                           |
| Euro   | 1.503.382.017     | 64,16                     | 1.095.380.852     | 58,58                     |
| Britisches Pfund                               | 401.992.724       | 17,15                     | 430.873.063       | 23,05                     |
| US-Dollar                                      | 262.610.582       | 11,21                     | 217.329.710       | 11,62                     |
|  | 2.167.985.323     | 92,52                     | 1.743.583.625     | 93,25                     |
| Für den Handel gehaltene Pensionsgeschäfte:    |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar                                      | 14.002.897        | 0,60                      | –                 | –                         |
| Für den Handel gehaltene Investmentfonds:      |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar                                      | 12.265.572        | 0,52                      | 10.956.412        | 0,59                      |
|  | 2.194.253.792     | 93,64                     | 1.754.540.037     | 93,84                     |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto    | (8.481.885)       | (0,36)                    | 4.369.046         | 0,23                      |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

Developed Market FMP – 2027<sup>1</sup>

|  | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|  | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen: |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar                                      | 125.679.450       | 98,66                     | 135.777.186       | 98,78                     |
|  | 125.679.450       | 98,66                     | 135.777.186       | 98,78                     |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto    | (68.828)          | (0,06)                    | 39.476            | 0,03                      |

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

EMD Corporate – Social and Environmental Transition

|  | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|  | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen: |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar                                      | 105.120.488       | 92,44                     | 83.464.415        | 85,35                     |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:       |                   |                           |                   |                           |
| Euro   | 1.553.429         | 1,36                      | 3.224.557         | 3,30                      |
| US-Dollar                                      | 5.227.839         | 4,60                      | 3.943.827         | 4,03                      |
|  | 6.781.268         | 5,96                      | 7.168.384         | 7,33                      |
|  | 111.901.756       | 98,40                     | 90.632.799        | 92,68                     |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto    | (1.998.513)       | (1,76)                    | 1.461.588         | 1,50                      |

Emerging Market Debt - Hard Currency

|  | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|  | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen: |                   |                           |                   |                           |
| Euro   | 24.867.953        | 0,92                      | 22.351.770        | 0,84                      |
| US-Dollar                                      | 716.937.472       | 26,51                     | 710.090.994       | 26,80                     |
|  | 741.805.425       | 27,43                     | 732.442.764       | 27,64                     |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:       |                   |                           |                   |                           |
| Euro   | 392.510.247       | 14,51                     | 457.638.482       | 17,27                     |
| US-Dollar                                      | 1.421.317.899     | 52,56                     | 1.336.544.120     | 50,44                     |
|  | 1.813.828.146     | 67,07                     | 1.794.182.602     | 67,71                     |
| Für den Handel gehaltene Investmentfonds:      |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar                                      | –                 | –                         | 17.580.000        | 0,66                      |
| Für den Handel gehaltene Pensionsgeschäfte:    |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar                                      | 60.000.000        | 2,22                      | –                 | –                         |
|  | 2.615.633.571     | 96,72                     | 2.544.205.366     | 96,01                     |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto    | (5.919.357)       | (0,22)                    | 28.532.535        | 1,08                      |

Emerging Market Debt - Local Currency

|   | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|---|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|   | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Schatzwechsel: |                   |                           |                   |                           |
| Thailändischer Baht                     | –                 | –                         | 7.548.955         | 0,59                      |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

## Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

|   | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|---|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|   | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Schatzwechsel (Fortsetzung): |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar   | –                 | –                         | 25.792.195        | 2,00                      |
|   | –                 | –                         | 33.341.150        | 2,59                      |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:        |                   |                           |                   |                           |
| Chinesischer Yuan Renminbi                            | 8.247.994         | 0,77                      | 11.270.480        | 0,88                      |
| Kolumbianischer Peso                                  | 24.455.355        | 2,27                      | 21.548.196        | 1,67                      |
| Indische Rupie  | 3.008.124         | 0,28                      | –                 | –                         |
| Mexikanischer Peso                                    | 7.950.594         | 0,74                      | 9.006.924         | 0,70                      |
| Pakistanische Rupie                                   | 12.177.954        | 1,13                      | –                 | –                         |
|   | 55.840.021        | 5,19                      | 41.825.600        | 3,25                      |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:              |                   |                           |                   |                           |
| Chilenischer Peso                                     | 17.503.766        | 1,63                      | 27.343.613        | 2,13                      |
| Chinesischer Yuan Renminbi                            | 90.699.396        | 8,43                      | 82.382.352        | 6,41                      |
| Kolumbianischer Peso                                  | 53.946.074        | 5,01                      | 94.999.458        | 7,39                      |
| Costa Rican Colón                                     | 1.417.150         | 0,13                      | –                 | –                         |
| Tschechische Krone                                    | 41.259.426        | 3,83                      | 63.651.804        | 4,95                      |
| Peso Dominikanische Republik                          | 17.334.783        | 1,61                      | 6.712.333         | 0,52                      |
| Ägyptisches Pfund                                     | 15.612.449        | 1,45                      | –                 | –                         |
| Ghanaischer Cedi                                      | 1.981.502         | 0,19                      | 1.739.991         | 0,14                      |
| Ungarischer Forint                                    | 21.531.176        | 2,00                      | 35.686.547        | 2,77                      |
| Indische Rupie  | 90.948.385        | 8,45                      | –                 | –                         |
| Indonesische Rupiah                                   | 98.394.445        | 9,14                      | 134.059.168       | 10,43                     |
| Japanischer Yen                                       | 17.561            | 0,00                      | 24.384            | 0,00                      |
| Malaysischer Ringgit                                  | 85.495.681        | 7,94                      | 117.086.678       | 9,11                      |
| Mexikanischer Peso                                    | 72.636.260        | 6,75                      | 107.932.218       | 8,39                      |
| Peruanischer Sol                                      | 24.150.041        | 2,24                      | 38.254.182        | 2,97                      |
| Philippinischer Peso                                  | 18.933.429        | 1,76                      | 4.998.061         | 0,39                      |
| Polnischer Zloty                                      | 64.425.959        | 5,99                      | 123.314.997       | 9,59                      |
| Rumänischer neuer Leu                                 | 47.177.837        | 4,38                      | 40.252.372        | 3,13                      |
| Serbischer Dinar                                      | 4.728.851         | 0,44                      | 3.648.955         | 0,28                      |
| Südafrikanischer Rand                                 | 92.156.230        | 8,56                      | 122.163.844       | 9,50                      |
| Thailändischer Baht                                   | 63.277.661        | 5,88                      | 65.015.458        | 5,06                      |
| Türkische Lira  | 33.994.997        | 3,16                      | 20.116.212        | 1,56                      |
| Uganda-Schilling                                      | 5.599.503         | 0,52                      | 5.747.019         | 0,45                      |
| US-Dollar   | 4.824.768         | 0,45                      | 10.942.954        | 0,85                      |
| Uruguayischer Peso                                    | 1.913.944         | 0,18                      | 13.856.086        | 1,08                      |
| Sambischer Kwacha                                     | 4.761.707         | 0,44                      | 4.493.148         | 0,35                      |
|   | 974.722.981       | 90,56                     | 1.124.421.834     | 87,45                     |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

|   | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|---|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|   | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Investmentfonds:   |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar                                   | 4.040.368         | 0,37                      | 16.173.300        | 1,26                      |
|   | 1.034.603.370     | 96,12                     | 1.215.761.884     | 94,55                     |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | (14.834.544)      | (1,38)                    | 933.685           | 0,07                      |

Emerging Market Debt Blend

|  | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|  | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Schatzwechsel:        |                   |                           |                   |                           |
| Thailändischer Baht                            | –                 | –                         | 1.006.392         | 0,19                      |
|  | –                 | –                         | 1.006.392         | 0,19                      |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen: |                   |                           |                   |                           |
| Kolumbianischer Peso                           | 6.702.112         | 1,30                      | 6.891.239         | 1,31                      |
| Euro   | 1.082.819         | 0,21                      | 1.831.160         | 0,35                      |
| Indische Rupie                                 | 729.063           | 0,14                      | –                 | –                         |
| Mexikanischer Peso                             | 4.461.304         | 0,86                      | 5.189.750         | 0,98                      |
| Pakistanische Rupie                            | 2.865.401         | 0,56                      | –                 | –                         |
| US-Dollar                                      | 136.402.478       | 26,42                     | 134.165.703       | 25,47                     |
|  | 152.243.177       | 29,49                     | 148.077.852       | 28,11                     |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:       |                   |                           |                   |                           |
| Chilenischer Peso                              | 4.264.909         | 0,83                      | 3.606.443         | 0,69                      |
| Chinesischer Yuan Renminbi                     | 18.988.389        | 3,68                      | 18.928.714        | 3,59                      |
| Kolumbianischer Peso                           | 12.643.164        | 2,45                      | 20.288.878        | 3,85                      |
| Costa Rican Colón                              | 336.945           | 0,07                      | –                 | –                         |
| Tschechische Krone                             | 12.665.039        | 2,45                      | 15.841.841        | 3,01                      |
| Peso Dominikanische Republik                   | 3.856.810         | 0,75                      | 1.455.729         | 0,28                      |
| Ägyptisches Pfund                              | 3.161.521         | 0,61                      | –                 | –                         |
| Euro   | 17.482.754        | 3,39                      | 20.709.235        | 3,93                      |
| Ghanaischer Cedi                               | 407.082           | 0,08                      | 357.466           | 0,07                      |
| Ungarischer Forint                             | 4.743.413         | 0,92                      | 7.575.290         | 1,44                      |
| Indische Rupie                                 | 23.000.852        | 4,45                      | –                 | –                         |
| Indonesische Rupiah                            | 22.678.483        | 4,39                      | 29.206.946        | 5,54                      |
| Malaysischer Ringgit                           | 16.324.002        | 3,16                      | 24.205.015        | 4,60                      |
| Mexikanischer Peso                             | 13.546.658        | 2,62                      | 21.666.362        | 4,11                      |
| Peruanischer Sol                               | 5.592.112         | 1,08                      | 10.024.733        | 1,90                      |
| Philippinischer Peso                           | 4.351.126         | 0,84                      | 1.105.103         | 0,21                      |
| Polnischer Zloty                               | 12.641.690        | 2,45                      | 26.622.990        | 5,05                      |
| Rumänischer neuer Leu                          | 9.568.920         | 1,85                      | 8.334.386         | 1,58                      |
| Serbischer Dinar                               | 1.017.261         | 0,20                      | 790.524           | 0,15                      |
| Südafrikanischer Rand                          | 22.138.819        | 4,29                      | 26.084.532        | 4,95                      |
| Thailändischer Baht                            | 9.435.448         | 1,83                      | 17.287.737        | 3,28                      |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

## Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

|  | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|  | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen (Fortsetzung): |                   |                           |                   |                           |
| Türkische Lira   | 7.962.108         | 1,54                      | 4.286.125         | 0,81                      |
| Uganda-Schilling                                       | 1.334.949         | 0,26                      | 1.119.625         | 0,21                      |
| US-Dollar  | 74.870.718        | 14,50                     | 66.534.442        | 12,63                     |
| Uruguayischer Peso                                     | 464.536           | 0,09                      | 2.815.790         | 0,54                      |
| Sambischer Kwacha                                      | 1.038.553         | 0,20                      | 1.720.200         | 0,33                      |
|  | 304.516.261       | 58,98                     | 330.568.106       | 62,75                     |
| Für den Handel gehaltene Investmentfonds:              |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar  | 4.001.641         | 0,77                      | 14.297.035        | 2,72                      |
|  | 460.761.079       | 89,24                     | 493.949.385       | 93,77                     |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto            | (7.735.223)       | (1,50)                    | 1.629.543         | 0,31                      |

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend

|  | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|  | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Schatzwechsel:        |                   |                           |                   |                           |
| Thailändischer Baht                            | –                 | –                         | 37.793            | 0,06                      |
| US-Dollar                                      | –                 | –                         | 783.358           | 1,20                      |
|  | –                 | –                         | 821.151           | 1,26                      |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen: |                   |                           |                   |                           |
| Kolumbianischer Peso                           | 310.137           | 0,54                      | 167.215           | 0,26                      |
| Euro   | 87.033            | 0,15                      | 85.072            | 0,13                      |
| Indische Rupie                                 | 631.565           | 1,10                      | –                 | –                         |
| Mexikanischer Peso                             | 47.606            | 0,08                      | 48.823            | 0,08                      |
| US-Dollar                                      | 9.278.863         | 16,14                     | 8.938.496         | 13,73                     |
|  | 10.355.204        | 18,01                     | 9.239.606         | 14,20                     |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:       |                   |                           |                   |                           |
| Chilenischer Peso                              | 484.626           | 0,84                      | 369.265           | 0,57                      |
| Kolumbianischer Peso                           | 1.030.601         | 1,79                      | 1.612.874         | 2,48                      |
| Tschechische Krone                             | 948.149           | 1,65                      | 1.120.980         | 1,72                      |
| Euro   | 10.415.528        | 18,11                     | 15.173.869        | 23,32                     |
| Ungarischer Forint                             | 562.283           | 0,98                      | 789.996           | 1,21                      |
| Indische Rupie                                 | 1.655.993         | 2,88                      | –                 | –                         |
| Indonesische Rupiah                            | 2.834.096         | 4,93                      | 3.393.637         | 5,21                      |
| Malaysischer Ringgit                           | 1.866.596         | 3,25                      | 2.375.155         | 3,65                      |
| Mexikanischer Peso                             | 1.894.323         | 3,29                      | 3.218.001         | 4,95                      |
| Peruanischer Sol                               | 470.274           | 0,82                      | 572.240           | 0,88                      |
| Philippinischer Peso                           | 333.167           | 0,58                      | 86.705            | 0,13                      |
| Polnischer Zloty                               | 1.409.391         | 2,45                      | 1.877.970         | 2,89                      |
| Rumänischer neuer Leu                          | 1.028.138         | 1,79                      | 821.386           | 1,26                      |
| Thailändischer Baht                            | 1.052.628         | 1,83                      | 1.903.738         | 2,93                      |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

| Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend (Fortsetzung) | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|---|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|   | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen (Fortsetzung):                |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar   | 15.763.163        | 27,42                     | 14.720.671        | 22,63                     |
| Uruguayischer Peso  | 36.685            | 0,06                      | 230.078           | 0,35                      |
|   | 41.785.641        | 72,67                     | 48.266.565        | 74,18                     |
|   | 52.140.845        | 90,68                     | 58.327.322        | 89,64                     |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto                           | (826.964)         | (1,43)                    | 2.496.697         | 3,84                      |

| Emerging Markets Equity                                  | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|  | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien:                         |                   |                           |                   |                           |
| Brasilianischer Real                                     | 3.868.382         | 3,70                      | 4.893.129         | 5,39                      |
| Kanadischer Dollar                                       | –                 | –                         | 527.363           | 0,58                      |
| Chinesischer Yuan Renminbi                               | 5.057.126         | 4,84                      | 4.639.922         | 5,12                      |
| Euro   | 1.046.308         | 1,00                      | –                 | –                         |
| Hongkong-Dollar  | 18.136.274        | 17,35                     | 10.314.095        | 11,37                     |
| Ungarischer Forint                                       | 2.028.604         | 1,94                      | 1.548.368         | 1,71                      |
| Indische Rupie   | 25.223.654        | 24,12                     | 16.879.717        | 18,61                     |
| Indonesische Rupiah                                      | 1.258.601         | 1,20                      | 1.597.980         | 1,76                      |
| Japanischer Yen  | 610.856           | 0,58                      | –                 | –                         |
| Mexikanischer Peso                                       | 930.218           | 0,89                      | 2.453.962         | 2,71                      |
| Neuer taiwanesischer Dollar                              | 7.888.862         | 7,55                      | 6.570.941         | 7,25                      |
| Philippinischer Peso                                     | 1.070.871         | 1,02                      | 1.641.571         | 1,81                      |
| Polnischer Zloty   | 634.738           | 0,61                      | 986.834           | 1,09                      |
| Britisches Pfund   | 1.324.861         | 1,27                      | 2.327.741         | 2,57                      |
| Saudi-Arabischer Riyal                                   | 1.772.812         | 1,70                      | 3.794.106         | 4,18                      |
| Südafrikanischer Rand                                    | 2.158.146         | 2,06                      | 1.094.907         | 1,21                      |
| Südkoreanischer Won                                      | 8.022.977         | 7,67                      | 10.425.157        | 11,50                     |
| Thailändischer Baht                                      | –                 | –                         | 846.746           | 0,93                      |
| VAE-Dirham   | 2.294.052         | 2,19                      | 1.522.134         | 1,68                      |
| US-Dollar  | 18.282.582        | 17,48                     | 15.238.027        | 16,80                     |
| Vietnamesischer Dong                                     | 686.641           | 0,66                      | –                 | –                         |
|  | 102.296.565       | 97,83                     | 87.302.700        | 96,27                     |
| Für den Handel gehaltene Immobilienaktiengesellschaften: |                   |                           |                   |                           |
| Mexikanischer Peso                                       | 869.911           | 0,83                      | 481.105           | 0,53                      |
| Für den Handel gehaltene Participatory Notes:            |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar  | 3.146.146         | 3,01                      | –                 | –                         |
|  | 106.312.622       | 101,67                    | 87.783.805        | 96,80                     |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto              | (1.090.528)       | (1,04)                    | 485.257           | 0,53                      |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

| Euro Bond   | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|---|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|   | Marktwert<br>EUR  | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>EUR  | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen): |                   |                           |                   |                           |
| Euro  | –                 | –                         | 4.100             | 0,04                      |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:                            |                   |                           |                   |                           |
| Euro  | 33.145.394        | 47,08                     | 4.770.071         | 45,11                     |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:                                  |                   |                           |                   |                           |
| Euro  | 34.603.245        | 49,15                     | 5.399.389         | 51,07                     |
|   | 67.748.639        | 96,23                     | 10.173.560        | 96,22                     |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto                               | (329.730)         | (0,47)                    | (35.197)          | (0,33)                    |

| Euro Bond Absolute Return   | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|---|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|   | Marktwert<br>EUR  | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>EUR  | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen): |                   |                           |                   |                           |
| Euro  | 3.996.647         | 4,51                      | 158.727           | 0,46                      |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:                            |                   |                           |                   |                           |
| Dänische Krone  | 4.473.008         | 5,05                      | 1.314.538         | 3,86                      |
| Euro  | 34.608.849        | 39,10                     | 17.243.626        | 50,68                     |
| Britisches Pfund  | 2.134.299         | 2,41                      | –                 | –                         |
|   | 41.216.156        | 46,56                     | 18.558.164        | 54,54                     |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:                                  |                   |                           |                   |                           |
| Tschechische Krone  | 1.918.991         | 2,17                      | 400.377           | 1,18                      |
| Euro  | 30.694.628        | 34,68                     | 13.029.635        | 38,29                     |
| Japanischer Yen   | 213.140           | 0,24                      | –                 | –                         |
| Polnischer Zloty  | 1.427.520         | 1,61                      | 1.026.138         | 3,02                      |
| Britisches Pfund  | 719.010           | 0,81                      | –                 | –                         |
| US-Dollar   | 1.608.865         | 1,82                      | –                 | –                         |
|   | 36.582.154        | 41,33                     | 14.456.150        | 42,49                     |
|   | 81.794.957        | 92,40                     | 33.173.041        | 97,49                     |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto                               | 1.905.973         | 2,15                      | (1.402.468)       | (4,12)                    |

| European High Yield Bond  | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|---|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|   | Marktwert<br>EUR  | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>EUR  | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen): |                   |                           |                   |                           |
| Euro  | 4.796.698         | 0,86                      | 2.200.101         | 0,54                      |
| US-Dollar   | –                 | –                         | 225.240           | 0,05                      |
|   | 4.796.698         | 0,86                      | 2.425.341         | 0,59                      |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:                            |                   |                           |                   |                           |
| Euro  | 453.712.457       | 80,91                     | 325.684.785       | 79,74                     |
| Britisches Pfund  | 75.701.627        | 13,50                     | 58.748.951        | 14,39                     |
|   | 529.414.084       | 94,41                     | 384.433.736       | 94,13                     |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

| European High Yield Bond (Fortsetzung)                         | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|  | Marktwert<br>EUR  | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>EUR  | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene mittelfristige Schuldverschreibungen: |                   |                           |                   |                           |
| Euro   | –                 | –                         | 114.727           | 0,03                      |
|  | 534.210.782       | 95,27                     | 386.973.804       | 94,75                     |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto                    | 590.901           | 0,10                      | (620.006)         | (0,15)                    |

| European Sustainable Equity      | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|----------------------------------|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|                                  | Marktwert<br>EUR  | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>EUR  | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien: |                   |                           |                   |                           |
| Dänische Krone                   | 9.244.502         | 6,23                      | 13.482.070        | 7,83                      |
| Euro                             | 65.842.466        | 44,34                     | 84.501.324        | 49,10                     |
| Norwegische Krone                | 3.921.133         | 2,64                      | 5.211.834         | 3,03                      |
| Britisches Pfund                 | 35.092.849        | 23,63                     | 24.298.381        | 14,12                     |
| Schwedische Krone                | 9.347.207         | 6,29                      | 10.498.731        | 6,10                      |
| Schweizer Franken                | 21.255.641        | 14,31                     | 31.043.956        | 18,04                     |
| US-Dollar                        | 2.534.361         | 1,71                      | 2.189.494         | 1,27                      |
|                                  | 147.238.159       | 99,15                     | 171.225.790       | 99,49                     |

| Event Driven                                   | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|  | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Schatzwechsel:        |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar                                      | 81.352.423        | 28,65                     | 115.039.719       | 91,00                     |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen: |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar                                      | 195.788.600       | 68,94                     | –                 | –                         |
|  | 277.141.023       | 97,59                     | 115.039.719       | 91,00                     |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto    | (10.359.467)      | (3,66)                    | 4.862.107         | 3,85                      |

| Global Bond   | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|---|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|   | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Agency Bonds:                                    |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar   | 882.160           | 0,87                      | 1.146.538         | 1,05                      |
| Für den Handel gehaltene forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen): |                   |                           |                   |                           |
| Euro  | 2.320.226         | 2,28                      | 2.971.034         | 2,73                      |
| Britisches Pfund  | 928.543           | 0,91                      | 670.026           | 0,62                      |
| US-Dollar   | 10.049.375        | 9,88                      | 7.223.446         | 6,64                      |
|   | 13.298.144        | 13,07                     | 10.864.506        | 9,99                      |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:                            |                   |                           |                   |                           |
| Australischer Dollar  | 741.704           | 0,73                      | –                 | –                         |
| Dänische Krone  | 976.075           | 0,96                      | 1.030.253         | 0,95                      |
| Euro  | 7.574.137         | 7,44                      | 6.226.360         | 5,73                      |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

## Global Bond (Fortsetzung)

|  | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|  | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen (Fortsetzung): |                   |                           |                   |                           |
| Japanischer Yen  | 627.904           | 0,62                      | –                 | –                         |
| Britisches Pfund   | 2.147.596         | 2,11                      | 1.678.151         | 1,54                      |
| US-Dollar  | 19.381.272        | 19,05                     | 19.920.838        | 18,32                     |
|  | 31.448.688        | 30,91                     | 28.855.602        | 26,54                     |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:                     |                   |                           |                   |                           |
| Australischer Dollar   | 1.621.198         | 1,59                      | 1.422.394         | 1,31                      |
| Kanadischer Dollar   | 2.281.961         | 2,24                      | 2.436.049         | 2,24                      |
| Euro   | 12.168.380        | 11,96                     | 18.727.042        | 17,22                     |
| Indonesische Rupiah  | –                 | –                         | 2.422.585         | 2,23                      |
| Japanischer Yen  | 6.077.466         | 5,97                      | 4.550.365         | 4,19                      |
| Mexikanischer Peso   | 211.544           | 0,21                      | 819.455           | 0,75                      |
| Neuseeländischer Dollar                                      | 634.099           | 0,62                      | 682.094           | 0,63                      |
| Polnischer Zloty   | 276.025           | 0,27                      | 302.813           | 0,28                      |
| Britisches Pfund   | 2.573.271         | 2,53                      | 2.448.473         | 2,25                      |
| Singapur-Dollar  | 206.342           | 0,20                      | –                 | –                         |
| Südkoreanischer Won  | 2.184.936         | 2,15                      | 2.429.774         | 2,23                      |
| Schweizer Franken  | 381.832           | 0,38                      | 399.725           | 0,37                      |
| US-Dollar  | 3.524.327         | 3,47                      | 5.840.805         | 5,37                      |
|  | 32.141.381        | 31,59                     | 42.481.574        | 39,07                     |
| Für den Handel gehaltene Mortgage-Backed Securities:         |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar  | 18.149.436        | 17,84                     | 22.645.649        | 20,82                     |
| Für den Handel gehaltene Kommunalanleihen:                   |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar  | 1.123.978         | 1,10                      | 1.278.776         | 1,18                      |
|  | 97.043.787        | 95,38                     | 107.272.645       | 98,65                     |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto                  | (148.607)         | (0,14)                    | 12.036            | 0,01                      |

## Global Diversified Income FMP – 2024\*\*

|  | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|  | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Schatzwechsel:        |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar                                      | –                 | –                         | 18.765.889        | 12,01                     |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen: |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar                                      | –                 | –                         | 123.463.985       | 79,04                     |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:       |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar                                      | –                 | –                         | 1.727.993         | 1,11                      |
|  | –                 | –                         | 143.957.867       | 92,16                     |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto    | –                 | –                         | 281.732           | 0,18                      |

\*\* Das Portfolio wurde am 28. Juni 2024 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

| Global Equity Megatrends                    | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|---|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|   | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien:            |                   |                           |                   |                           |
| Kanadischer Dollar                          | 17.053.161        | 3,29                      | 5.599.812         | 3,88                      |
| Britisches Pfund                            | 27.947.428        | 5,39                      | 7.576.699         | 5,24                      |
| US-Dollar                                   | 448.456.675       | 86,47                     | 128.316.090       | 88,81                     |
|   | 493.457.264       | 95,15                     | 141.492.601       | 97,93                     |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | (215.132)         | (0,04)                    | 444               | 0,00                      |

| Global Flexible Credit Income   | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|---|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|   | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien:  |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar   | 6.584.306         | 1,48                      | 6.022.083         | 1,54                      |
| Für den Handel gehaltene forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen): |                   |                           |                   |                           |
| Euro  | 2.848.423         | 0,64                      | –                 | –                         |
| Britisches Pfund  | 1.233.434         | 0,28                      | –                 | –                         |
| US-Dollar   | 61.138.048        | 13,74                     | 23.118.219        | 5,92                      |
|   | 65.219.905        | 14,66                     | 23.118.219        | 5,92                      |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:                            |                   |                           |                   |                           |
| Euro  | 71.688.910        | 16,12                     | 63.284.923        | 16,20                     |
| Britisches Pfund  | 17.076.190        | 3,84                      | 10.735.064        | 2,75                      |
| US-Dollar   | 229.920.987       | 51,68                     | 222.253.475       | 56,90                     |
|   | 318.686.087       | 71,64                     | 296.273.462       | 75,85                     |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:                                  |                   |                           |                   |                           |
| Euro  | 1.750.069         | 0,39                      | 1.992.091         | 0,51                      |
| US-Dollar   | 7.864.471         | 1,77                      | 13.387.657        | 3,43                      |
|   | 9.614.540         | 2,16                      | 15.379.748        | 3,94                      |
| Für den Handel gehaltene mittelfristige Schuldverschreibungen:            |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar   | 37.505.823        | 8,43                      | 15.105.874        | 3,87                      |
| Für den Handel gehaltene Investmentfonds:                                 |                   |                           |                   |                           |
| Britisches Pfund  | 6.944             | 0,00                      | 66.832            | 0,01                      |
|   | 437.617.605       | 98,37                     | 355.966.218       | 91,13                     |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto                               | (2.840.499)       | (0,64)                    | 3.511.941         | 0,90                      |

| Global High Yield Engagement                   | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|  | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen: |                   |                           |                   |                           |
| Euro   | 114.665.200       | 18,70                     | 96.138.657        | 17,23                     |
| Britisches Pfund                               | 23.655.825        | 3,85                      | 17.609.057        | 3,14                      |
| US-Dollar                                      | 446.467.416       | 72,76                     | 418.751.767       | 75,03                     |
|  | 584.788.441       | 95,31                     | 532.499.481       | 95,40                     |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

## Global High Yield Engagement (Fortsetzung)

|  | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|  | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene mittelfristige Schuldverschreibungen: |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar  | 6.832.101         | 1,11                      | 4.933             | 0,00                      |
| Für den Handel gehaltene Pensionsgeschäfte:                    |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar  | 15.500.000        | 2,53                      | –                 | –                         |
|  | 607.120.542       | 98,95                     | 532.504.414       | 95,40                     |
| Für den Handel gehaltene umgekehrte Pensionsgeschäfte          | (999.796)         | (0,16)                    | –                 | –                         |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto                    | (1.939.448)       | (0,32)                    | 5.197.440         | 0,93                      |

## Global Investment Grade Credit

|  | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|  | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen: |                   |                           |                   |                           |
| Kanadischer Dollar                             | 1.924.789         | 1,07                      | 2.045.372         | 2,36                      |
| Euro   | 34.499.012        | 19,18                     | 17.112.649        | 19,72                     |
| Britisches Pfund                               | 21.513.302        | 11,96                     | 6.421.929         | 7,40                      |
| US-Dollar                                      | 114.239.603       | 63,51                     | 55.796.371        | 64,30                     |
|  | 172.176.706       | 95,72                     | 81.376.321        | 93,78                     |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:       |                   |                           |                   |                           |
| Euro   | –                 | –                         | 758.536           | 0,87                      |
| US-Dollar                                      | –                 | –                         | 1.323.918         | 1,53                      |
|  | –                 | –                         | 2.082.454         | 2,40                      |
|  | 172.176.706       | 95,72                     | 83.458.775        | 96,18                     |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto    | 164.555           | 0,09                      | (1.106.335)       | (1,28)                    |

## Global Opportunistic Bond

|   | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|---|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|   | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen): |                   |                           |                   |                           |
| Euro  | 88.727            | 0,13                      | 384.235           | 0,59                      |
| Britisches Pfund  | –                 | –                         | 67.935            | 0,10                      |
| US-Dollar   | 266.119           | 0,39                      | 1.365.573         | 2,09                      |
|   | 354.846           | 0,52                      | 1.817.743         | 2,78                      |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:                            |                   |                           |                   |                           |
| Australischer Dollar  | 461.120           | 0,68                      | –                 | –                         |
| Euro  | 17.491.681        | 25,76                     | 17.426.821        | 26,65                     |
| Britisches Pfund  | 4.294.501         | 6,33                      | 4.452.439         | 6,80                      |
| US-Dollar   | 4.638.258         | 6,83                      | 5.532.795         | 8,46                      |
|   | 26.885.560        | 39,60                     | 27.412.055        | 41,91                     |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:                                  |                   |                           |                   |                           |
| Australischer Dollar  | 842.058           | 1,24                      | 806.754           | 1,23                      |
| Chinesischer Yuan Renminbi  | 893.826           | 1,32                      | 1.976.796         | 3,02                      |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

Global Opportunistic Bond (Fortsetzung)

|  | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|  | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen (Fortsetzung): |                   |                           |                   |                           |
| Tschechische Krone                                     | 1.308.445         | 1,93                      | 514.023           | 0,79                      |
| Euro   | 4.683.676         | 6,90                      | 5.428.488         | 8,29                      |
| Ungarischer Forint                                     | 858.531           | 1,26                      | 288.139           | 0,44                      |
| Indonesische Rupiah                                    | 1.953.739         | 2,88                      | 1.613.604         | 2,47                      |
| Japanischer Yen  | 1.018.200         | 1,50                      | –                 | –                         |
| Mexikanischer Peso                                     | 2.706.335         | 3,99                      | 2.891.430         | 4,42                      |
| Neuseeländischer Dollar                                | 1.067.538         | 1,57                      | 3.053.390         | 4,67                      |
| Polnischer Zloty                                       | –                 | –                         | 980.709           | 1,50                      |
| Britisches Pfund                                       | 681.227           | 1,00                      | 413.338           | 0,63                      |
| Südkoreanischer Won                                    | 226.728           | 0,33                      | 258.205           | 0,40                      |
| Thailändischer Baht                                    | 277.263           | 0,41                      | 267.740           | 0,41                      |
| US-Dollar  | 3.540.696         | 5,22                      | 2.640.767         | 4,04                      |
|  | 20.058.262        | 29,55                     | 21.133.383        | 32,31                     |
| Für den Handel gehaltene Mortgage-Backed Securities:   |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar  | 11.517.944        | 16,97                     | 14.565.802        | 22,27                     |
| Für den Handel gehaltene Investmentfonds:              |                   |                           |                   |                           |
| Britisches Pfund                                       | 2.199             | 0,00                      | 21.165            | 0,03                      |
|  | 58.818.811        | 86,64                     | 64.950.148        | 99,30                     |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto            | 2.396.040         | 3,53                      | (2.049.562)       | (3,14)                    |

Global Real Estate Securities\*\*\*

|  | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|  | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien:                         |                   |                           |                   |                           |
| Kanadischer Dollar                                       | –                 | –                         | 117.134           | 0,57                      |
| Euro   | –                 | –                         | 157.095           | 0,77                      |
| Hongkong-Dollar  | –                 | –                         | 788.347           | 3,86                      |
| Japanischer Yen  | –                 | –                         | 729.085           | 3,56                      |
| Britisches Pfund   | –                 | –                         | 383.800           | 1,87                      |
| Singapur-Dollar  | –                 | –                         | 535.593           | 2,62                      |
| Schweizer Franken  | –                 | –                         | 304.936           | 1,49                      |
|  | –                 | –                         | 3.015.990         | 14,74                     |
| Für den Handel gehaltene Immobilienaktiengesellschaften: |                   |                           |                   |                           |
| Australischer Dollar                                     | –                 | –                         | 1.038.510         | 5,08                      |
| Kanadischer Dollar                                       | –                 | –                         | 710.266           | 3,47                      |
| Euro   | –                 | –                         | 1.332.446         | 6,51                      |
| Hongkong-Dollar  | –                 | –                         | 162.068           | 0,79                      |
| Japanischer Yen  | –                 | –                         | 1.009.965         | 4,94                      |
| Britisches Pfund   | –                 | –                         | 799.443           | 3,91                      |
| Singapur-Dollar  | –                 | –                         | 199.240           | 0,97                      |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

| Global Real Estate Securities*** (Fortsetzung)                         | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|  | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Immobilienaktiengesellschaften (Fortsetzung): |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar  | –                 | –                         | 11.819.730        | 57,77                     |
|  | –                 | –                         | 17.071.668        | 83,44                     |
|  | –                 | –                         | 20.087.658        | 98,18                     |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto                            | (57.559)          | (0,00)                    | 171.794           | 0,84                      |

\*\*\* Das Portfolio wurde am 31. Dezember 2024 aufgelöst.

| Global Sustainable Equity        | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|----------------------------------|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|                                  | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien: |                   |                           |                   |                           |
| Dänische Krone                   | 2.223.604         | 1,58                      | 2.356.638         | 1,52                      |
| Euro                             | 13.664.252        | 9,73                      | 17.578.770        | 11,37                     |
| Japanischer Yen                  | 2.929.728         | 2,09                      | 2.808.506         | 1,82                      |
| Norwegische Krone                | 3.241.682         | 2,31                      | 3.832.389         | 2,48                      |
| Britisches Pfund                 | 6.183.245         | 4,40                      | 4.527.650         | 2,93                      |
| Schwedische Krone                | 4.079.638         | 2,91                      | 4.357.908         | 2,82                      |
| Schweizer Franken                | 8.065.868         | 5,74                      | 12.094.419        | 7,82                      |
| US-Dollar                        | 99.247.813        | 70,68                     | 106.047.139       | 68,61                     |
|                                  | 139.635.830       | 99,44                     | 153.603.419       | 99,37                     |

| Global Value                     | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|----------------------------------|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|                                  | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien: |                   |                           |                   |                           |
| Australischer Dollar             | 903.058           | 1,94                      | 1.631.790         | 2,94                      |
| Brasilianischer Real             | 434.055           | 0,93                      | 566.280           | 1,02                      |
| Kanadischer Dollar               | 2.076.292         | 4,44                      | 2.053.991         | 3,70                      |
| Euro                             | 3.346.712         | 7,18                      | 4.792.613         | 8,65                      |
| Hongkong-Dollar                  | 2.105.080         | 4,52                      | 1.646.031         | 2,97                      |
| Indonesische Rupiah              | –                 | –                         | 192.941           | 0,35                      |
| Japanischer Yen                  | 2.189.105         | 4,70                      | 3.141.436         | 5,66                      |
| Mexikanischer Peso               | 125.915           | 0,27                      | 397.431           | 0,72                      |
| Neuer taiwanesischer Dollar      | 948.202           | 2,03                      | 1.041.760         | 1,88                      |
| Neuseeländischer Dollar          | –                 | –                         | 110.969           | 0,20                      |
| Norwegische Krone                | 343.241           | 0,74                      | 364.222           | 0,66                      |
| Britisches Pfund                 | 1.659.951         | 3,56                      | 2.659.501         | 4,80                      |
| Singapur-Dollar                  | 320.538           | 0,69                      | 245.963           | 0,44                      |
| Südafrikanischer Rand            | 284.115           | 0,61                      | 199.332           | 0,36                      |
| Südkoreanischer Won              | 164.942           | 0,35                      | 794.977           | 1,43                      |
| Schwedische Krone                | 268.689           | 0,57                      | 133.986           | 0,24                      |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

| Global Value (Fortsetzung)                               | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|  | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien (Fortsetzung):           |                   |                           |                   |                           |
| Schweizer Franken  | 1.040.237         | 2,23                      | 1.191.665         | 2,15                      |
| US-Dollar  | 29.665.427        | 63,58                     | 32.644.183        | 58,84                     |
|  | 45.875.559        | 98,34                     | 53.809.071        | 97,01                     |
| Für den Handel gehaltene Immobilienaktiengesellschaften: |                   |                           |                   |                           |
| Australischer Dollar                                     | –                 | –                         | 50.247            | 0,09                      |
| Euro   | 101.042           | 0,22                      | 65.321            | 0,12                      |
| Britisches Pfund   | –                 | –                         | 21.788            | 0,04                      |
| US-Dollar  | 690.251           | 1,48                      | 979.048           | 1,77                      |
|  | 791.293           | 1,70                      | 1.116.404         | 2,02                      |
|  | 46.666.852        | 100,04                    | 54.925.475        | 99,03                     |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto              | (28.870)          | (0,06)                    | 19.551            | 0,04                      |

| High Yield Bond   | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|---|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|   | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen): |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar   | 29.468.224        | 1,55                      | 10.897.982        | 0,49                      |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:                            |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar   | 1.753.492.450     | 92,33                     | 1.999.177.351     | 88,78                     |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:                                  |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar   | –                 | –                         | 36.225.768        | 1,61                      |
| Für den Handel gehaltene mittelfristige Schuldverschreibungen:            |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar   | 65.626.148        | 3,45                      | 43.084.058        | 1,91                      |
| Für den Handel gehaltene Pensionsgeschäfte:                               |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar   | 66.000.000        | 3,48                      | –                 | –                         |
| Für den Handel gehaltene Investmentfonds:                                 |                   |                           |                   |                           |
| Britisches Pfund  | 375.146           | 0,02                      | 3.611.285         | 0,16                      |
|   | 1.914.961.968     | 100,83                    | 2.092.996.444     | 92,95                     |
| Für den Handel gehaltene umgekehrte Pensionsgeschäfte                     | (3.063.764)       | (0,16)                    | –                 | –                         |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto                               | (40.792.940)      | (2,15)                    | 25.265.889        | 1,12                      |

| InnovAsia                        | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|----------------------------------|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|                                  | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien: |                   |                           |                   |                           |
| Australischer Dollar             | 676.438           | 4,78                      | 173.907           | 0,73                      |
| Chinesischer Yuan Renminbi       | 290.768           | 2,06                      | 1.007.839         | 4,24                      |
| Hongkong-Dollar                  | 458.779           | 3,24                      | –                 | –                         |
| Indische Rupie                   | 1.476.507         | 10,44                     | 2.729.942         | 11,49                     |
| Japanischer Yen                  | 4.494.394         | 31,79                     | 6.224.873         | 26,19                     |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

| InnovAsia (Fortsetzung)                                | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|  | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien (Fortsetzung):         |                   |                           |                   |                           |
| Malaysischer Ringgit                                   | 312.131           | 2,21                      | 481.076           | 2,02                      |
| Neuer taiwanesischer Dollar                            | 3.838.688         | 27,15                     | 5.480.052         | 23,05                     |
| Singapur-Dollar  | –                 | –                         | 563.158           | 2,37                      |
| Südkoreanischer Won                                    | 1.325.934         | 9,38                      | 3.391.560         | 14,27                     |
| Thailändischer Baht                                    | 87.862            | 0,62                      | 715.164           | 3,01                      |
| US-Dollar  | 695.402           | 4,92                      | 1.208.522         | 5,08                      |
| Vietnamesischer Dong                                   | 527.386           | 3,73                      | 548.794           | 2,31                      |
|  | 14.184.289        | 100,32                    | 22.524.887        | 94,76                     |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto            | (405.625)         | (2,87)                    | 238.999           | 1,01                      |
| <b>Japan Equity Engagement</b>                         |                   |                           |                   |                           |
|  | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|  | Marktwert<br>JPY  | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>JPY  | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien:                       |                   |                           |                   |                           |
| Japanischer Yen  | 24.001.431.600    | 99,05                     | 15.961.893.000    | 98,67                     |
|  | 24.001.431.600    | 99,05                     | 15.961.893.000    | 98,67                     |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto            | 728.101           | 0,00                      | 86.481.827        | 0,53                      |
| <b>Macro Opportunities FX****</b>                      |                   |                           |                   |                           |
|  | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|  | Marktwert<br>EUR  | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>EUR  | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Schatzwechsel:                |                   |                           |                   |                           |
| Euro   | –                 | –                         | 2.407.376         | 83,54                     |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:               |                   |                           |                   |                           |
| Euro   | –                 | –                         | 347.166           | 12,04                     |
|  | –                 | –                         | 2.754.542         | 95,58                     |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto            | –                 | –                         | 13.600            | 0,48                      |
| **** Das Portfolio wurde am 8. Februar 2024 aufgelöst. |                   |                           |                   |                           |
| <b>Next Generation Connectivity</b>                    |                   |                           |                   |                           |
|  | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|  | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien:                       |                   |                           |                   |                           |
| Chinesischer Yuan Renminbi                             | –                 | –                         | 2.360.602         | 0,23                      |
| Euro   | 75.152.630        | 7,07                      | 81.417.322        | 7,80                      |
| Japanischer Yen  | 92.346.774        | 8,69                      | 102.820.574       | 9,85                      |
| Neuer taiwanesischer Dollar                            | 96.312.068        | 9,06                      | 90.475.913        | 8,67                      |
| Südkoreanischer Won                                    | 34.837.751        | 3,28                      | 26.816.617        | 2,57                      |
| US-Dollar  | 741.280.517       | 69,72                     | 686.624.280       | 65,80                     |
|  | 1.039.929.740     | 97,82                     | 990.515.308       | 94,92                     |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto            | (10.251.045)      | (0,97)                    | 5.308.901         | 0,51                      |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

| Next Generation Mobility                                 | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|  | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien:                         |                   |                           |                   |                           |
| Kanadischer Dollar                                       | –                 | –                         | 923.624           | 0,56                      |
| Chinesischer Yuan Renminbi                               | 5.594.279         | 4,56                      | 821.040           | 0,50                      |
| Euro   | 13.991.014        | 11,39                     | 8.462.265         | 5,15                      |
| Hongkong-Dollar  | 4.839.192         | 3,94                      | 3.671.609         | 2,23                      |
| Japanischer Yen  | 6.026.743         | 4,91                      | 3.261.498         | 1,98                      |
| Neuer taiwanesischer Dollar                              | 1.526.148         | 1,24                      | 1.653.606         | 1,01                      |
| Südkoreanischer Won                                      | 14.737.459        | 12,00                     | 1.389.795         | 0,85                      |
| Schwedische Krone  | –                 | –                         | 2.040.128         | 1,24                      |
| Schweizer Franken  | 2.758.361         | 2,25                      | –                 | –                         |
| US-Dollar  | 71.964.364        | 58,61                     | 128.971.071       | 78,47                     |
|  | 121.437.560       | 98,90                     | 151.194.636       | 91,99                     |
| Für den Handel gehaltene Immobilienaktiengesellschaften: |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar  | –                 | –                         | 1.619.728         | 0,99                      |
|  | 121.437.560       | 98,90                     | 152.814.364       | 92,98                     |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto              | (10.687)          | (0,01)                    | 10.424            | 0,00                      |

| Next Generation Space Economy    | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|----------------------------------|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|                                  | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien: |                   |                           |                   |                           |
| Kanadischer Dollar               | 1.951.666         | 3,32                      | –                 | –                         |
| Chinesischer Yuan Renminbi       | –                 | –                         | 291.964           | 1,48                      |
| Euro                             | 6.233.939         | 10,59                     | 2.149.013         | 10,88                     |
| Japanischer Yen                  | 5.600.463         | 9,51                      | 1.343.794         | 6,81                      |
| Neuer taiwanesischer Dollar      | –                 | –                         | 190.613           | 0,96                      |
| Britisches Pfund                 | 1.597.438         | 2,71                      | 714.841           | 3,62                      |
| Singapur-Dollar                  | 1.628.028         | 2,77                      | 591.271           | 2,99                      |
| Südkoreanischer Won              | 1.291.104         | 2,19                      | 1.016.293         | 5,15                      |
| US-Dollar                        | 36.900.101        | 62,69                     | 12.376.927        | 62,69                     |
|                                  | 55.202.739        | 93,78                     | 18.674.716        | 94,58                     |

| Short Duration Emerging Market Debt            | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|  | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Schatzwechsel:        |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar                                      | –                 | –                         | 53.894.704        | 1,36                      |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen: |                   |                           |                   |                           |
| Euro   | 14.328.277        | 0,38                      | 10.195.525        | 0,26                      |
| US-Dollar                                      | 2.416.243.124     | 64,00                     | 2.396.291.848     | 60,59                     |
|  | 2.430.571.401     | 64,38                     | 2.406.487.373     | 60,85                     |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

| Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)                         | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|---|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|   | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:                                  |                   |                           |                   |                           |
| Euro  | 197.652.144       | 5,23                      | 362.400.411       | 9,17                      |
| US-Dollar   | 1.122.465.917     | 29,73                     | 945.231.530       | 23,90                     |
|   | 1.320.118.061     | 34,96                     | 1.307.631.941     | 33,07                     |
| Für den Handel gehaltene Investmentfonds:                                 |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar   | –                 | –                         | 49.810.000        | 1,26                      |
| Für den Handel gehaltene Pensionsgeschäfte:                               |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar   | 9.000.000         | 0,24                      | –                 | –                         |
|   | 3.759.689.462     | 99,58                     | 3.817.824.018     | 96,54                     |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto                               | (59.738.370)      | (1,59)                    | 55.420.371        | 1,40                      |
| <b>Short Duration Euro Bond</b>   |                   |                           |                   |                           |
|   |                   |                           |                   |                           |
| Für den Handel gehaltene Schatzwechsel:                                   |                   |                           |                   |                           |
| Euro  | –                 | –                         | 8.960.964         | 0,90                      |
| Für den Handel gehaltene forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen): |                   |                           |                   |                           |
| Euro  | 276.388.490       | 14,70                     | 90.687.160        | 9,14                      |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:                            |                   |                           |                   |                           |
| Euro  | 1.372.639.876     | 72,99                     | 789.167.617       | 79,48                     |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:                                  |                   |                           |                   |                           |
| Euro  | 93.624.597        | 4,98                      | 75.386.047        | 7,59                      |
| Für den Handel gehaltene Investmentfonds:                                 |                   |                           |                   |                           |
| Euro  | 33.954.800        | 1,80                      | –                 | –                         |
|   | 1.776.607.763     | 94,47                     | 964.201.788       | 97,11                     |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto                               | (905.608)         | (0,05)                    | (6.740.350)       | (0,68)                    |
| <b>Short Duration High Yield Engagement</b>                               |                   |                           |                   |                           |
|   |                   |                           |                   |                           |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:                            |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar   | 490.955.600       | 90,03                     | 664.013.737       | 89,20                     |
| Für den Handel gehaltene mittelfristige Schuldverschreibungen:            |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar   | 42.984.223        | 7,88                      | 13.420.047        | 1,80                      |
| Für den Handel gehaltene Pensionsgeschäfte:                               |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar   | 16.000.000        | 2,93                      | –                 | –                         |
| Für den Handel gehaltene Investmentfonds:                                 |                   |                           |                   |                           |
| Britisches Pfund  | 25.039            | 0,01                      | 241.028           | 0,03                      |
| US-Dollar   | 5.086.623         | 0,93                      | –                 | –                         |
|   | 5.111.662         | 0,94                      | 241.028           | 0,03                      |
|   | 555.051.485       | 101,78                    | 677.674.812       | 91,03                     |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto                               | (16.658.634)      | (3,05)                    | 12.140.835        | 1,63                      |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

| Strategic Income  | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|---|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|   | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien:  |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar   | –                 | –                         | 22.512            | 0,00                      |
| Für den Handel gehaltene Schatzwechsel:                                   |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar   | –                 | –                         | 221.166.130       | 10,95                     |
| Für den Handel gehaltene Agency Bonds:                                    |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar   | 739.410           | 0,02                      | 781.434           | 0,04                      |
| Für den Handel gehaltene forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen): |                   |                           |                   |                           |
| Euro  | 51.687.434        | 1,11                      | –                 | –                         |
| Britisches Pfund  | 8.682.511         | 0,19                      | –                 | –                         |
| US-Dollar   | 1.125.138.460     | 24,27                     | 211.031.917       | 10,45                     |
|   | 1.185.508.405     | 25,57                     | 211.031.917       | 10,45                     |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:                            |                   |                           |                   |                           |
| Euro  | 319.433.514       | 6,89                      | 82.785.192        | 4,10                      |
| Britisches Pfund  | 53.572.338        | 1,15                      | 20.389.514        | 1,01                      |
| US-Dollar   | 786.315.645       | 16,96                     | 432.669.604       | 21,42                     |
|   | 1.159.321.497     | 25,00                     | 535.844.310       | 26,53                     |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:                                  |                   |                           |                   |                           |
| Brasilianischer Real  | 3.852.152         | 0,08                      | –                 | –                         |
| Kanadischer Dollar  | 1.860.788         | 0,04                      | –                 | –                         |
| Kolumbianischer Peso  | 1.966.122         | 0,04                      | 2.200.755         | 0,11                      |
| Euro  | 20.909.742        | 0,45                      | –                 | –                         |
| Ungarischer Forint  | 2.884.526         | 0,06                      | 2.620.824         | 0,13                      |
| Indonesische Rupiah   | 3.654.922         | 0,08                      | 3.750.751         | 0,19                      |
| Mexikanischer Peso  | 10.580.875        | 0,23                      | 6.951.252         | 0,34                      |
| Peruanischer Sol  | 4.020.565         | 0,09                      | 4.098.321         | 0,20                      |
| Polnischer Zloty  | 2.931.328         | 0,06                      | 2.823.563         | 0,14                      |
| Rumänischer neuer Leu   | 3.957.569         | 0,09                      | 4.056.767         | 0,20                      |
| Südafrikanischer Rand   | 2.187.542         | 0,05                      | 2.180.039         | 0,11                      |
| US-Dollar   | 258.415.203       | 5,57                      | 146.987.608       | 7,28                      |
|   | 317.221.334       | 6,84                      | 175.669.880       | 8,70                      |
| Für den Handel gehaltene Mortgage-Backed Securities:                      |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar   | 1.530.842.706     | 33,01                     | 918.338.562       | 45,47                     |
| Für den Handel gehaltene Kommunalanleihen:                                |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar   | 12.931.828        | 0,28                      | 12.918.823        | 0,64                      |
| Für den Handel gehaltene mittelfristige Schuldverschreibungen:            |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar   | 253.734.800       | 5,47                      | 429.819           | 0,02                      |
| Für den Handel gehaltene Pensionsgeschäfte:                               |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar   | 82.500.000        | 1,78                      | –                 | –                         |
| Für den Handel gehaltene Investmentfonds:                                 |                   |                           |                   |                           |
| Britisches Pfund  | 15.148            | 0,00                      | 145.814           | 0,01                      |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

| Strategic Income (Fortsetzung)                                     | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|  | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Mortgage-Backed Securities (Fortsetzung): |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar  | 56.482.538        | 1,22                      | 60.620.640        | 3,00                      |
|  | 56.497.686        | 1,22                      | 60.766.454        | 3,01                      |
|  | 4.599.297.666     | 99,19                     | 2.136.969.841     | 105,81                    |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto                        | (32.937.754)      | (0,71)                    | 930.018           | 0,04                      |

| Sustainable Asia High Yield                    | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|  | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen: |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar                                      | 25.362.503        | 79,64                     | 24.364.117        | 85,29                     |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:       |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar                                      | 4.024.917         | 12,64                     | 2.505.094         | 8,77                      |
|  | 29.387.420        | 92,28                     | 26.869.211        | 94,06                     |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto    | (14.055)          | (0,04)                    | (17.944)          | (0,06)                    |

| Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|  | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:   |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar  | 62.183.538        | 10,39                     | 28.120.429        | 6,31                      |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:         |                   |                           |                   |                           |
| Euro   | 169.964.180       | 28,39                     | 157.346.786       | 35,29                     |
| US-Dollar  | 336.991.012       | 56,30                     | 230.334.993       | 51,65                     |
|  | 506.955.192       | 84,69                     | 387.681.779       | 86,94                     |
| Für den Handel gehaltene Pensionsgeschäfte:      |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar  | 13.000.000        | 2,17                      | –                 | –                         |
|  | 582.138.730       | 97,25                     | 415.802.208       | 93,25                     |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto      | (6.885.018)       | (1,15)                    | 10.665.593        | 2,39                      |

| Tactical Macro <sup>1</sup>                 | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|---|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|   | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Schatzwechsel:     |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar                                   | 33.319.914        | 92,55                     | 22.994.103        | 84,66                     |
|   | 33.319.914        | 92,55                     | 22.994.103        | 84,66                     |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | (247.253)         | (0,69)                    | 173.202           | 0,63                      |

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

| Uncorrelated Strategies                                  | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|  | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien:                         |                   |                           |                   |                           |
| Euro   | –                 | –                         | 1.692.087         | 0,10                      |
| Schweizer Franken  | –                 | –                         | 31.648            | 0,00                      |
| US-Dollar  | 16.585.832        | 2,05                      | 75.568.717        | 4,65                      |
|  | 16.585.832        | 2,05                      | 77.292.452        | 4,75                      |
| Für den Handel gehaltene Immobilienaktiengesellschaften: |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar  | 498.501           | 0,06                      | 1.217.656         | 0,07                      |
| Für den Handel gehaltene Participatory Notes:            |                   |                           |                   |                           |
| Euro   | –                 | –                         | 2.209             | 0,00                      |
| Britisches Pfund   | –                 | –                         | 14.342            | 0,00                      |
| US-Dollar  | 161.034           | 0,02                      | 20.494            | 0,00                      |
|  | 161.034           | 0,02                      | 37.045            | 0,00                      |
| Für den Handel gehaltene Schatzwechsel:                  |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar  | 308.758.915       | 38,27                     | 707.195.701       | 43,48                     |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:           |                   |                           |                   |                           |
| Euro   | 3.002.691         | 0,37                      | 668.976           | 0,04                      |
| Japanischer Yen  | –                 | –                         | 1.549.865         | 0,09                      |
| US-Dollar  | 60.147.226        | 7,46                      | 118.399.986       | 7,28                      |
|  | 63.149.917        | 7,83                      | 120.618.827       | 7,41                      |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:                 |                   |                           |                   |                           |
| Polnischer Zloty   | –                 | –                         | 2.810.381         | 0,17                      |
| Südafrikanischer Rand                                    | –                 | –                         | 13.608.831        | 0,84                      |
| US-Dollar  | 10.311.805        | 1,28                      | 22.545.359        | 1,39                      |
|  | 10.311.805        | 1,28                      | 38.964.571        | 2,40                      |
|  | 399.466.004       | 49,51                     | 945.326.252       | 58,11                     |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto              | 25.948.867        | 3,23                      | 30.977.706        | 1,91                      |

| US Equity                                   | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|---|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|   | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien:            |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar                                   | 106.233.762       | 99,22                     | 45.872.647        | 93,23                     |
|   | 106.233.762       | 99,22                     | 45.872.647        | 93,23                     |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | (1.098.004)       | (1,02)                    | 1.134.529         | 2,31                      |

| US Equity Premium                           | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|---|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|   | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:    |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar                                   | 634.072.321       | 96,21                     | 663.357.136       | 90,98                     |
|   | 634.072.321       | 96,21                     | 663.357.136       | 90,98                     |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | (21.448.063)      | (3,25)                    | 6.338.906         | 0,88                      |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

| US Large Cap Value                                       | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|  | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien:                         |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar  | 957.724.430       | 94,04                     | 1.847.675.317     | 95,28                     |
| Für den Handel gehaltene Immobilienaktiengesellschaften: |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar  | 39.459.548        | 3,87                      | 3.901.309         | 0,20                      |
|  | 997.183.978       | 97,91                     | 1.851.576.626     | 95,48                     |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto              | (1.693.000)       | (0,16)                    | 1.003.185         | 0,05                      |

| US Long Short Equity   | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|  | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien:                               |                   |                           |                   |                           |
| Euro   | 1.854.218         | 0,82                      | 1.648.923         | 0,84                      |
| US-Dollar  | 190.471.594       | 84,09                     | 164.934.480       | 84,38                     |
|  | 192.325.812       | 84,91                     | 166.583.403       | 85,22                     |
| Für den Handel gehaltene Immobilienaktiengesellschaften:       |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar  | 2.971.995         | 1,31                      | 3.534.047         | 1,81                      |
| Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:                 |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar  | 0                 | 0,00                      | 7.670.535         | 3,92                      |
| Für den Handel gehaltene mittelfristige Schuldverschreibungen: |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar  | 497.587           | 0,22                      | 487.831           | 0,25                      |
|  | 195.795.394       | 86,44                     | 178.275.816       | 91,20                     |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto                    | (2.682.650)       | (1,19)                    | (4.829.968)       | (2,47)                    |

| US Multi Cap Opportunities                  | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|---|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|   | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien:            |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar                                   | 387.941.733       | 100,53                    | 396.982.739       | 99,12                     |
|   | 387.941.733       | 100,53                    | 396.982.739       | 99,12                     |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | (3.043.601)       | (0,79)                    | 1.518.722         | 0,38                      |

| US Real Estate Securities                                | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|  | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien:                         |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar  | 9.235.982         | 2,12                      | –                 | –                         |
| Für den Handel gehaltene Immobilienaktiengesellschaften: |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar  | 423.305.104       | 97,00                     | 519.992.632       | 97,54                     |
|  | 432.541.086       | 99,12                     | 519.992.632       | 97,54                     |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto              | (3.052.957)       | (0,70)                    | 1.917.164         | 0,36                      |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

| US Small Cap                                | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|---|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|   | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien:            |                   |                           |                   |                           |
| Kanadischer Dollar                          | 1.447.134         | 0,16                      | –                 | –                         |
| US-Dollar                                   | 873.464.488       | 98,31                     | 622.291.910       | 98,17                     |
|   | 874.911.622       | 98,47                     | 622.291.910       | 98,17                     |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto | (1.661.300)       | (0,19)                    | 610.226           | 0,10                      |

| US Small Cap Intrinsic Value                             | 31. Dezember 2024 |                           | 31. Dezember 2023 |                           |
|--|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
|  | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens | Marktwert<br>US\$ | % des Netto-<br>vermögens |
| Für den Handel gehaltene Aktien:                         |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar  | 395.261.275       | 98,71                     | 299.826.372       | 93,24                     |
| Für den Handel gehaltene Immobilienaktiengesellschaften: |                   |                           |                   |                           |
| US-Dollar  | –                 | –                         | 1.910.421         | 0,59                      |
|  | 395.261.275       | 98,71                     | 301.736.793       | 93,83                     |
| Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto              | (505.474)         | (0,12)                    | (398)             | (0,00)                    |

(b) Fremdwährungsrisiko

Der Nettoinventarwert je Anteil eines Portfolios wird in der Basiswährung des betreffenden Portfolios berechnet. Anlagen, die für Rechnung des Portfolios gehalten werden, können jedoch in anderen Währungen erworben werden. Der Wert der Basiswährung der Anlagen eines auf eine andere Währung lautenden Portfolios kann aufgrund von Währungsschwankungen in Bezug auf die jeweiligen Währungen steigen oder fallen. Nachteilige Veränderungen der Wechselkurse können zu einer Verringerung der Rendite und einem Kapitalverlust führen. Die Positionen werden täglich überwacht, und es werden Absicherungsstrategien zur Sicherstellung eingesetzt, dass die Positionen innerhalb festgelegter Limits bleiben.

Zum 31. Dezember 2024 und 31. Dezember 2023 hätten bei einem Anstieg der Basiswährung des betreffenden Portfolios gegenüber allen Währungen um 5 % und bei gleichzeitiger Konstanz aller anderen Variablen das Nettovermögen und die Veränderung des Nettovermögens gemäß Gewinn- und Verlustrechnung wie in der nachstehenden Tabelle aufgeführt (abgenommen)/zugenommen.

| Portfolio   | Währung | 31. Dezember<br>2024 | % des<br>Nettover-<br>mögens | 31. Dezember<br>2023 | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|---|---------|----------------------|------------------------------|----------------------|------------------------------|
| Asia Responsible Transition Bond                        | USD     | 60.757               | 0,21 %                       | 118.753              | 0,19 %                       |
| China A-Share Equity                                    | CNY     | 744.043              | 5,07 %                       | 664.105              | 4,67 %                       |
| China Bond  | CNY     | 1.682.452            | 1,34 %                       | 14.705.878           | 3,20 %                       |
| China Equity  | USD     | 6.474.020            | 4,70 %                       | 7.902.362            | 4,43 %                       |
| Climate Innovation <sup>1</sup>                         | USD     | 64.971               | 2,11 %                       | 51.253               | 1,75 %                       |
| CLO Income  | USD     | 24.384.690           | 2,28 %                       | 2.552.853            | 1,38 %                       |
| Commodities   | USD     | (63.301)             | (0,04 %)                     | 90.805               | 0,06 %                       |
| Corporate Hybrid Bond                                   | EUR     | 36.489.183           | 1,56 %                       | 37.063.252           | 1,98 %                       |
| Developed Market FMP – 2027 <sup>1</sup>                | USD     | (3.441)              | 0,00 %                       | 1.974                | 0,00 %                       |
| EMD Corporate – Social and Environmental Transition     | USD     | (7.037)              | (0,01 %)                     | 247.125              | 0,25 %                       |
| Emerging Market Debt – Hard Currency                    | USD     | 24.554.985           | 0,91 %                       | 27.540.375           | 1,04 %                       |
| Emerging Market Debt – Local Currency                   | USD     | 50.475.071           | 4,69 %                       | 57.903.637           | 4,50 %                       |
| Emerging Market Debt Blend                              | USD     | 11.968.380           | 2,32 %                       | 13.736.311           | 2,61 %                       |
| Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend | USD     | 1.409.855            | 2,45 %                       | 1.867.386            | 2,87 %                       |
| Emerging Markets Equity                                 | USD     | 4.224.937            | 4,04 %                       | 3.657.753            | 4,03 %                       |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

| Portfolio  | Währung | 31. Dezember 2024 | % des Nettovermögens | 31. Dezember 2023 | % des Nettovermögens |
|--|---------|-------------------|----------------------|-------------------|----------------------|
| Emerging Markets Select Equity*                  | USD     | –                 | –                    | 201               | 0,00 %               |
| Euro Bond  | EUR     | (292)             | 0,00 %               | (471)             | 0,00 %               |
| Euro Bond Absolute Return                        | EUR     | 713.231           | 0,81 %               | 74.833            | 0,22 %               |
| European High Yield Bond                         | EUR     | 3.864.391         | 0,69 %               | 2.923.587         | 0,72 %               |
| European Sustainable Equity                      | EUR     | 4.069.820         | 2,74 %               | 4.362.047         | 2,53 %               |
| Event Driven                                     | USD     | (489.123)         | (0,17 %)             | 209.067           | 0,17 %               |
| Global Bond                                      | USD     | 2.369.240         | 2,33 %               | 2.550.381         | 2,35 %               |
| Global Diversified Income FMP – 2024*            | USD     | (1)               | 0,00 %               | 14.086            | 0,01 %               |
| Global Equity Megatrends                         | USD     | 2.256.840         | 0,44 %               | 670.810           | 0,46 %               |
| Global Flexible Credit Income                    | USD     | 4.587.178         | 1,03 %               | 3.927.885         | 1,01 %               |
| Global High Yield Engagement                     | USD     | 6.821.956         | 1,11 %               | 5.963.760         | 1,07 %               |
| Global High Yield Sustainable Action*            | USD     | –                 | –                    | 36                | 0,00 %               |
| Global Investment Grade Credit                   | USD     | 2.980.311         | 1,66 %               | 1.327.438         | 1,53 %               |
| Global Opportunistic Bond                        | USD     | 2.304.029         | 3,39 %               | 2.039.335         | 3,12 %               |
| Global Real Estate Securities*                   | USD     | (44.391)          | 0,00 %               | 422.417           | 2,06 %               |
| Global Sustainable Equity                        | USD     | 2.019.676         | 1,44 %               | 2.410.032         | 1,56 %               |
| Global Value                                     | USD     | 821.830           | 1,76 %               | 1.066.592         | 1,92 %               |
| High Yield Bond                                  | USD     | (2.128.669)       | (0,11 %)             | 1.650.638         | 0,07 %               |
| InnovAsia  | USD     | 654.109           | 4,63 %               | 1.076.997         | 4,53 %               |
| Japan Equity Engagement                          | JPY     | (645.806)         | 0,00 %               | 4.663.754         | 0,03 %               |
| Macro Opportunities FX*                          | EUR     | –                 | –                    | 2.121             | 0,07 %               |
| Next Generation Connectivity                     | USD     | 14.419.312        | 1,36 %               | 15.448.010        | 1,48 %               |
| Next Generation Mobility                         | USD     | 2.467.418         | 2,01 %               | 1.100.784         | 0,67 %               |
| Next Generation Space Economy                    | USD     | 940.037           | 1,60 %               | 323.291           | 1,64 %               |
| Short Duration Emerging Market Debt              | USD     | 7.859.539         | 0,21 %               | 22.091.968        | 0,56 %               |
| Short Duration Euro Bond                         | EUR     | 13.837            | 0,00 %               | (108.980)         | (0,01 %)             |
| Short Duration High Yield Engagement             | USD     | (829.347)         | (0,15 %)             | 761.620           | 0,10 %               |
| Strategic Income                                 | USD     | 24.998.807        | 0,54 %               | 9.712.500         | 0,48 %               |
| Sustainable Asia High Yield                      | USD     | 103               | 0,00 %               | 932               | 0,00 %               |
| Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency | USD     | 8.586.332         | 1,43 %               | 8.390.584         | 1,88 %               |
| Tactical Macro <sup>1</sup>                      | USD     | (13.621)          | (0,04 %)             | (3.431)           | (0,01 %)             |
| Uncorrelated Strategies                          | USD     | 728.573           | 0,09 %               | 5.921.898         | 0,36 %               |
| Uncorrelated Trading*                            | USD     | –                 | –                    | (11)              | 0,00 %               |
| US Equity  | USD     | (54.900)          | (0,05 %)             | 56.878            | 0,12 %               |
| US Equity Premium                                | USD     | (418.708)         | (0,06 %)             | 571.074           | 0,08 %               |
| US Large Cap Value                               | USD     | (54.347)          | (0,01 %)             | 72.229            | 0,00 %               |
| US Long Short Equity                             | USD     | (170.777)         | (0,08 %)             | 210.821           | 0,11 %               |
| US Multi Cap Opportunities                       | USD     | (126.355)         | (0,03 %)             | 57.658            | 0,01 %               |
| US Real Estate Securities                        | USD     | (169.262)         | (0,04 %)             | 96.763            | 0,02 %               |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

| Portfolio                    | Währung | 31. Dezember 2024 | % des Nettovermögens | 31. Dezember 2023 | % des Nettovermögens |
|------------------------------|---------|-------------------|----------------------|-------------------|----------------------|
| US Small Cap                 | USD     | 63.314            | 0,01 %               | 36.361            | 0,01 %               |
| US Small Cap Intrinsic Value | USD     | (26.909)          | (0,01 %)             | 13.463            | 0,00 %               |

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

\* Der Teilfonds wurde während des aktuellen oder vorherigen Berichtsjahres aufgelöst.

Eine Abschwächung der Basiswährung des betreffenden Portfolios gegenüber den oben genannten Währungen um 5 % hätte bei Konstanz aller anderen Variablen auf die oben aufgeführten Beträge im Jahresabschluss den entgegengesetzten Effekt in gleicher Höhe gehabt. Das Währungsrisiko wurde auf Basis des Nettovermögens des Portfolios berechnet, das auf eine andere Währung als die Basiswährung des betreffenden Portfolios lautet. Der Manager hält 5 % für einen angemessenen Satz für Wechselkurseffekte.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

In den nachstehenden Tabellen sind die Währungsrisiken der betreffenden Portfolios insgesamt zusammengefasst.

|                                       | Asia Responsible Transition Bond |                       | China A-Share Equity  |                       | China Bond            |                       |
|---------------------------------------|----------------------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
|                                       | Zum 31. Dezember 2024            | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 |
|                                       | US\$                             | US\$                  | CNY                   | CNY                   | CNY                   | CNY                   |
| Chinesischer Yuan Renminbi            | 69.346                           | 74.865                | (218.165)             | 931.733               | 92.084.828            | 164.728.545           |
| Chinesischer Yuan Renminbi – Offshore | 8.644                            | (24.478)              | 14.238.244            | 11.487.246            | -                     | 175.328.923           |
| Euro                                  | 1.046.202                        | 2.144.445             | -                     | -                     | 994                   | 898                   |
| Hongkong-Dollar                       | -                                | -                     | 642.603               | 1.794.336             | 4                     | -                     |
| Indische Rupie                        | -                                | 252                   | -                     | -                     | -                     | -                     |
| Indonesische Rupiah                   | (9.580)                          | 7.163                 | -                     | -                     | -                     | -                     |
| Japanischer Yen                       | (6.671)                          | -                     | -                     | -                     | -                     | -                     |
| Malaysischer Ringgit                  | 604                              | 14.931                | -                     | -                     | -                     | -                     |
| Neuer taiwanesischer Dollar           | 2.839                            | (1.225)               | -                     | -                     | -                     | -                     |
| Philippinischer Peso                  | -                                | 3.430                 | -                     | -                     | -                     | -                     |
| Britisches Pfund                      | -                                | -                     | -                     | -                     | 4                     | 1.322                 |
| Singapur-Dollar                       | -                                | (561)                 | 15                    | -                     | 764                   | (8.833)               |
| Südkoreanischer Won                   | 96.035                           | 131.323               | -                     | -                     | -                     | -                     |
| Schweizer Franken                     | 552                              | -                     | -                     | -                     | -                     | -                     |
| Thailändischer Baht                   | 7.168                            | 24.924                | -                     | -                     | -                     | -                     |
| US-Dollar                             | 27.321.522                       | 61.566.795            | 4                     | 517                   | 33.647.270            | 118.795.253           |
|                                       | <b>28.536.661</b>                | <b>63.941.864</b>     | <b>14.662.701</b>     | <b>14.213.832</b>     | <b>125.733.864</b>    | <b>458.846.108</b>    |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

|                                       | China Equity          |                       | Climate Innovation <sup>1</sup> |                       | CLO Income            |                       |
|---------------------------------------|-----------------------|-----------------------|---------------------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
|                                       | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024           | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 |
|                                       | US\$                  | US\$                  | US\$                            | US\$                  | US\$                  | US\$                  |
| Chinesischer Yuan Renminbi            | -                     | 2.855.957             | -                               | -                     | -                     | -                     |
| Chinesischer Yuan Renminbi – Offshore | 50.255.747            | 74.424.349            | 83.334                          | 22.928                | -                     | -                     |
| Euro                                  | (146.441)             | (3.795)               | 432.854                         | 423.573               | 488.253.309           | 50.844.680            |
| Hongkong-Dollar                       | 79.416.231            | 80.726.155            | 120.124                         | 106.864               | -                     | -                     |
| Indische Rupie                        | -                     | -                     | 109.562                         | -                     | -                     | -                     |
| Japanischer Yen                       | -                     | -                     | 171.632                         | 86.565                | (448.899)             | -                     |
| Neuer taiwanesischer Dollar           | -                     | -                     | 102.503                         | -                     | -                     | -                     |
| Norwegische Krone                     | -                     | -                     | -                               | 7.036                 | -                     | -                     |
| Britisches Pfund                      | -                     | 499                   | -                               | 91.036                | (1.434)               | 2.908                 |
| Singapur-Dollar                       | (34.904)              | 31.240                | -                               | -                     | -                     | -                     |
| Südkoreanischer Won                   | -                     | -                     | 224.299                         | 227.583               | -                     | -                     |
| Schwedische Krone                     | -                     | -                     | -                               | -                     | (109.185)             | 209.466               |
| Schweizer Franken                     | (10.227)              | 12.827                | 55.103                          | 59.474                | -                     | -                     |
| US-Dollar                             | 8.334.342             | 20.179.055            | 1.782.065                       | 1.897.496             | 583.443.714           | 134.589.251           |
|                                       | <b>137.814.748</b>    | <b>178.226.287</b>    | <b>3.081.476</b>                | <b>2.922.555</b>      | <b>1.071.137.505</b>  | <b>185.646.305</b>    |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

|                                       | Commodities   |                       | Corporate Hybrid Bond                |                       | Developed Market FMP – 2027 <sup>1</sup> |                       |
|---------------------------------------|---|-----------------------|--------------------------------------|-----------------------|--|-----------------------|
|                                       | Zum 31. Dezember 2024                               | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024                | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024                    | Zum 31. Dezember 2023 |
|                                       | US\$  | US\$                  | EUR                                  | EUR                   | US\$                                     | US\$                  |
| Australischer Dollar                  | -   | -                     | (130.756)                            | 71.869                | -  | -                     |
| Euro                                  | -   | -                     | 1.613.507.611                        | 1.128.551.430         | (68.828)                                 | 39.476                |
| Britisches Pfund                      | (1.266.015)   | 1.816.095             | 432.111.519                          | 469.298.379           | -  | -                     |
| Singapur-Dollar                       | -   | -                     | 73.447                               | (11.417)              | -  | -                     |
| Schweizer Franken                     | -   | -                     | (170.347)                            | 160.617               | -  | -                     |
| US-Dollar                             | 156.374.605   | 151.830.464           | 297.899.798                          | 271.745.585           | 127.458.021                              | 137.418.343           |
|                                       | <b>155.108.590</b>                                  | <b>153.646.559</b>    | <b>2.343.291.272</b>                 | <b>1.869.816.463</b>  | <b>127.389.193</b>                       | <b>137.457.819</b>    |
|                                       | EMD Corporate – Social and Environmental Transition |                       | Emerging Market Debt - Hard Currency |                       | Emerging Market Debt - Local Currency    |                       |
|                                       | Zum 31. Dezember 2024                               | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024                | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024                    | Zum 31. Dezember 2023 |
|                                       | US\$  | US\$                  | US\$                                 | US\$                  | US\$                                     | US\$                  |
| Argentinischer Peso                   | -   | -                     | -                                    | -                     | 2.371                                    | 2.890                 |
| Australischer Dollar                  | -   | -                     | (15.946)                             | 601.670               | (663.215)                                | 711.720               |
| Brasilianischer Real                  | -   | -                     | -                                    | -                     | (14.604.328)                             | 291.529               |
| Kanadischer Dollar                    | -   | -                     | -                                    | -                     | 799                                      | 842                   |
| Chilenischer Peso                     | -   | -                     | -                                    | -                     | 17.643.837                               | 26.641.503            |
| Chinesischer Yuan Renminbi            | 111.303   | 114.325               | -                                    | -                     | 116.725.146                              | 94.077.109            |
| Chinesischer Yuan Renminbi – Offshore | 1.362   | (319)                 | -                                    | -                     | (11.967.228)                             | (382.644)             |
| Kolumbianischer Peso                  | -   | -                     | -                                    | -                     | 78.530.773                               | 114.707.095           |
| Costa Rican Colón                     | -   | -                     | -                                    | -                     | 1.417.150                                | -                     |
| Tschechische Krone                    | -   | -                     | -                                    | -                     | 37.975.037                               | 62.128.688            |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

|                              | EMD Corporate – Social and Environmental Transition<br>(Fortsetzung) |                       | Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung) |                       | Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung) |                       |
|------------------------------|--|-----------------------|--|-----------------------|---|-----------------------|
|                              | Zum 31. Dezember 2024  | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024                              | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024                               | Zum 31. Dezember 2023 |
|                              | US\$   | US\$                  | US\$   | US\$                  | US\$  | US\$                  |
| Peso Dominikanische Republik | -  | -                     | -  | -                     | 17.334.783  | 6.712.333             |
| Ägyptisches Pfund            | -  | -                     | -  | -                     | 15.614.418  | (528.913)             |
| Euro                         | 589.051  | 4.228.272             | 497.766.856  | 539.044.170           | 1.659.256   | 700.146               |
| Ghanaischer Cedi             | -  | -                     | -  | -                     | 1.982.006   | 1.740.612             |
| Hongkong-Dollar              | -  | -                     | 544  | 6.588                 | -   | -                     |
| Ungarischer Forint           | -  | -                     | -  | -                     | 20.524.217  | 35.592.912            |
| Indische Rupie               | -  | -                     | -  | -                     | 91.856.042  | 25.342                |
| Indonesische Rupiah          | -  | -                     | -  | -                     | 99.160.075  | 134.135.500           |
| Israelischer Neuer Shekel    | -  | -                     | -  | -                     | -   | (1.992.838)           |
| Japanischer Yen              | -  | -                     | (495.195)  | 455.988               | (203.557)   | 24.384                |
| Kasachischer Tenge           | -  | -                     | -  | -                     | (615.527)   | -                     |
| Malaysischer Ringgit         | -  | -                     | -  | -                     | 85.448.224  | 117.522.624           |
| Mexikanischer Peso           | 805  | 988                   | -  | -                     | 70.766.641  | 106.797.062           |
| Neuer taiwanesischer Dollar  | -  | -                     | -  | -                     | 99.125  | (11.844)              |
| Nigerianischer Naira         | -  | -                     | -  | -                     | 518.501   | 4.665                 |
| Pakistanische Rupie          | -  | -                     | -  | -                     | 12.177.954  | -                     |
| Peruanischer Sol             | -  | -                     | -  | -                     | 24.163.331  | 38.164.906            |
| Philippinischer Peso         | -  | -                     | -  | -                     | 18.960.367  | 5.069.836             |
| Polnischer Zloty             | -  | -                     | -  | -                     | 66.280.314  | 122.435.640           |
| Britisches Pfund             | (281)  | 153                   | (1.146.706)  | 1.369.267             | (11.199)  | 5.145                 |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

|                       | EMD Corporate – Social and Environmental Transition<br>(Fortsetzung) |                       | Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung) |                       | Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung) |                       |
|-----------------------|--|-----------------------|--|-----------------------|---|-----------------------|
|                       | Zum 31. Dezember 2024  | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024                              | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024                               | Zum 31. Dezember 2023 |
|                       | US\$   | US\$                  | US\$   | US\$                  | US\$  | US\$                  |
| Rumänischer Leu       | -  | -                     | -  | -                     | 45.416.063  | 40.339.921            |
| Serbischer Dinar      | -  | -                     | -  | -                     | 4.728.851   | 3.648.955             |
| Singapur-Dollar       | 1  | 1                     | (410.609)  | 735.239               | 58.192  | (13.987)              |
| Südafrikanischer Rand | -  | -                     | -  | -                     | 94.694.246  | 128.414.178           |
| Südkoreanischer Won   | -  | -                     | -  | -                     | 1.946.511   | 2.474.058             |
| Schwedische Krone     | (2.711)  | 7.853                 | (470.919)  | 2.044.431             | (6.504)   | 27.678                |
| Schweizer Franken     | (840.275)  | 591.230               | (4.128.331)  | 6.550.148             | -   | -                     |
| Thailändischer Baht   | -  | -                     | -  | -                     | 63.143.325  | 74.428.877            |
| Türkische Lira        | -  | -                     | -  | -                     | 36.458.181  | 20.116.212            |
| Uganda-Schilling      | -  | -                     | -  | -                     | 5.610.969   | 5.747.020             |
| US-Dollar             | 113.861.373  | 92.846.634            | 2.213.338.900                                      | 2.099.011.154         | 66.879.640  | 127.794.917           |
| Uruguayischer Peso    | -  | -                     | -  | -                     | 1.913.944   | 13.819.761            |
| Sambischer Kwacha     | -  | -                     | -  | -                     | 4.762.321   | 4.493.813             |
|                       | <b>113.720.628</b>   | <b>97.789.137</b>     | <b>2.704.438.594</b>                               | <b>2.649.818.655</b>  | <b>1.076.381.052</b>                                | <b>1.285.867.647</b>  |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

|                                       | Emerging Market Debt Blend |                       | Emerging Market Debt Sustainable Investment<br>Grade Blend |                       | Emerging Markets Equity |                       |
|---------------------------------------|----------------------------|-----------------------|--|-----------------------|-------------------------|-----------------------|
|                                       | Zum 31. Dezember 2024      | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024                                      | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024   | Zum 31. Dezember 2023 |
|                                       | US\$                       | US\$                  | US\$   | US\$                  | US\$                    | US\$                  |
| Argentinischer Peso                   | 815                        | 993                   | -  | -                     | -                       | -                     |
| Australischer Dollar                  | (119.721)                  | 94.706                | (438.414)  | 371.064               | (120.755)               | 78.109                |
| Brasilianischer Real                  | (4.928.115)                | (1.704.435)           | -  | -                     | 3.868.382               | 4.904.069             |
| Kanadischer Dollar                    | 265                        | 279                   | 1  | 2                     | (560.935)               | 779.818               |
| Chilenischer Peso                     | 4.276.420                  | 3.159.484             | 489.972  | 367.546               | -                       | -                     |
| Chinesischer Yuan Renminbi            | 17.419.331                 | 18.981.129            | -  | -                     | -                       | 50                    |
| Chinesischer Yuan Renminbi – Offshore | 3.476.161                  | (114.012)             | 13.215   | -                     | 5.057.174               | 4.639.922             |
| Kolumbianischer Peso                  | 21.094.387                 | 26.663.057            | 1.558.595  | 1.752.964             | -                       | -                     |
| Costa Rican Colón                     | 336.945                    | -                     | -  | -                     | -                       | -                     |
| Tschechische Krone                    | 12.498.839                 | 15.760.898            | 881.312  | 1.099.304             | -                       | -                     |
| Peso Dominikanische Republik          | 3.856.810                  | 1.455.729             | -  | -                     | -                       | -                     |
| Ägyptisches Pfund                     | 3.179.880                  | (68.180)              | -  | -                     | -                       | -                     |
| Euro                                  | 11.796.691                 | 21.297.201            | 12.489.168   | 16.572.344            | 786.875                 | 48.711                |
| Ghanaischer Cedi                      | 407.293                    | 357.726               | -  | -                     | -                       | -                     |
| Hongkong-Dollar                       | -                          | -                     | -  | -                     | 18.136.275              | 10.159.509            |
| Ungarischer Forint                    | 4.516.447                  | 7.558.875             | 611.020  | 788.480               | 2.028.611               | 1.548.412             |
| Indische Rupie                        | 23.824.488                 | 7.083                 | 2.250.591  | 356                   | 26.311.488              | 16.883.306            |
| Indonesische Rupiah                   | 25.373.259                 | 29.227.651            | 2.918.902  | 3.396.336             | 1.258.601               | 1.597.980             |
| Israelischer Neuer Sheckel            | -                          | (424.993)             | -  | (43.103)              | -                       | -                     |
| Japanischer Yen                       | (62.133)                   | -                     | (4.672)  | -                     | 610.856                 | -                     |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

|                             | Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung) |                       | Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend (Fortsetzung) |                       | Emerging Markets Equity (Fortsetzung) |                       |
|-----------------------------|--|-----------------------|---|-----------------------|---------------------------------------|-----------------------|
|                             | Zum 31. Dezember 2024                    | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024   | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024                 | Zum 31. Dezember 2023 |
|                             | US\$                                     | US\$                  | US\$  | US\$                  | US\$                                  | US\$                  |
| Kasachischer Tenge          | (148.985)                                | -                     | (3.390)   | -                     | -                                     | -                     |
| Malaysischer Ringgit        | 16.357.641                               | 24.310.403            | 1.879.667   | 2.398.875             | -                                     | -                     |
| Mexikanischer Peso          | 14.860.290                               | 23.835.040            | 1.854.867   | 3.245.080             | 1.800.126                             | 2.935.064             |
| Neuer taiwanesischer Dollar | 77.515                                   | (1.736)               | 1.671   | (787)                 | 7.888.862                             | 6.668.816             |
| Nigerianischer Naira        | 184.985                                  | 1.460                 | -   | -                     | -                                     | -                     |
| Norwegische Krone           | (296)                                    | 912                   | (625.391)   | 1.800.411             | -                                     | -                     |
| Pakistanische Rupie         | 2.865.401                                | -                     | -   | -                     | -                                     | -                     |
| Peruanischer Sol            | 5.592.112                                | 9.927.219             | 470.274   | 575.602               | -                                     | -                     |
| Philippinischer Peso        | 4.357.471                                | 1.121.450             | 333.695   | 88.006                | 1.076.484                             | 1.605.757             |
| Polnischer Zloty            | 13.812.980                               | 27.577.765            | 1.408.628   | 1.875.905             | 634.738                               | 986.888               |
| Britisches Pfund            | (37.431)                                 | 102.739               | (304)   | (4)                   | 1.317.383                             | 2.349.824             |
| Rumänischer Leu             | 8.929.974                                | 8.369.423             | 1.008.812   | 821.254               | -                                     | -                     |
| Russischer Rubel            | -  | -                     | -   | -                     | -                                     | 2.953                 |
| Saudi-Riyal                 | -  | -                     | -   | -                     | 1.773.034                             | 4.003.118             |
| Serbischer Dinar            | 1.017.261                                | 790.524               | -   | -                     | -                                     | -                     |
| Singapur-Dollar             | 618                                      | 21.891                | 1.219   | (365)                 | -                                     | 2                     |
| Südafrikanischer Rand       | 23.268.741                               | 27.255.355            | -   | -                     | 1.973.761                             | 1.129.877             |
| Südkoreanischer Won         | 518.759                                  | 563.511               | 36.582  | 45.767                | 7.677.083                             | 10.463.980            |
| Schwedische Krone           | (36.106)                                 | 49.257                | -   | -                     | -                                     | -                     |
| Schweizer Franken           | 26                                       | 28                    | -   | -                     | -                                     | -                     |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

|                      | Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung) |                       | Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend (Fortsetzung) |                       | Emerging Markets Equity (Fortsetzung) |                       |
|----------------------|--|-----------------------|---|-----------------------|---------------------------------------|-----------------------|
|                      | Zum 31. Dezember 2024                    | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024   | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024                 | Zum 31. Dezember 2023 |
|                      | US\$                                     | US\$                  | US\$  | US\$                  | US\$                                  | US\$                  |
| Thailändischer Baht  | 9.410.107                                | 18.604.820            | 1.024.404   | 1.961.700             | -                                     | 846.746               |
| Türkische Lira       | 8.530.398                                | 4.286.125             | -   | -                     | -                                     | -                     |
| Uganda-Schilling     | 1.354.989                                | 1.119.625             | -   | -                     | -                                     | -                     |
| VAE-Dirham           | -  | -                     | -   | -                     | 2.294.058                             | 1.522.140             |
| US-Dollar            | 276.940.551                              | 252.061.592           | 29.299.599  | 27.719.825            | 20.066.353                            | 17.532.450            |
| Uruguayischer Peso   | 464.536                                  | 2.816.774             | 36.685  | 230.987               | -                                     | -                     |
| Vietnamesischer Dong | -  | -                     | -   | -                     | 686.641                               | -                     |
| Sambischer Kwacha    | 1.038.553                                | 1.720.439             | -   | -                     | -                                     | -                     |
|                      | <b>516.308.152</b>                       | <b>526.787.807</b>    | <b>57.496.708</b>   | <b>65.067.549</b>     | <b>104.565.095</b>                    | <b>90.687.501</b>     |

|                    | Emerging Markets Select Equity* |                       | Euro Bond             |                       | Euro Bond Absolute Return |                       |
|--------------------|---------------------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|---------------------------|-----------------------|
|                    | Zum 31. Dezember 2024           | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024     | Zum 31. Dezember 2023 |
|                    | US\$                            | US\$                  | EUR                   | EUR                   | EUR                       | EUR                   |
| Kanadischer Dollar | -                               | -                     | -                     | -                     | 3.402                     | (33.762)              |
| Tschechische Krone | -                               | -                     | -                     | -                     | 1.910.188                 | (10.856)              |
| Dänische Krone     | -                               | -                     | -                     | -                     | 4.476.252                 | 1.314.701             |
| Euro               | -                               | -                     | 70.406.374            | 10.582.522            | 74.257.546                | 32.530.158            |
| Hongkong-Dollar    | -                               | 6                     | -                     | -                     | -                         | -                     |
| Indische Rupie     | -                               | 4.019                 | -                     | -                     | -                         | -                     |
| Japanischer Yen    | -                               | -                     | -                     | -                     | 229.876                   | (13.946)              |
| Polnischer Zloty   | -                               | -                     | -                     | -                     | 1.413.386                 | 984.735               |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

|                  | Emerging Markets Select Equity* (Fortsetzung) |                       | Euro Bond (Fortsetzung) |                       | Euro Bond Absolute Return (Fortsetzung) |                       |
|------------------|---|-----------------------|-------------------------|-----------------------|---|-----------------------|
|                  | Zum 31. Dezember 2024                         | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024   | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024                   | Zum 31. Dezember 2023 |
|                  | US\$  | US\$                  | EUR                     | EUR                   | EUR                                     | EUR                   |
| Britisches Pfund | -   | -                     | (10.691)                | (10.199)              | 2.783.281                               | 379.719               |
| US-Dollar        | -   | (4.025)               | 4.849                   | 771                   | 3.448.243                               | (1.123.922)           |
|                  | -   | -                     | <b>70.400.532</b>       | <b>10.573.094</b>     | <b>88.522.174</b>                       | <b>34.026.827</b>     |

\* Das Portfolio wurde am 7. September 2023 aufgelöst.

|                   | European High Yield Bond |                       | European Sustainable Equity |                       | Event Driven          |                       |
|-------------------|--------------------------|-----------------------|-----------------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
|                   | Zum 31. Dezember 2024    | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024       | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 |
|                   | EUR                      | EUR                   | EUR                         | EUR                   | US\$                  | US\$                  |
| Dänische Krone    | -                        | -                     | 9.244.626                   | 13.482.154            | -                     | -                     |
| Euro              | 483.465.744              | 349.944.569           | 67.103.635                  | 84.856.607            | (25.129)              | 388                   |
| Japanischer Yen   | -                        | -                     | -                           | -                     | (959.369)             | -                     |
| Norwegische Krone | -                        | -                     | 3.921.089                   | 5.211.792             | -                     | -                     |
| Britisches Pfund  | 75.219.471               | 58.629.389            | 35.093.270                  | 24.641.334            | (8.797.955)           | 4.180.953             |
| Singapur-Dollar   | 1                        | 1                     | -                           | -                     | -                     | -                     |
| Schwedische Krone | -                        | -                     | 9.347.358                   | 10.498.832            | -                     | -                     |
| Schweizer Franken | 1.908                    | 60.870                | 21.255.694                  | 31.217.338            | -                     | -                     |
| US-Dollar         | 2.066.430                | (218.512)             | 2.534.361                   | 2.189.494             | 293.779.144           | 122.230.807           |
|                   | <b>560.753.554</b>       | <b>408.416.317</b>    | <b>148.500.033</b>          | <b>172.097.551</b>    | <b>283.996.691</b>    | <b>126.412.148</b>    |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

|                                       | Global Bond           |                       | Global Diversified Income FMP – 2024* |                       | Global Equity Megatrends |                       |
|---------------------------------------|-----------------------|-----------------------|---------------------------------------|-----------------------|--------------------------|-----------------------|
|                                       | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024                 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024    | Zum 31. Dezember 2023 |
|                                       | US\$                  | US\$                  | US\$                                  | US\$                  | US\$                     | US\$                  |
| Australischer Dollar                  | 2.534.857             | 1.431.666             | -                                     | -                     | -                        | -                     |
| Brasilianischer Real                  | (54.627)              | 17.869                | -                                     | -                     | -                        | -                     |
| Kanadischer Dollar                    | 3.326.561             | 3.789.921             | -                                     | -                     | 17.053.183               | 5.599.843             |
| Chilenischer Peso                     | (4.631)               | 6.508                 | -                                     | -                     | -                        | -                     |
| Chinesischer Yuan Renminbi            | (286.094)             | 290.460               | -                                     | -                     | -                        | -                     |
| Chinesischer Yuan Renminbi – Offshore | 17.617                | 532                   | -                                     | -                     | -                        | -                     |
| Kolumbianischer Peso                  | (3.361)               | 14.974                | -                                     | -                     | -                        | -                     |
| Tschechische Krone                    | (12.574)              | 9.743                 | -                                     | -                     | -                        | -                     |
| Dänische Krone                        | 1.048.300             | 998.642               | -                                     | -                     | -                        | -                     |
| Euro                                  | 21.752.770            | 26.722.896            | (12)                                  | 92.813                | 362.322                  | 239.151               |
| Hongkong-Dollar                       | 3                     | 20                    | -                                     | 333                   | (1)                      | -                     |
| Ungarischer Forint                    | 7.242                 | 11.277                | -                                     | -                     | -                        | -                     |
| Indische Rupie                        | (1.756)               | -                     | -                                     | -                     | -                        | -                     |
| Indonesische Rupiah                   | (15.737)              | 2.382.231             | -                                     | -                     | -                        | -                     |
| Israelischer Neuer Schekel            | 2.387                 | 13.308                | -                                     | -                     | -                        | -                     |
| Japanischer Yen                       | 6.678.458             | 5.250.782             | -                                     | -                     | -                        | -                     |
| Malaysischer Ringgit                  | (21.312)              | 10.350                | -                                     | -                     | -                        | -                     |
| Mexikanischer Peso                    | 218.674               | 830.191               | -                                     | -                     | -                        | -                     |
| Neuseeländischer Dollar               | 703.815               | 700.386               | -                                     | -                     | -                        | -                     |
| Norwegische Krone                     | 130.973               | 172.901               | -                                     | -                     | -                        | -                     |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

|                       | Global Bond (Fortsetzung) |                       | Global Diversified Income FMP – 2024* (Fortsetzung) |                       | Global Equity Megatrends (Fortsetzung) |                       |
|-----------------------|---------------------------|-----------------------|---|-----------------------|--|-----------------------|
|                       | Zum 31. Dezember 2024     | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024                               | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024                  | Zum 31. Dezember 2023 |
|                       | US\$                      | US\$                  | US\$  | US\$                  | US\$                                   | US\$                  |
| Peruanischer Sol      | (94)                      | 2.612                 | -   | -                     | -                                      | -                     |
| Polnischer Zloty      | 333.706                   | 279.797               | -   | -                     | -                                      | -                     |
| Britisches Pfund      | 8.082.702                 | 5.491.512             | -   | 89.866                | 27.925.555                             | 7.576.753             |
| Rumänischer Leu       | (6.201)                   | 2.209                 | -   | -                     | -                                      | -                     |
| Singapur-Dollar       | 200.537                   | 8.072                 | -   | 98.708                | (204.263)                              | 444                   |
| Südafrikanischer Rand | 1.204                     | 1.055                 | -   | -                     | -                                      | -                     |
| Südkoreanischer Won   | 2.330.728                 | 2.334.784             | -   | -                     | -                                      | -                     |
| Schwedische Krone     | 6.826                     | (130.289)             | -   | -                     | -                                      | -                     |
| Schweizer Franken     | 402.896                   | 339.669               | -   | -                     | -                                      | -                     |
| Thailändischer Baht   | (17.563)                  | 23.543                | -   | -                     | -                                      | -                     |
| Türkische Lira        | 28.491                    | -                     | -   | -                     | -                                      | -                     |
| US-Dollar             | 54.357.461                | 57.735.179            | 12  | 155.917.933           | 473.487.831                            | 131.066.665           |
|                       | <b>101.742.258</b>        | <b>108.742.800</b>    | -   | <b>156.199.653</b>    | <b>518.624.627</b>                     | <b>144.482.856</b>    |

\* Das Portfolio wurde am 28. Juni 2024 aufgelöst.

|                      | Global Flexible Credit Income |                       | Global High Yield Engagement |                       | Global High Yield Sustainable Action** |                       |
|----------------------|-------------------------------|-----------------------|------------------------------|-----------------------|--|-----------------------|
|                      | Zum 31. Dezember 2024         | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024        | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024                  | Zum 31. Dezember 2023 |
|                      | US\$                          | US\$                  | US\$                         | US\$                  | US\$                                   | US\$                  |
| Australischer Dollar | -                             | -                     | (263.731)                    | 1.540                 | -                                      | -                     |
| Kanadischer Dollar   | (536.405)                     | 316.595               | -                            | -                     | -                                      | -                     |
| Euro                 | 81.932.510                    | 60.909.348            | 118.597.081                  | 95.970.028            | -                                      | 501                   |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

|                   | Global Flexible Credit Income (Fortsetzung) |                       | Global High Yield Engagement (Fortsetzung) |                       | Global High Yield Sustainable Action** (Fortsetzung) |                       |
|-------------------|---|-----------------------|--|-----------------------|--|-----------------------|
|                   | Zum 31. Dezember 2024                       | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024                      | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024                                | Zum 31. Dezember 2023 |
|                   | US\$  | US\$                  | US\$                                       | US\$                  | US\$   | US\$                  |
| Britisches Pfund  | 10.347.456                                  | 17.331.764            | 24.341.893                                 | 17.653.094            | -  | 221                   |
| Schweizer Franken | -   | -                     | (6.236.126)                                | 5.650.537             | -  | -                     |
| US-Dollar         | 353.116.707                                 | 312.055.274           | 477.126.864                                | 438.888.706           | -  | (722)                 |
|                   | <b>444.860.268</b>                          | <b>390.612.981</b>    | <b>613.565.981</b>                         | <b>558.163.905</b>    | -  | -                     |

\*\* Das Portfolio wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.

|                                       | Global Investment Grade Credit |                       | Global Opportunistic Bond |                       | Global Real Estate Securities* |                       |
|---------------------------------------|--------------------------------|-----------------------|---------------------------|-----------------------|--------------------------------|-----------------------|
|                                       | Zum 31. Dezember 2024          | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024     | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024          | Zum 31. Dezember 2023 |
|                                       | US\$                           | US\$                  | US\$                      | US\$                  | US\$                           | US\$                  |
| Australischer Dollar                  | -                              | -                     | 3.389.819                 | 1.180.612             | (4)                            | 1.038.540             |
| Brasilianischer Real                  | -                              | -                     | (39.473)                  | 34.023                | -                              | -                     |
| Kanadischer Dollar                    | 2.049.375                      | 1.983.786             | (219.145)                 | (317.187)             | 252                            | 827.668               |
| Chilenischer Peso                     | -                              | -                     | (67)                      | 2.783                 | -                              | -                     |
| Chinesischer Yuan Renminbi            | -                              | -                     | 947.190                   | 2.096.427             | -                              | -                     |
| Chinesischer Yuan Renminbi – Offshore | -                              | -                     | 13.513                    | (5.092)               | -                              | -                     |
| Kolumbianischer Peso                  | -                              | -                     | (4)                       | -                     | -                              | -                     |
| Tschechische Krone                    | -                              | -                     | 1.421.966                 | 499.862               | -                              | -                     |
| Euro                                  | 37.319.895                     | 17.251.644            | 26.057.531                | 23.915.436            | (887.196)                      | 1.659.999             |
| Hongkong-Dollar                       | -                              | -                     | -                         | -                     | 2                              | 956.261               |
| Ungarischer Forint                    | -                              | -                     | 1.029.731                 | 279.114               | -                              | -                     |
| Indische Rupie                        | -                              | -                     | (1.316)                   | -                     | -                              | -                     |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

|                            | Global Investment Grade Credit (Fortsetzung) |                       | Global Opportunistic Bond (Fortsetzung) |                       | Global Real Estate Securities* (Fortsetzung) |                       |
|----------------------------|--|-----------------------|---|-----------------------|--|-----------------------|
|                            | Zum 31. Dezember 2024                        | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024                   | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024                        | Zum 31. Dezember 2023 |
|                            | US\$   | US\$                  | US\$                                    | US\$                  | US\$   | US\$                  |
| Indonesische Rupiah        | -  | -                     | 2.015.548                               | 1.596.994             | -  | -                     |
| Israelischer Neuer Schekel | -  | -                     | (1.203)                                 | -                     | -  | -                     |
| Japanischer Yen            | -  | -                     | 1.034.233                               | 67.899                | -  | 1.739.044             |
| Mexikanischer Peso         | -  | -                     | 2.925.682                               | 2.810.772             | -  | -                     |
| Neuseeländischer Dollar    | -  | -                     | 1.319.704                               | 2.955.614             | -  | -                     |
| Norwegische Krone          | -  | -                     | (11.161)                                | 15.024                | -  | -                     |
| Polnischer Zloty           | -  | -                     | 22.152                                  | 867.678               | -  | -                     |
| Britisches Pfund           | 20.236.958                                   | 7.313.323             | 5.647.729                               | 4.852.959             | (906)  | 1.187.032             |
| Russischer Rubel           | -  | -                     | -                                       | 1.700                 | -  | -                     |
| Singapur-Dollar            | -  | -                     | (3)                                     | -                     | 33   | 734.860               |
| Südafrikanischer Rand      | -  | -                     | 3.184                                   | 3.123                 | -  | -                     |
| Südkoreanischer Won        | -  | -                     | 211.354                                 | 264.517               | -  | -                     |
| Schwedische Krone          | -  | -                     | 935                                     | (360.388)             | -  | -                     |
| Schweizer Franken          | -  | -                     | (14.227)                                | (235.468)             | 1  | 304.936               |
| Thailändischer Baht        | -  | -                     | 305.623                                 | 260.293               | -  | -                     |
| Türkische Lira             | -  | -                     | 21.280                                  | -                     | -  | -                     |
| US-Dollar                  | 120.264.688                                  | 60.229.072            | 21.808.247                              | 24.623.068            | 887.818                                      | 12.011.673            |
|                            | <b>179.870.916</b>                           | <b>86.777.825</b>     | <b>67.888.822</b>                       | <b>65.409.763</b>     | -  | <b>20.460.013</b>     |

\* Das Portfolio wurde am 31. Dezember 2024 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

|                                       | Global Sustainable Equity |                       | Global Value          |                       | High Yield Bond       |                       |
|---------------------------------------|---------------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
|                                       | Zum 31. Dezember 2024     | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 |
|                                       | US\$                      | US\$                  | US\$                  | US\$                  | US\$                  | US\$                  |
| Australischer Dollar                  | -                         | -                     | 903.126               | 1.682.064             | (5.982.346)           | 4.335.505             |
| Brasilianischer Real                  | -                         | -                     | 435.152               | 572.497               | -                     | -                     |
| Kanadischer Dollar                    | -                         | -                     | 2.076.858             | 2.055.919             | (257.060)             | 128.502               |
| Chinesischer Yuan Renminbi – Offshore | -                         | -                     | -                     | -                     | (73.329)              | 33.428                |
| Dänische Krone                        | 2.223.620                 | 2.356.644             | 210                   | 173                   | -                     | -                     |
| Euro                                  | 13.662.353                | 18.198.317            | 3.462.521             | 4.877.673             | (13.479.878)          | 5.502.188             |
| Hongkong-Dollar                       | -                         | -                     | 2.152.579             | 1.646.067             | (3.583)               | 982                   |
| Indonesische Rupiah                   | -                         | -                     | -                     | 192.941               | -                     | -                     |
| Israelischer Neuer Schekel            | -                         | -                     | 6                     | -                     | -                     | -                     |
| Japanischer Yen                       | 2.929.728                 | 2.808.506             | 2.189.104             | 3.141.435             | -                     | -                     |
| Mexikanischer Peso                    | -                         | -                     | 125.915               | 397.431               | -                     | -                     |
| Neuer taiwanesischer Dollar           | -                         | -                     | 967.675               | 1.041.760             | -                     | -                     |
| Neuseeländischer Dollar               | -                         | -                     | 3                     | 110.971               | -                     | -                     |
| Norwegische Krone                     | 3.242.584                 | 3.833.337             | 343.355               | 364.322               | -                     | -                     |
| Britisches Pfund                      | 6.189.609                 | 4.551.411             | 1.701.505             | 2.682.617             | (10.454.685)          | 11.900.302            |
| Singapur-Dollar                       | -                         | -                     | 320.546               | 245.967               | (1.462.380)           | 1.044.422             |
| Südafrikanischer Rand                 | -                         | -                     | 284.167               | 199.376               | (6.570.942)           | 5.521.118             |
| Südkoreanischer Won                   | -                         | -                     | 164.942               | 794.977               | -                     | -                     |
| Schwedische Krone                     | 4.079.735                 | 4.357.993             | 268.694               | 133.988               | (3.900.121)           | 4.148.246             |
| Schweizer Franken                     | 8.065.899                 | 12.094.429            | 1.040.238             | 1.191.665             | (389.048)             | 398.057               |
| US-Dollar                             | 100.031.167               | 106.372.658           | 30.209.180            | 34.134.051            | 1.941.781.310         | 2.218.797.969         |
|                                       | <b>140.424.695</b>        | <b>154.573.295</b>    | <b>46.645.776</b>     | <b>55.465.894</b>     | <b>1.899.207.938</b>  | <b>2.251.810.719</b>  |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

|                                       | InnovAsia             |                       | Japan Equity Engagement |                       | Macro Opportunities FX* |                       |
|---------------------------------------|-----------------------|-----------------------|-------------------------|-----------------------|-------------------------|-----------------------|
|                                       | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024   | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024   | Zum 31. Dezember 2023 |
|                                       | US\$                  | US\$                  | JPY                     | JPY                   | EUR                     | EUR                   |
| Australischer Dollar                  | 675.350               | 173.906               | -                       | -                     | -                       | 39.080                |
| Brasilianischer Real                  | -                     | -                     | -                       | -                     | -                       | (4.922)               |
| Kanadischer Dollar                    | -                     | -                     | -                       | -                     | -                       | 67.179                |
| Chilenischer Peso                     | -                     | -                     | -                       | -                     | -                       | 5.001                 |
| Chinesischer Yuan Renminbi – Offshore | 290.768               | 1.007.839             | -                       | -                     | -                       | 1                     |
| Tschechische Krone                    | -                     | -                     | -                       | -                     | -                       | (1.277)               |
| Euro                                  | (325.362)             | 151.104               | 60.587                  | 86.682.787            | 1                       | 2.839.381             |
| Hongkong-Dollar                       | 458.779               | 1                     | -                       | -                     | -                       | -                     |
| Ungarischer Forint                    | -                     | -                     | -                       | -                     | -                       | (5.196)               |
| Indonesische Rupiah                   | -                     | -                     | -                       | -                     | -                       | (23)                  |
| Indische Rupie                        | 1.476.507             | 2.736.940             | -                       | -                     | -                       | -                     |
| Japanischer Yen                       | 4.494.394             | 6.224.863             | 24.245.551.714          | 16.084.253.643        | -                       | 45.896                |
| Malaysischer Ringgit                  | 312.131               | 481.076               | -                       | -                     | -                       | -                     |
| Mexikanischer Peso                    | -                     | -                     | -                       | -                     | -                       | (8.248)               |
| Neuer taiwanesischer Dollar           | 3.838.688             | 5.480.052             | -                       | -                     | -                       | -                     |
| Neuseeländischer Dollar               | -                     | -                     | -                       | -                     | -                       | 44.056                |
| Norwegische Krone                     | -                     | -                     | -                       | -                     | -                       | (16.499)              |
| Polnischer Zloty                      | -                     | -                     | -                       | -                     | -                       | (14.454)              |
| Britisches Pfund                      | -                     | -                     | (13.672.860)            | 6.592.286             | 1                       | 46.828                |
| Singapur-Dollar                       | (41.686)              | 591.839               | -                       | -                     | -                       | -                     |
| Südafrikanischer Rand                 | -                     | -                     | -                       | -                     | -                       | (10)                  |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

|                      | InnovAsia (Fortsetzung) |                       | Japan Equity Engagement (Fortsetzung) |                       | Macro Opportunities FX* (Fortsetzung) |                       |
|----------------------|-------------------------|-----------------------|---------------------------------------|-----------------------|---------------------------------------|-----------------------|
|                      | Zum 31. Dezember 2024   | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024                 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024                 | Zum 31. Dezember 2023 |
|                      | US\$                    | US\$                  | JPY                                   | JPY                   | EUR                                   | EUR                   |
| Südkoreanischer Won  | 1.325.934               | 3.391.560             | -                                     | -                     | -                                     | (4)                   |
| Schwedische Krone    | -                       | -                     | -                                     | -                     | -                                     | (10.349)              |
| Schweizer Franken    | (38.577)                | 36.502                | -                                     | -                     | -                                     | 85.607                |
| Thailändischer Baht  | 87.862                  | 715.164               | -                                     | -                     | -                                     | -                     |
| US-Dollar            | 1.056.864               | 2.230.179             | 696.153                               | (1)                   | (2)                                   | (230.241)             |
| Vietnamesischer Dong | 527.386                 | 549.095               | -                                     | -                     | -                                     | -                     |
|                      | <b>14.139.038</b>       | <b>23.770.120</b>     | <b>24.232.635.594</b>                 | <b>16.177.528.715</b> | -                                     | <b>2.881.806</b>      |

\* Das Portfolio wurde am 8. Februar 2024 aufgelöst.

|                                       | Multi-Asset Income*   |                       | Next Generation Connectivity |                       | Next Generation Mobility |                       |
|---------------------------------------|-----------------------|-----------------------|------------------------------|-----------------------|--------------------------|-----------------------|
|                                       | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024        | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024    | Zum 31. Dezember 2023 |
|                                       | US\$                  | US\$                  | US\$                         | US\$                  | US\$                     | US\$                  |
| Australischer Dollar                  | -                     | (3)                   | (1.312.877)                  | 769.833               | -                        | 2                     |
| Kanadischer Dollar                    | -                     | -                     | -                            | -                     | -                        | 923.624               |
| Chinesischer Yuan Renminbi – Offshore | -                     | -                     | (21.604)                     | 2.368.424             | 5.594.279                | 821.040               |
| Euro                                  | -                     | -                     | 68.580.946                   | 84.962.476            | 13.866.143               | 8.433.497             |
| Hongkong-Dollar                       | -                     | -                     | 15.391                       | (7.935)               | 4.839.225                | 3.492.481             |
| Japanischer Yen                       | -                     | -                     | 92.346.712                   | 103.938.608           | 6.026.740                | 3.261.496             |
| Neuer taiwanesischer Dollar           | -                     | -                     | 96.312.068                   | 88.565.742            | 1.526.148                | 1.653.606             |
| Britisches Pfund                      | -                     | -                     | (495.013)                    | 380.189               | -                        | 2                     |
| Singapur-Dollar                       | -                     | -                     | (1.868.088)                  | 875.928               | -                        | 1                     |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

|                       | Multi-Asset Income* (Fortsetzung) |                       | Next Generation Connectivity (Fortsetzung) |                       | Next Generation Mobility (Fortsetzung) |                       |
|-----------------------|-----------------------------------|-----------------------|--|-----------------------|--|-----------------------|
|                       | Zum 31. Dezember 2024             | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024                      | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024                  | Zum 31. Dezember 2023 |
|                       | US\$                              | US\$                  | US\$                                       | US\$                  | US\$                                   | US\$                  |
| Südafrikanischer Rand | -                                 | -                     | 1.189                                      | 80.837                | -                                      | -                     |
| Südkoreanischer Won   | -                                 | -                     | 34.837.751                                 | 27.019.657            | 14.737.459                             | 1.389.795             |
| Schwedische Krone     | -                                 | -                     | -  | -                     | 8                                      | 2.040.136             |
| Schweizer Franken     | -                                 | -                     | (10.231)                                   | 6.442                 | 2.758.362                              | -                     |
| US-Dollar             | -                                 | 3                     | 774.797.718                                | 734.566.742           | 73.445.136                             | 142.340.385           |
|                       | -                                 | -                     | <b>1.063.183.962</b>                       | <b>1.043.526.943</b>  | <b>122.793.500</b>                     | <b>164.356.065</b>    |

\* Das Portfolio wurde am 6. Juli 2023 aufgelöst.

|                                       | Next Generation Space Economy |                       |
|---------------------------------------|-------------------------------|-----------------------|
|                                       | Zum 31. Dezember 2024         | Zum 31. Dezember 2023 |
|                                       | US\$                          | US\$                  |
| Kanadischer Dollar                    | 1.951.634                     | -                     |
| Chinesischer Yuan Renminbi – Offshore | -                             | 291.964               |
| Euro                                  | 6.805.886                     | 2.317.039             |
| Japanischer Yen                       | 5.600.460                     | 1.343.794             |
| Neuer taiwanesischer Dollar           | -                             | 190.613               |
| Britisches Pfund                      | 1.560.804                     | 714.848               |
| Singapur-Dollar                       | 1.590.847                     | 591.275               |
| Südkoreanischer Won                   | 1.291.104                     | 1.016.292             |
| US-Dollar                             | 40.063.484                    | 13.278.105            |
|                                       | <b>58.864.219</b>             | <b>19.743.930</b>     |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

|                                       | Short Duration Emerging Market Debt |                       | Short Duration Euro Bond |                       | Short Duration High Yield Engagement |                       |
|---------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------|--------------------------|-----------------------|--------------------------------------|-----------------------|
|                                       | Zum 31. Dezember 2024               | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024    | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024                | Zum 31. Dezember 2023 |
|                                       | US\$                                | US\$                  | EUR                      | EUR                   | US\$                                 | US\$                  |
| Australischer Dollar                  | (48.992)                            | 37.563                | -                        | -                     | (85.090)                             | 44.496                |
| Kanadischer Dollar                    | (5.976)                             | 8.966                 | -                        | -                     | -                                    | -                     |
| Chinesischer Yuan Renminbi            | 33                                  | 34                    | -                        | -                     | -                                    | -                     |
| Chinesischer Yuan Renminbi – Offshore | -                                   | -                     | -                        | -                     | (12.830)                             | 5.857                 |
| Euro                                  | 187.644.241                         | 413.407.394           | 1.880.345.638            | 995.051.895           | (4.918.470)                          | 4.239.741             |
| Hongkong-Dollar                       | -                                   | -                     | -                        | -                     | (91)                                 | 115                   |
| Japanischer Yen                       | (23.298.116)                        | 22.534.119            | -                        | -                     | (8.070.905)                          | 5.148.350             |
| Britisches Pfund                      | (3.972.234)                         | 2.818.335             | (8.266)                  | (7.923)               | (3.263.980)                          | 5.454.935             |
| Singapur-Dollar                       | (987.405)                           | 825.980               | -                        | -                     | (183.851)                            | 288.185               |
| Südafrikanischer Rand                 | -                                   | -                     | -                        | -                     | 411                                  | 397                   |
| Schwedische Krone                     | (11.857)                            | 27.309                | -                        | -                     | -                                    | -                     |
| Schweizer Franken                     | (2.128.924)                         | 2.179.655             | (13.586)                 | 163.831               | (52.138)                             | 50.323                |
| US-Dollar                             | 3.618.484.516                       | 3.512.930.212         | 298.596                  | (2.335.505)           | 561.901.139                          | 729.202.048           |
|                                       | <b>3.775.675.286</b>                | <b>3.954.769.567</b>  | <b>1.880.622.382</b>     | <b>992.872.298</b>    | <b>545.314.195</b>                   | <b>744.434.447</b>    |

|                      | Strategic Income      |                       | Sustainable Asia High Yield |                       | Sustainable Emerging Market Debt – Hard Currency |                       |
|----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------------|-----------------------|--|-----------------------|
|                      | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024       | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024                            | Zum 31. Dezember 2023 |
|                      | US\$                  | US\$                  | US\$                        | US\$                  | US\$   | US\$                  |
| Australischer Dollar | (16.195.146)          | 17.539.127            | -                           | -                     | -  | -                     |
| Brasilianischer Real | 2.839.217             | (207.691)             | -                           | -                     | -  | -                     |
| Kanadischer Dollar   | (83.577)              | (679.684)             | -                           | -                     | -  | -                     |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

|                                       | Strategic Income (Fortsetzung) |                       | Sustainable Asia High Yield (Fortsetzung) |                       | Sustainable Emerging Market Debt – Hard Currency (Fortsetzung) |                       |
|---------------------------------------|--------------------------------|-----------------------|---|-----------------------|--|-----------------------|
|                                       | Zum 31. Dezember 2024          | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024                     | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024  | Zum 31. Dezember 2023 |
|                                       | US\$                           | US\$                  | US\$                                      | US\$                  | US\$   | US\$                  |
| Chilenischer Peso                     | 15.514                         | (27.980)              | -   | -                     | -  | -                     |
| Chinesischer Yuan Renminbi            | -                              | -                     | 1   | -                     | -  | -                     |
| Chinesischer Yuan Renminbi – Offshore | (3.151.189)                    | 4.155.778             | -   | -                     | -  | -                     |
| Kolumbianischer Peso                  | 1.960.174                      | 2.188.592             | -   | -                     | -  | -                     |
| Tschechische Krone                    | 15.165                         | (16.735)              | -   | -                     | -  | -                     |
| Dänische Krone                        | (43)                           | -                     | -   | -                     | -  | -                     |
| Euro                                  | 416.130.148                    | 82.017.440            | 2.068                                     | 16.887                | 171.726.633  | 167.811.670           |
| Hongkong-Dollar                       | 17.633.997                     | 29.305.731            | -   | -                     | -  | -                     |
| Ungarischer Forint                    | 3.238.749                      | 2.681.198             | -   | -                     | -  | -                     |
| Indische Rupie                        | -                              | 512                   | -   | -                     | -  | -                     |
| Indonesische Rupiah                   | 3.654.922                      | 3.755.309             | -   | -                     | -  | -                     |
| Israelischer Neuer Schekel            | 40                             | 41                    | -   | -                     | -  | -                     |
| Japanischer Yen                       | (2.634.985)                    | 5.449.718             | -   | -                     | -  | -                     |
| Kasachischer Tenge                    | (36.106)                       | -                     | -   | -                     | -  | -                     |
| Malaysischer Ringgit                  | 1.420                          | 4.587                 | -   | -                     | -  | -                     |
| Mexikanischer Peso                    | 8.748.552                      | 6.308.818             | -   | -                     | -  | -                     |
| Neuer taiwanesischer Dollar           | 4.982                          | 11.655                | -   | -                     | -  | -                     |
| Neuseeländischer Dollar               | 197.234                        | 147.133               | -   | -                     | -  | -                     |
| Norwegische Krone                     | (74.514)                       | (21.185)              | -   | -                     | -  | -                     |
| Peruanischer Sol                      | 4.020.565                      | 4.112.101             | -   | -                     | -  | -                     |
| Philippinischer Peso                  | (4.152)                        | 4.108                 | -   | -                     | -  | -                     |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

|                       | Strategic Income (Fortsetzung) |                       | Sustainable Asia High Yield (Fortsetzung) |                       | Sustainable Emerging Market Debt – Hard Currency (Fortsetzung) |                       |
|-----------------------|--------------------------------|-----------------------|---|-----------------------|--|-----------------------|
|                       | Zum 31. Dezember 2024          | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024                     | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024  | Zum 31. Dezember 2023 |
|                       | US\$                           | US\$                  | US\$                                      | US\$                  | US\$   | US\$                  |
| Polnischer Zloty      | 2.933.742                      | 2.802.855             | -   | -                     | -  | -                     |
| Britisches Pfund      | 70.839.657                     | 24.213.364            | -   | 1.743                 | -  | -                     |
| Rumänischer Leu       | 3.900.908                      | 4.058.739             | -   | -                     | -  | -                     |
| Singapur-Dollar       | (17.710.290)                   | 2.311.461             | -   | -                     | -  | -                     |
| Südafrikanischer Rand | 3.234.053                      | 4.036.991             | -   | -                     | -  | -                     |
| Südkoreanischer Won   | 18.569                         | 15.532                | -   | -                     | -  | -                     |
| Schwedische Krone     | 287.252                        | 16.635                | -   | -                     | -  | -                     |
| Schweizer Franken     | (22.688)                       | 15.397                | -   | -                     | -  | -                     |
| Thailändischer Baht   | 3.063                          | 27.359                | -   | -                     | -  | -                     |
| Türkische Lira        | 210.911                        | (30)                  | -   | -                     | -  | -                     |
| US-Dollar             | 4.136.853.998                  | 1.825.353.588         | 31.842.332                                | 28.546.321            | 426.864.349  | 278.080.600           |
| Uruguayischer Peso    | -                              | 23.117                | -   | -                     | -  | -                     |
|                       | <b>4.636.830.142</b>           | <b>2.019.603.581</b>  | <b>31.844.401</b>                         | <b>28.564.951</b>     | <b>598.590.982</b>   | <b>445.892.270</b>    |

|                                       | Tactical Marco <sup>1</sup> |                       |
|---------------------------------------|-----------------------------|-----------------------|
|                                       | Zum 31. Dezember 2024       | Zum 31. Dezember 2023 |
|                                       | US\$                        | US\$                  |
| Australischer Dollar                  | 154                         | 10.952                |
| Kanadischer Dollar                    | (5.116)                     | -                     |
| Chinesischer Yuan Renminbi            | (1.187)                     | (164)                 |
| Chinesischer Yuan Renminbi – Offshore | (48.356)                    | (40.687)              |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

|                         | Tactical Marco <sup>1</sup> (Fortsetzung) |                       |
|-------------------------|---|-----------------------|
|                         | Zum 31. Dezember 2024                     | Zum 31. Dezember 2023 |
|                         | US\$                                      | US\$                  |
| Euro                    | (205.406)                                 | 99.373                |
| Japanischer Yen         | (15.918)                                  | (88.203)              |
| Neuseeländischer Dollar | 1   | (27.209)              |
| Norwegische Krone       | 3   | 4                     |
| Britisches Pfund        | 3.408                                     | (22.689)              |
| US-Dollar               | 36.275.183                                | 27.230.931            |
|                         | <b>36.002.766</b>                         | <b>27.162.308</b>     |

|                                       | Uncorrelated Strategies |                       | Uncorrelated Trading* |                       | US Equity             |                       |
|---------------------------------------|-------------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
|                                       | Zum 31. Dezember 2024   | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 |
|                                       | US\$                    | US\$                  | US\$                  | US\$                  | US\$                  | US\$                  |
| Australischer Dollar                  | (1.912.132)             | (7.146.070)           | -                     | -                     | -                     | -                     |
| Brasilianischer Real                  | 150.806                 | (265.787)             | -                     | -                     | -                     | -                     |
| Kanadischer Dollar                    | 3.115.411               | (11.290)              | -                     | (1)                   | -                     | -                     |
| Chilenischer Peso                     | 56.876                  | 14.787                | -                     | -                     | -                     | -                     |
| Chinesischer Yuan Renminbi            | -                       | (980)                 | -                     | -                     | -                     | -                     |
| Chinesischer Yuan Renminbi – Offshore | 1.288.296               | (148.818)             | -                     | -                     | -                     | -                     |
| Kolumbianischer Peso                  | 15.086                  | 16.372                | -                     | -                     | -                     | -                     |
| Tschechische Krone                    | 30.416                  | 2.181.561             | -                     | -                     | -                     | -                     |
| Dänische Krone                        | 1.818.812               | (933.968)             | -                     | -                     | -                     | -                     |
| Ägyptisches Pfund                     | 21.166                  | 247.059               | -                     | -                     | -                     | -                     |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

|                             | Uncorrelated Strategies (Fortsetzung) |                       | Uncorrelated Trading* (Fortsetzung) |                       | US Equity (Fortsetzung) |                       |
|-----------------------------|---------------------------------------|-----------------------|-------------------------------------|-----------------------|-------------------------|-----------------------|
|                             | Zum 31. Dezember 2024                 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024               | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024   | Zum 31. Dezember 2023 |
|                             | US\$                                  | US\$                  | US\$                                | US\$                  | US\$                    | US\$                  |
| Euro                        | 5.593.321                             | 28.397.963            | -                                   | (213)                 | (204.095)               | -                     |
| Hongkong-Dollar             | 7.403.141                             | (20.735.526)          | -                                   | -                     | -                       | -                     |
| Ungarischer Forint          | 567.550                               | 1.255.125             | -                                   | -                     | -                       | -                     |
| Indische Rupie              | 405.468                               | (182.551)             | -                                   | -                     | -                       | -                     |
| Indonesische Rupiah         | (3.619)                               | -                     | -                                   | -                     | -                       | -                     |
| Israelischer Neuer Schekel  | (103.781)                             | 4.184.528             | -                                   | -                     | -                       | -                     |
| Japanischer Yen             | 4.704.016                             | 6.475.942             | -                                   | -                     | (893.909)               | 1.137.567             |
| Malaysischer Ringgit        | 54.344                                | 990                   | -                                   | -                     | -                       | -                     |
| Mexikanischer Peso          | (405.993)                             | (3.119.203)           | -                                   | -                     | -                       | -                     |
| Neuer taiwanesischer Dollar | 1.535.693                             | 1.950.580             | -                                   | -                     | -                       | -                     |
| Neuseeländischer Dollar     | 414.398                               | 1.315.078             | -                                   | -                     | -                       | -                     |
| Nigerianischer Naira        | -                                     | (523.007)             | -                                   | -                     | -                       | -                     |
| Norwegische Krone           | 142.893                               | (3.335.594)           | -                                   | -                     | -                       | -                     |
| Philippinischer Peso        | (32.065)                              | 25.686                | -                                   | -                     | -                       | -                     |
| Polnischer Zloty            | 1.435.254                             | 4.549.144             | -                                   | -                     | -                       | -                     |
| Britisches Pfund            | (27.646.404)                          | 92.344.789            | -                                   | 1                     | -                       | -                     |
| Rumänischer Leu             | 42.551                                | -                     | -                                   | -                     | -                       | -                     |
| Singapur-Dollar             | 180.074                               | 387.816               | -                                   | -                     | -                       | -                     |
| Südafrikanischer Rand       | 1.703.951                             | 12.493.962            | -                                   | -                     | -                       | -                     |
| Südkoreanischer Won         | 14.324.379                            | 8.408.896             | -                                   | -                     | -                       | -                     |
| Schwedische Krone           | (1.026.527)                           | (1.353.332)           | -                                   | -                     | -                       | -                     |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

|                     | Uncorrelated Strategies (Fortsetzung) |                       | Uncorrelated Trading* (Fortsetzung) |                       | US Equity (Fortsetzung) |                       |
|---------------------|---------------------------------------|-----------------------|-------------------------------------|-----------------------|-------------------------|-----------------------|
|                     | Zum 31. Dezember 2024                 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024               | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024   | Zum 31. Dezember 2023 |
|                     | US\$                                  | US\$                  | US\$                                | US\$                  | US\$                    | US\$                  |
| Schweizer Franken   | 860.176                               | (7.720.759)           | -                                   | 1                     | -                       | -                     |
| Thailändischer Baht | (18.681)                              | (56.746)              | -                                   | -                     | -                       | -                     |
| Türkische Lira      | (143.409)                             | (278.695)             | -                                   | -                     | -                       | -                     |
| US-Dollar           | 792.269.958                           | 1.508.263.469         | -                                   | 212                   | 108.165.039             | 48.064.582            |
|                     | <b>806.841.425</b>                    | <b>1.626.701.421</b>  | -                                   | -                     | <b>107.067.035</b>      | <b>49.202.149</b>     |

\* Das Portfolio wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

|                   | US Equity Premium     |                       | US Large Cap Value    |                       | US Long Short Equity  |                       |
|-------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
|                   | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 |
|                   | US\$                  | US\$                  | US\$                  | US\$                  | US\$                  | US\$                  |
| Euro              | (575.975)             | 341.554               | (916.024)             | 1.793.476             | (3.213.231)           | 4.152.987             |
| Britisches Pfund  | (7.598.936)           | 11.070.085            | (170.916)             | (348.901)             | (197.098)             | 59.233                |
| Singapur-Dollar   | (199.255)             | 9.837                 | -                     | -                     | (5.218)               | 4.192                 |
| Schweizer Franken | -                     | -                     | -                     | -                     | 11                    | 12                    |
| US-Dollar         | 667.418.160           | 717.676.524           | 1.019.517.121         | 1.937.745.803         | 229.927.613           | 191.253.867           |
|                   | <b>659.043.994</b>    | <b>729.098.000</b>    | <b>1.018.430.181</b>  | <b>1.939.190.378</b>  | <b>226.512.077</b>    | <b>195.470.291</b>    |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

|                       | US Multi Cap Opportunities |                       | US Real Estate Securities |                       | US Small Cap          |                       |
|-----------------------|----------------------------|-----------------------|---------------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
|                       | Zum 31. Dezember 2024      | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024     | Zum 31. Dezember 2023 | Zum 31. Dezember 2024 | Zum 31. Dezember 2023 |
|                       | US\$                       | US\$                  | US\$                      | US\$                  | US\$                  | US\$                  |
| Australischer Dollar  | (137.841)                  | 124.577               | (907.692)                 | 726.863               | (184.733)             | 307.996               |
| Kanadischer Dollar    | -                          | -                     | -                         | -                     | 1.459.650             | 13.206                |
| Euro                  | (339.886)                  | 351.827               | (934.609)                 | 445.574               | (263.073)             | 387.224               |
| Hongkong-Dollar       | -                          | -                     | (6.423)                   | (119.662)             | -                     | -                     |
| Britisches Pfund      | 4.741                      | -                     | -                         | -                     | 29.409                | 28.754                |
| Singapur-Dollar       | (1.776.215)                | 649.693               | (44.977)                  | 19.673                | -                     | -                     |
| Südafrikanischer Rand | (277.907)                  | 27.054                | (1.396.343)               | 764.872               | 225.036               | (9.963)               |
| Schweizer Franken     | -                          | -                     | (95.190)                  | 97.941                | -                     | -                     |
| US-Dollar             | 388.411.900                | 399.338.884           | 439.758.751               | 531.174.724           | 887.272.133           | 633.124.552           |
|                       | <b>385.884.792</b>         | <b>400.492.035</b>    | <b>436.373.517</b>        | <b>533.109.985</b>    | <b>888.538.422</b>    | <b>633.851.769</b>    |

|                  | US Small Cap Intrinsic Value |                       |
|------------------|------------------------------|-----------------------|
|                  | Zum 31. Dezember 2024        | Zum 31. Dezember 2023 |
|                  | US\$                         | US\$                  |
| Euro             | (505.474)                    | -                     |
| Japanischer Yen  | -                            | 70.534                |
| Britisches Pfund | (32.708)                     | 198.725               |
| US-Dollar        | 400.951.407                  | 321.299.358           |
|                  | <b>400.413.225</b>           | <b>321.568.617</b>    |

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (c) Zinsrisiko

Die Portfolios können Anlagen in festverzinslichen Wertpapieren halten. Jegliche Veränderung des Zinssatzes bestimmter Wertpapiere kann zu fallenden oder steigenden Erträgen führen. Die Kurse der gehaltenen Wertpapiere werden durch inländische Zinssätze beeinflusst. Die Performance des Portfolios wird daher teilweise von der Fähigkeit abhängig sein, solche Zinssatzschwankungen vorwegzunehmen. Die Manager und die Sub-Investment-Manager steuern dieses Risiko anhand von Analysen der Duration und der Renditekurve, um die Durationspositionierung und die Struktur der Renditekurve festzulegen und zu überwachen.

Die Gesellschaft hat im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024 50 Portfolios. Bei neunzehn der Portfolios waren die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten überwiegend in Dividendenpapieren und nichtverzinslichen Wertpapieren angelegt. Infolgedessen sind diese Portfolios keinen größeren Risiken durch Fluktuationen des herrschenden Marktzinsniveaus ausgesetzt.

Zum Jahresende investierten die unten in der Tabelle aufgeführten Portfolios vor allem in festverzinsliche und variabel verzinsliche Instrumente und sind somit den Auswirkungen der Schwankungen der aktuellen Zinssätze auf ihre jeweilige Finanzposition und die Cashflows ausgesetzt.

Basierend auf der Zusammensetzung der Portfolios zum 31. Dezember 2024 und 31. Dezember 2023 hätten bei einem Rückgang der Zinssätze um 0,50 % bei gleichzeitiger Konstanz aller anderen Variablen das Nettovermögen und die Veränderungen des Nettovermögens gemäß Gewinn- und Verlustrechnung ungefähr in dem Umfang zugenommen, wie in der nachstehenden Tabelle aufgeführt. Ein Anstieg der Zinssätze um 0,50 % hätte einen entgegengesetzten Effekt in gleicher Höhe gehabt.

| Portfolio   | Währung | 31. Dezember 2024 | % des Nettovermögens | 31. Dezember 2023 | % des Nettovermögens |
|---|---------|-------------------|----------------------|-------------------|----------------------|
| Asia Responsible Transition Bond                        | USD     | 565.193           | 1,98 %               | 1.406.001         | 2,20 %               |
| China Bond  | CNY     | 1.360.706         | 1,08 %               | 5.023.639         | 1,09 %               |
| CLO Income  | USD     | 988.798           | 0,09 %               | 362.300           | 0,20 %               |
| Commodities   | USD     | 126.236           | 0,08 %               | 145.168           | 0,09 %               |
| Corporate Hybrid Bond                                   | EUR     | 34.257.215        | 1,46 %               | 24.235.812        | 1,30 %               |
| Developed Market FMP – 2027 <sup>1</sup>                | USD     | 1.137.399         | 0,89 %               | 1.697.215         | 1,23 %               |
| EMD Corporate – Social and Environmental Transition     | USD     | 2.243.630         | 1,97 %               | 1.930.479         | 1,97 %               |
| Emerging Market Debt - Hard Currency                    | USD     | 87.885.288        | 3,25 %               | 87.547.569        | 3,30 %               |
| Emerging Market Debt - Local Currency                   | USD     | 30.916.890        | 2,87 %               | 33.828.398        | 2,63 %               |
| Emerging Market Debt Blend                              | USD     | 12.971.968        | 2,51 %               | 13.406.283        | 2,54 %               |
| Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend | USD     | 1.791.038         | 3,12 %               | 2.032.707         | 3,12 %               |
| Euro Bond   | EUR     | 2.256.030         | 3,20 %               | 303.681           | 2,87 %               |
| Euro Bond Absolute Return                               | EUR     | 1.582.732         | 1,79 %               | 457.788           | 1,35 %               |
| European High Yield Bond                                | EUR     | 6.650.924         | 1,19 %               | 5.901.351         | 1,44 %               |
| Global Bond   | USD     | 3.095.697         | 3,04 %               | 3.523.906         | 3,24 %               |
| Global Diversified Income FMP – 2024*                   | USD     | –                 | –                    | 230.333           | 0,15 %               |
| Global Flexible Credit Income                           | USD     | 7.478.307         | 1,68 %               | 6.035.383         | 1,55 %               |
| Global High Yield Engagement                            | USD     | 10.078.201        | 1,64 %               | 9.292.202         | 1,66 %               |
| Global Investment Grade Credit                          | USD     | 5.268.607         | 2,93 %               | 2.583.049         | 2,98 %               |
| Global Opportunistic Bond                               | USD     | 1.926.244         | 2,84 %               | 2.389.387         | 3,65 %               |
| High Yield Bond   | USD     | 31.494.953        | 1,66 %               | 37.191.056        | 1,65 %               |
| Macro Opportunities FX**                                | EUR     | –                 | –                    | 4.545             | 0,16 %               |
| Short Duration Emerging Market Debt                     | USD     | 51.507.746        | 1,36 %               | 42.766.959        | 1,08 %               |
| Short Duration Euro Bond                                | EUR     | 16.729.468        | 0,89 %               | 4.724.589         | 0,48 %               |
| Short Duration High Yield Engagement                    | USD     | 6.901.745         | 1,27 %               | 8.671.152         | 1,16 %               |
| Strategic Income  | USD     | 92.900.260        | 2,00 %               | 35.814.120        | 1,77 %               |
| Sustainable Asia High Yield                             | USD     | 346.772           | 1,09 %               | 346.613           | 1,21 %               |
| Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency        | USD     | 20.578.604        | 3,44 %               | 15.176.781        | 3,40 %               |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

| Portfolio (Fortsetzung) | Währung | 31. Dezember 2024 | % des Nettovermögens | 31. Dezember 2023 | % des Nettovermögens |
|-------------------------|---------|-------------------|----------------------|-------------------|----------------------|
| US Equity Premium       | USD     | 2.853.325         | 0,43 %               | 3.184.114         | 0,44 %               |
| US Long Short Equity    | USD     | –                 | –                    | 26.847            | 0,01 %               |

\* Das Portfolio wurde am 28. Juni 2024 aufgelöst.

\*\* Das Portfolio wurde am 8. Februar 2024 aufgelöst.

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

In den nachstehenden Tabellen sind die Zinsrisiken der betreffenden Portfolios zusammengefasst. Sie beinhalten die nicht-derivativen verzinslichen und unverzinslichen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Portfolios zu ihren jeweiligen beizulegenden Zeitwerten, klassifiziert nach Fälligkeitsterminen. Andere Beträge und Verbindlichkeiten unterliegen keinen Veränderungen von Zinssätzen.

Asia Responsible Transition Bond

31. Dezember 2024

| Umlaufvermögen   | Bis zu 1 Jahr<br>US\$ | 1 - 5 Jahre<br>US\$ | Über 5 Jahre<br>US\$ | Unverzinslich<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|--|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|-------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 592.471               | 9.177.498           | 16.335.943           | –                     | 26.105.912        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente   | 1.834.346             | –                   | –                    | –                     | 1.834.346         |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>  | <b>2.426.817</b>      | <b>9.177.498</b>    | <b>16.335.943</b>    | <b>–</b>              | <b>27.940.258</b> |

|   |   |   |   |   |   |
|---|---|---|---|---|---|
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b> | – | – | – | – | – |
|---|---|---|---|---|---|

|   |           |           |            |   |            |
|---|-----------|-----------|------------|---|------------|
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | 2.426.817 | 9.177.498 | 16.335.943 | – | 27.940.258 |
|---|-----------|-----------|------------|---|------------|

31. Dezember 2023

| Umlaufvermögen   | Bis zu 1 Jahr<br>US\$ | 1 - 5 Jahre<br>US\$ | Über 5 Jahre<br>US\$ | Unverzinslich<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|--|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|-------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet | 6.946.823             | 21.342.143          | 31.925.189           | –                     | 60.214.155        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente   | 2.708.868             | –                   | –                    | –                     | 2.708.868         |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>  | <b>9.655.691</b>      | <b>21.342.143</b>   | <b>31.925.189</b>    | <b>–</b>              | <b>62.923.023</b> |

|   |   |   |   |   |   |
|---|---|---|---|---|---|
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b> | – | – | – | – | – |
|---|---|---|---|---|---|

|   |           |            |            |   |            |
|---|-----------|------------|------------|---|------------|
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | 9.655.691 | 21.342.143 | 31.925.189 | – | 62.923.023 |
|---|-----------|------------|------------|---|------------|

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

## China Bond

## 31. Dezember 2024

| Umlaufvermögen  | Bis zu 1 Jahr<br>CNY | 1 - 5 Jahre<br>CNY | Über 5 Jahre<br>CNY | Unverzinslich<br>CNY | Insgesamt<br>CNY   |
|---|----------------------|--------------------|---------------------|----------------------|--------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 12.796.196           | 83.913.434         | 20.089.195          | –                    | 116.798.825        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 7.556.799            | –                  | –                   | –                    | 7.556.799          |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>20.352.995</b>    | <b>83.913.434</b>  | <b>20.089.195</b>   | <b>–</b>             | <b>124.355.624</b> |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>–</b>             | <b>–</b>           | <b>–</b>            | <b>–</b>             | <b>–</b>           |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>20.352.995</b>    | <b>83.913.434</b>  | <b>20.089.195</b>   | <b>–</b>             | <b>124.355.624</b> |

## 31. Dezember 2023

| Umlaufvermögen  | Bis zu 1 Jahr<br>CNY | 1 - 5 Jahre<br>CNY | Über 5 Jahre<br>CNY | Unverzinslich<br>CNY | Insgesamt<br>CNY   |
|---|----------------------|--------------------|---------------------|----------------------|--------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 134.244.166          | 240.367.488        | 69.958.142          | –                    | 444.569.796        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 9.446.611            | –                  | –                   | –                    | 9.446.611          |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>143.690.777</b>   | <b>240.367.488</b> | <b>69.958.142</b>   | <b>–</b>             | <b>454.016.407</b> |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>–</b>             | <b>–</b>           | <b>–</b>            | <b>–</b>             | <b>–</b>           |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>143.690.777</b>   | <b>240.367.488</b> | <b>69.958.142</b>   | <b>–</b>             | <b>454.016.407</b> |

## CLO Income

## 31. Dezember 2024

| Umlaufvermögen  | Bis zu 1 Jahr<br>US\$ | 1 - 5 Jahre<br>US\$ | Über 5 Jahre<br>US\$ | Unverzinslich<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$    |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|----------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 164.545.443           | –                   | 934.118.980          | –                     | 1.098.664.423        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 13.609.709            | –                   | –                    | –                     | 13.609.709           |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>178.155.152</b>    | <b>–</b>            | <b>934.118.980</b>   | <b>–</b>              | <b>1.112.274.132</b> |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>–</b>              | <b>–</b>            | <b>–</b>             | <b>–</b>              | <b>–</b>             |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>178.155.152</b>    | <b>–</b>            | <b>934.118.980</b>   | <b>–</b>              | <b>1.112.274.132</b> |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

CLO Income (Fortsetzung)

31. Dezember 2023

| Umlaufvermögen  | Bis zu 1 Jahr<br>US\$ | 1 - 5 Jahre<br>US\$ | Über 5 Jahre<br>US\$ | Unverzinslich<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|--------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 4.994.906             | 3.895.503           | 155.791.572          | 12.221.060            | 176.903.041        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 12.287.210            | –                   | –                    | –                     | 12.287.210         |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>17.282.116</b>     | <b>3.895.503</b>    | <b>155.791.572</b>   | <b>12.221.060</b>     | <b>189.190.251</b> |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>–</b>              | <b>–</b>            | <b>–</b>             | <b>–</b>              | <b>–</b>           |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>17.282.116</b>     | <b>3.895.503</b>    | <b>155.791.572</b>   | <b>12.221.060</b>     | <b>189.190.251</b> |

Commodities

31. Dezember 2024

| Umlaufvermögen  | Bis zu 1 Jahr<br>US\$ | 1 - 5 Jahre<br>US\$ | Über 5 Jahre<br>US\$ | Unverzinslich<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|--------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 85.689.115            | 47.191.214          | –                    | –                     | 132.880.329        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 22.706.391            | –                   | –                    | –                     | 22.706.391         |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>108.395.506</b>    | <b>47.191.214</b>   | <b>–</b>             | <b>–</b>              | <b>155.586.720</b> |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>–</b>              | <b>–</b>            | <b>–</b>             | <b>–</b>              | <b>–</b>           |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>108.395.506</b>    | <b>47.191.214</b>   | <b>–</b>             | <b>–</b>              | <b>155.586.720</b> |

31. Dezember 2023

| Umlaufvermögen  | Bis zu 1 Jahr<br>US\$ | 1 - 5 Jahre<br>US\$ | Über 5 Jahre<br>US\$ | Unverzinslich<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|--------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 97.662.888            | 23.310.069          | –                    | –                     | 120.972.957        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 33.206.631            | –                   | –                    | –                     | 33.206.631         |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>130.869.519</b>    | <b>23.310.069</b>   | <b>–</b>             | <b>–</b>              | <b>154.179.588</b> |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>–</b>              | <b>–</b>            | <b>–</b>             | <b>–</b>              | <b>–</b>           |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>130.869.519</b>    | <b>23.310.069</b>   | <b>–</b>             | <b>–</b>              | <b>154.179.588</b> |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

## Corporate Hybrid Bond

## 31. Dezember 2024

| Umlaufvermögen  | Bis zu 1 Jahr<br>EUR | 1 - 5 Jahre<br>EUR | Über 5 Jahre<br>EUR  | Unverzinslich<br>EUR | Insgesamt<br>EUR     |
|---|----------------------|--------------------|----------------------|----------------------|----------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 14.002.897           | –                  | 2.167.985.323        | 12.265.572           | 2.194.253.792        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 112.576.339          | –                  | –                    | –                    | 112.576.339          |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>126.579.236</b>   | <b>–</b>           | <b>2.167.985.323</b> | <b>12.265.572</b>    | <b>2.306.830.131</b> |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>–</b>             | <b>–</b>           | <b>–</b>             | <b>–</b>             | <b>–</b>             |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>126.579.236</b>   | <b>–</b>           | <b>2.167.985.323</b> | <b>12.265.572</b>    | <b>2.306.830.131</b> |

## 31. Dezember 2023

| Umlaufvermögen  | Bis zu 1 Jahr<br>EUR | 1 - 5 Jahre<br>EUR | Über 5 Jahre<br>EUR  | Unverzinslich<br>EUR | Insgesamt<br>EUR     |
|---|----------------------|--------------------|----------------------|----------------------|----------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | –                    | –                  | 1.743.583.625        | 10.956.412           | 1.754.540.037        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 79.423.824           | –                  | –                    | –                    | 79.423.824           |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>79.423.824</b>    | <b>–</b>           | <b>1.743.583.625</b> | <b>10.956.412</b>    | <b>1.833.963.861</b> |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>–</b>             | <b>–</b>           | <b>–</b>             | <b>–</b>             | <b>–</b>             |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>79.423.824</b>    | <b>–</b>           | <b>1.743.583.625</b> | <b>10.956.412</b>    | <b>1.833.963.861</b> |

Developed Market FMP – 2027<sup>1</sup>

## 31. Dezember 2024

| Umlaufvermögen  | Bis zu 1 Jahr<br>US\$ | 1 - 5 Jahre<br>US\$ | Über 5 Jahre<br>US\$ | Unverzinslich<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|--------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 563.148               | 125.116.302         | –                    | –                     | 125.679.450        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 563.777               | –                   | –                    | –                     | 563.777            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>1.126.925</b>      | <b>125.116.302</b>  | <b>–</b>             | <b>–</b>              | <b>126.243.227</b> |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>–</b>              | <b>–</b>            | <b>–</b>             | <b>–</b>              | <b>–</b>           |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>1.126.925</b>      | <b>125.116.302</b>  | <b>–</b>             | <b>–</b>              | <b>126.243.227</b> |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Developed Market FMP – 2027<sup>1</sup> (Fortsetzung)

31. Dezember 2023

|   | Bis zu 1 Jahr  | 1 - 5 Jahre        | Über 5 Jahre | Unverzinslich | Insgesamt          |
|---|----------------|--------------------|--------------|---------------|--------------------|
| Umlaufvermögen  | US\$           | US\$               | US\$         | US\$          | US\$               |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | –              | 135.777.186        | –            | –             | 135.777.186        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 503.437        | –                  | –            | –             | 503.437            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>503.437</b> | <b>135.777.186</b> | <b>–</b>     | <b>–</b>      | <b>136.280.623</b> |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>–</b>       | <b>–</b>           | <b>–</b>     | <b>–</b>      | <b>–</b>           |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>503.437</b> | <b>135.777.186</b> | <b>–</b>     | <b>–</b>      | <b>136.280.623</b> |

EMD Corporate – Social and Environmental Transition

31. Dezember 2024

|   | Bis zu 1 Jahr    | 1 - 5 Jahre       | Über 5 Jahre      | Unverzinslich | Insgesamt          |
|---|------------------|-------------------|-------------------|---------------|--------------------|
| Umlaufvermögen  | US\$             | US\$              | US\$              | US\$          | US\$               |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 193.052          | 40.884.645        | 70.824.059        | –             | 111.901.756        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 1.999.150        | –                 | –                 | –             | 1.999.150          |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>2.192.202</b> | <b>40.884.645</b> | <b>70.824.059</b> | <b>–</b>      | <b>113.900.906</b> |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>–</b>         | <b>–</b>          | <b>–</b>          | <b>–</b>      | <b>–</b>           |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>2.192.202</b> | <b>40.884.645</b> | <b>70.824.059</b> | <b>–</b>      | <b>113.900.906</b> |

31. Dezember 2023

|   | Bis zu 1 Jahr    | 1 - 5 Jahre       | Über 5 Jahre      | Unverzinslich | Insgesamt         |
|---|------------------|-------------------|-------------------|---------------|-------------------|
| Umlaufvermögen  | US\$             | US\$              | US\$              | US\$          | US\$              |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 1.802.010        | 34.834.285        | 53.996.504        | –             | 90.632.799        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 3.976.271        | –                 | –                 | –             | 3.976.271         |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>5.778.281</b> | <b>34.834.285</b> | <b>53.996.504</b> | <b>–</b>      | <b>94.609.070</b> |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>–</b>         | <b>–</b>          | <b>–</b>          | <b>–</b>      | <b>–</b>          |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>5.778.281</b> | <b>34.834.285</b> | <b>53.996.504</b> | <b>–</b>      | <b>94.609.070</b> |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

## Emerging Market Debt – Hard Currency

## 31. Dezember 2024

| Umlaufvermögen  | Bis zu 1 Jahr<br>US\$ | 1 - 5 Jahre<br>US\$ | Über 5 Jahre<br>US\$ | Unverzinslich<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$    |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|----------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 88.810.104            | 362.092.549         | 2.164.730.918        | –                     | 2.615.633.571        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 39.879.035            | –                   | –                    | –                     | 39.879.035           |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>128.689.139</b>    | <b>362.092.549</b>  | <b>2.164.730.918</b> | <b>–</b>              | <b>2.655.512.606</b> |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>–</b>              | <b>–</b>            | <b>–</b>             | <b>–</b>              | <b>–</b>             |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>128.689.139</b>    | <b>362.092.549</b>  | <b>2.164.730.918</b> | <b>–</b>              | <b>2.655.512.606</b> |

## 31. Dezember 2023

| Umlaufvermögen  | Bis zu 1 Jahr<br>US\$ | 1 - 5 Jahre<br>US\$ | Über 5 Jahre<br>US\$ | Unverzinslich<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$    |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|----------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 69.873.754            | 338.390.937         | 2.118.360.675        | 17.580.000            | 2.544.205.366        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 2.306.275             | –                   | –                    | –                     | 2.306.275            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>72.180.029</b>     | <b>338.390.937</b>  | <b>2.118.360.675</b> | <b>17.580.000</b>     | <b>2.546.511.641</b> |
| Kontenüberziehung   | 31.716                | –                   | –                    | –                     | 31.716               |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>31.716</b>         | <b>–</b>            | <b>–</b>             | <b>–</b>              | <b>31.716</b>        |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>72.148.313</b>     | <b>338.390.937</b>  | <b>2.118.360.675</b> | <b>17.580.000</b>     | <b>2.546.479.925</b> |

## Emerging Market Debt – Local Currency

## 31. Dezember 2024

| Umlaufvermögen  | Bis zu 1 Jahr<br>US\$ | 1 - 5 Jahre<br>US\$ | Über 5 Jahre<br>US\$ | Unverzinslich<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$    |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|----------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 24.293.779            | 324.129.016         | 682.140.207          | 4.040.368             | 1.034.603.370        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 12.909.847            | –                   | –                    | –                     | 12.909.847           |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>37.203.626</b>     | <b>324.129.016</b>  | <b>682.140.207</b>   | <b>4.040.368</b>      | <b>1.047.513.217</b> |
| Kontenüberziehung   | 2.396                 | –                   | –                    | –                     | 2.396                |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>2.396</b>          | <b>–</b>            | <b>–</b>             | <b>–</b>              | <b>2.396</b>         |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>37.201.230</b>     | <b>324.129.016</b>  | <b>682.140.207</b>   | <b>4.040.368</b>      | <b>1.047.510.821</b> |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Emerging Market Debt – Local Currency (Fortsetzung)

31. Dezember 2023

| Umlaufvermögen  | Bis zu 1 Jahr<br>US\$ | 1 - 5 Jahre<br>US\$ | Über 5 Jahre<br>US\$ | Unverzinslich<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$    |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|----------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 44.652.360            | 409.726.253         | 745.209.971          | 16.173.300            | 1.215.761.884        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 34.899.630            | –                   | –                    | –                     | 34.899.630           |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>79.551.990</b>     | <b>409.726.253</b>  | <b>745.209.971</b>   | <b>16.173.300</b>     | <b>1.250.661.514</b> |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>–</b>              | <b>–</b>            | <b>–</b>             | <b>–</b>              | <b>–</b>             |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>79.551.990</b>     | <b>409.726.253</b>  | <b>745.209.971</b>   | <b>16.173.300</b>     | <b>1.250.661.514</b> |

Emerging Market Debt Blend

31. Dezember 2024

| Umlaufvermögen  | Bis zu 1 Jahr<br>US\$ | 1 - 5 Jahre<br>US\$ | Über 5 Jahre<br>US\$ | Unverzinslich<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|--------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 9.354.655             | 103.538.377         | 343.866.406          | 4.001.641             | 460.761.079        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 45.252.303            | –                   | –                    | –                     | 45.252.303         |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>54.606.958</b>     | <b>103.538.377</b>  | <b>343.866.406</b>   | <b>4.001.641</b>      | <b>506.013.382</b> |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>–</b>              | <b>–</b>            | <b>–</b>             | <b>–</b>              | <b>–</b>           |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>54.606.958</b>     | <b>103.538.377</b>  | <b>343.866.406</b>   | <b>4.001.641</b>      | <b>506.013.382</b> |

31. Dezember 2023

| Umlaufvermögen  | Bis zu 1 Jahr<br>US\$ | 1 - 5 Jahre<br>US\$ | Über 5 Jahre<br>US\$ | Unverzinslich<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|--------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 16.974.932            | 144.936.438         | 317.740.980          | 14.297.035            | 493.949.385        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 15.095.815            | –                   | –                    | –                     | 15.095.815         |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>32.070.747</b>     | <b>144.936.438</b>  | <b>317.740.980</b>   | <b>14.297.035</b>     | <b>509.045.200</b> |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>–</b>              | <b>–</b>            | <b>–</b>             | <b>–</b>              | <b>–</b>           |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>32.070.747</b>     | <b>144.936.438</b>  | <b>317.740.980</b>   | <b>14.297.035</b>     | <b>509.045.200</b> |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend

## 31. Dezember 2024

|   | Bis zu 1 Jahr    | 1 - 5 Jahre      | Über 5 Jahre      | Unverzinslich | Insgesamt         |
|---|------------------|------------------|-------------------|---------------|-------------------|
| Umlaufvermögen  | US\$             | US\$             | US\$              | US\$          | US\$              |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 200.402          | 9.474.498        | 42.465.945        | –             | 52.140.845        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 4.462.142        | –                | –                 | –             | 4.462.142         |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>4.662.544</b> | <b>9.474.498</b> | <b>42.465.945</b> | <b>–</b>      | <b>56.602.987</b> |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>–</b>         | <b>–</b>         | <b>–</b>          | <b>–</b>      | <b>–</b>          |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>4.662.544</b> | <b>9.474.498</b> | <b>42.465.945</b> | <b>–</b>      | <b>56.602.987</b> |

## 31. Dezember 2023

|   | Bis zu 1 Jahr    | 1 - 5 Jahre       | Über 5 Jahre      | Unverzinslich | Insgesamt         |
|---|------------------|-------------------|-------------------|---------------|-------------------|
| Umlaufvermögen  | US\$             | US\$              | US\$              | US\$          | US\$              |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 1.497.397        | 11.238.841        | 45.591.084        | –             | 58.327.322        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 2.754.078        | –                 | –                 | –             | 2.754.078         |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>4.251.475</b> | <b>11.238.841</b> | <b>45.591.084</b> | <b>–</b>      | <b>61.081.400</b> |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>–</b>         | <b>–</b>          | <b>–</b>          | <b>–</b>      | <b>–</b>          |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>4.251.475</b> | <b>11.238.841</b> | <b>45.591.084</b> | <b>–</b>      | <b>61.081.400</b> |

## Euro Bond

## 31. Dezember 2024

|   | Bis zu 1 Jahr    | 1 - 5 Jahre       | Über 5 Jahre      | Unverzinslich | Insgesamt         |
|---|------------------|-------------------|-------------------|---------------|-------------------|
| Umlaufvermögen  | EUR              | EUR               | EUR               | EUR           | EUR               |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 1.638.925        | 23.788.076        | 42.321.638        | –             | 67.748.639        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 410.347          | –                 | –                 | –             | 410.347           |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>2.049.272</b> | <b>23.788.076</b> | <b>42.321.638</b> | <b>–</b>      | <b>68.158.986</b> |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>–</b>         | <b>–</b>          | <b>–</b>          | <b>–</b>      | <b>–</b>          |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>2.049.272</b> | <b>23.788.076</b> | <b>42.321.638</b> | <b>–</b>      | <b>68.158.986</b> |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Euro Bond (Fortsetzung)

31. Dezember 2023

| Umlaufvermögen  | Bis zu 1 Jahr<br>EUR | 1 - 5 Jahre<br>EUR | Über 5 Jahre<br>EUR | Unverzinslich<br>EUR | Insgesamt<br>EUR  |
|---|----------------------|--------------------|---------------------|----------------------|-------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 463.336              | 3.556.701          | 6.153.523           | –                    | 10.173.560        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 127.676              | –                  | –                   | –                    | 127.676           |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>591.012</b>       | <b>3.556.701</b>   | <b>6.153.523</b>    | <b>–</b>             | <b>10.301.236</b> |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>–</b>             | <b>–</b>           | <b>–</b>            | <b>–</b>             | <b>–</b>          |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>591.012</b>       | <b>3.556.701</b>   | <b>6.153.523</b>    | <b>–</b>             | <b>10.301.236</b> |

Euro Bond Absolute Return

31. Dezember 2024

| Umlaufvermögen  | Bis zu 1 Jahr<br>EUR | 1 - 5 Jahre<br>EUR | Über 5 Jahre<br>EUR | Unverzinslich<br>EUR | Insgesamt<br>EUR  |
|---|----------------------|--------------------|---------------------|----------------------|-------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 390.609              | 28.515.205         | 52.889.143          | –                    | 81.794.957        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 1.875.873            | –                  | –                   | –                    | 1.875.873         |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>2.266.482</b>     | <b>28.515.205</b>  | <b>52.889.143</b>   | <b>–</b>             | <b>83.670.830</b> |
| Kontenüberziehung   | 2.588                | –                  | –                   | –                    | 2.588             |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>2.588</b>         | <b>–</b>           | <b>–</b>            | <b>–</b>             | <b>2.588</b>      |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>2.263.894</b>     | <b>28.515.205</b>  | <b>52.889.143</b>   | <b>–</b>             | <b>83.668.242</b> |

31. Dezember 2023

| Umlaufvermögen  | Bis zu 1 Jahr<br>EUR | 1 - 5 Jahre<br>EUR | Über 5 Jahre<br>EUR | Unverzinslich<br>EUR | Insgesamt<br>EUR  |
|---|----------------------|--------------------|---------------------|----------------------|-------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 298.150              | 9.792.927          | 23.081.964          | –                    | 33.173.041        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 460.317              | –                  | –                   | –                    | 460.317           |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>758.467</b>       | <b>9.792.927</b>   | <b>23.081.964</b>   | <b>–</b>             | <b>33.633.358</b> |
| Kontenüberziehung   | 412.247              | –                  | –                   | –                    | 412.247           |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>412.247</b>       | <b>–</b>           | <b>–</b>            | <b>–</b>             | <b>412.247</b>    |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>346.220</b>       | <b>9.792.927</b>   | <b>23.081.964</b>   | <b>–</b>             | <b>33.221.111</b> |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

## European High Yield Bond

## 31. Dezember 2024

| Umlaufvermögen  | Bis zu 1 Jahr<br>EUR | 1 - 5 Jahre<br>EUR | Über 5 Jahre<br>EUR | Unverzinslich<br>EUR | Insgesamt<br>EUR   |
|---|----------------------|--------------------|---------------------|----------------------|--------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 8.280.679            | 293.053.229        | 232.876.874         | –                    | 534.210.782        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 17.956.780           | –                  | –                   | –                    | 17.956.780         |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>26.237.459</b>    | <b>293.053.229</b> | <b>232.876.874</b>  | <b>–</b>             | <b>552.167.562</b> |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>–</b>             | <b>–</b>           | <b>–</b>            | <b>–</b>             | <b>–</b>           |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>26.237.459</b>    | <b>293.053.229</b> | <b>232.876.874</b>  | <b>–</b>             | <b>552.167.562</b> |

## 31. Dezember 2023

| Umlaufvermögen  | Bis zu 1 Jahr<br>EUR | 1 - 5 Jahre<br>EUR | Über 5 Jahre<br>EUR | Unverzinslich<br>EUR | Insgesamt<br>EUR   |
|---|----------------------|--------------------|---------------------|----------------------|--------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 5.157.916            | 222.392.136        | 159.423.752         | –                    | 386.973.804        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 16.624.528           | –                  | –                   | –                    | 16.624.528         |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>21.782.444</b>    | <b>222.392.136</b> | <b>159.423.752</b>  | <b>–</b>             | <b>403.598.332</b> |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>–</b>             | <b>–</b>           | <b>–</b>            | <b>–</b>             | <b>–</b>           |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>21.782.444</b>    | <b>222.392.136</b> | <b>159.423.752</b>  | <b>–</b>             | <b>403.598.332</b> |

## Event Driven

## 31. Dezember 2024

| Umlaufvermögen  | Bis zu 1 Jahr<br>US\$ | 1 - 5 Jahre<br>US\$ | Über 5 Jahre<br>US\$ | Unverzinslich<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|--------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 158.481.479           | 118.659.544         | –                    | –                     | 277.141.023        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 24.610.182            | –                   | –                    | –                     | 24.610.182         |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>183.091.661</b>    | <b>118.659.544</b>  | <b>–</b>             | <b>–</b>              | <b>301.751.205</b> |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>–</b>              | <b>–</b>            | <b>–</b>             | <b>–</b>              | <b>–</b>           |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>183.091.661</b>    | <b>118.659.544</b>  | <b>–</b>             | <b>–</b>              | <b>301.751.205</b> |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Event Driven (Fortsetzung)

31. Dezember 2023

|   | Bis zu 1 Jahr<br>US\$ | 1 - 5 Jahre<br>US\$ | Über 5 Jahre<br>US\$ | Unverzinslich<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|-------------------|
| <b>Umlaufvermögen</b>   |                       |                     |                      |                       |                   |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 115.039.719           | –                   | –                    | –                     | 115.039.719       |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 13.500.176            | –                   | –                    | –                     | 13.500.176        |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | 128.539.895           | –                   | –                    | –                     | 128.539.895       |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | –                     | –                   | –                    | –                     | –                 |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | 128.539.895           | –                   | –                    | –                     | 128.539.895       |

Global Bond

31. Dezember 2024

|   | Bis zu 1 Jahr<br>US\$ | 1 - 5 Jahre<br>US\$ | Über 5 Jahre<br>US\$ | Unverzinslich<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|-------------------|
| <b>Umlaufvermögen</b>   |                       |                     |                      |                       |                   |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 549.580               | 17.354.452          | 79.139.755           | –                     | 97.043.787        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 4.741.796             | –                   | –                    | –                     | 4.741.796         |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | 5.291.376             | 17.354.452          | 79.139.755           | –                     | 101.785.583       |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | –                     | –                   | –                    | –                     | –                 |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | 5.291.376             | 17.354.452          | 79.139.755           | –                     | 101.785.583       |

31. Dezember 2023

|   | Bis zu 1 Jahr<br>US\$ | 1 - 5 Jahre<br>US\$ | Über 5 Jahre<br>US\$ | Unverzinslich<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|-------------------|
| <b>Umlaufvermögen</b>   |                       |                     |                      |                       |                   |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 1.825.203             | 18.329.072          | 87.118.370           | –                     | 107.272.645       |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 1.162.072             | –                   | –                    | –                     | 1.162.072         |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | 2.987.275             | 18.329.072          | 87.118.370           | –                     | 108.434.717       |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | –                     | –                   | –                    | –                     | –                 |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | 2.987.275             | 18.329.072          | 87.118.370           | –                     | 108.434.717       |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

## Global Diversified Income FMP – 2024\*

## 31. Dezember 2023

|   | Bis zu 1 Jahr<br>US\$ | 1 - 5 Jahre<br>US\$ | Über 5 Jahre<br>US\$ | Unverzinslich<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|-------------------|
| <b>Umlaufvermögen</b>   |                       |                     |                      |                       |                   |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 143.083.313           | –                   | 874.554              | –                     | 143.957.867       |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 11.026.949            | –                   | –                    | –                     | 11.026.949        |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | 154.110.262           | –                   | 874.554              | –                     | 154.984.816       |
| Kontenüberziehung   | 13                    | –                   | –                    | –                     | 13                |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | 13                    | –                   | –                    | –                     | 13                |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | 154.110.249           | –                   | 874.554              | –                     | 154.984.803       |

\* Das Portfolio wurde am 28. Juni 2024 aufgelöst.

## Global Flexible Credit Income

## 31. Dezember 2024

|   | Bis zu 1 Jahr<br>US\$ | 1 - 5 Jahre<br>US\$ | Über 5 Jahre<br>US\$ | Unverzinslich<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|-------------------|
| <b>Umlaufvermögen</b>   |                       |                     |                      |                       |                   |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 103.279               | 149.486.420         | 281.436.656          | 6.591.250             | 437.617.605       |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 6.639.688             | –                   | –                    | –                     | 6.639.688         |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | 6.742.967             | 149.486.420         | 281.436.656          | 6.591.250             | 444.257.293       |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | –                     | –                   | –                    | –                     | –                 |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | 6.742.967             | 149.486.420         | 281.436.656          | 6.591.250             | 444.257.293       |

## 31. Dezember 2023

|   | Bis zu 1 Jahr<br>US\$ | 1 - 5 Jahre<br>US\$ | Über 5 Jahre<br>US\$ | Unverzinslich<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|-------------------|
| <b>Umlaufvermögen</b>   |                       |                     |                      |                       |                   |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 2.915.203             | 140.275.024         | 206.687.076          | 6.088.915             | 355.966.218       |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 25.482.094            | –                   | –                    | –                     | 25.482.094        |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | 28.397.297            | 140.275.024         | 206.687.076          | 6.088.915             | 381.448.312       |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | –                     | –                   | –                    | –                     | –                 |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | 28.397.297            | 140.275.024         | 206.687.076          | 6.088.915             | 381.448.312       |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Global High Yield Engagement

31. Dezember 2024

| Umlaufvermögen  | Bis zu 1 Jahr<br>US\$ | 1 - 5 Jahre<br>US\$ | Über 5 Jahre<br>US\$ | Unverzinslich<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|--------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 15.598.217            | 308.360.229         | 283.162.096          | –                     | 607.120.542        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 6.987.154             | –                   | –                    | –                     | 6.987.154          |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>22.585.371</b>     | <b>308.360.229</b>  | <b>283.162.096</b>   | <b>–</b>              | <b>614.107.696</b> |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>–</b>              | <b>–</b>            | <b>–</b>             | <b>–</b>              | <b>–</b>           |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>22.585.371</b>     | <b>308.360.229</b>  | <b>283.162.096</b>   | <b>–</b>              | <b>614.107.696</b> |

31. Dezember 2023

| Umlaufvermögen  | Bis zu 1 Jahr<br>US\$ | 1 - 5 Jahre<br>US\$ | Über 5 Jahre<br>US\$ | Unverzinslich<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|--------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 5.784.900             | 265.500.629         | 261.218.885          | –                     | 532.504.414        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 10.709.205            | –                   | –                    | –                     | 10.709.205         |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>16.494.105</b>     | <b>265.500.629</b>  | <b>261.218.885</b>   | <b>–</b>              | <b>543.213.619</b> |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>–</b>              | <b>–</b>            | <b>–</b>             | <b>–</b>              | <b>–</b>           |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>16.494.105</b>     | <b>265.500.629</b>  | <b>261.218.885</b>   | <b>–</b>              | <b>543.213.619</b> |

Global Investment Grade Credit

31. Dezember 2024

| Umlaufvermögen  | Bis zu 1 Jahr<br>US\$ | 1 - 5 Jahre<br>US\$ | Über 5 Jahre<br>US\$ | Unverzinslich<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|--------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 2.165.668             | 47.688.678          | 122.322.360          | –                     | 172.176.706        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 5.007.265             | –                   | –                    | –                     | 5.007.265          |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>7.172.933</b>      | <b>47.688.678</b>   | <b>122.322.360</b>   | <b>–</b>              | <b>177.183.971</b> |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>–</b>              | <b>–</b>            | <b>–</b>             | <b>–</b>              | <b>–</b>           |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>7.172.933</b>      | <b>47.688.678</b>   | <b>122.322.360</b>   | <b>–</b>              | <b>177.183.971</b> |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

## Global Investment Grade Credit (Fortsetzung)

## 31. Dezember 2023

| Umlaufvermögen  | Bis zu 1 Jahr<br>US\$ | 1 - 5 Jahre<br>US\$ | Über 5 Jahre<br>US\$ | Unverzinslich<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|-------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 1.112.393             | 28.149.954          | 54.196.428           | –                     | 83.458.775        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 3.401.463             | –                   | –                    | –                     | 3.401.463         |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>4.513.856</b>      | <b>28.149.954</b>   | <b>54.196.428</b>    | <b>–</b>              | <b>86.860.238</b> |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>–</b>              | <b>–</b>            | <b>–</b>             | <b>–</b>              | <b>–</b>          |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>4.513.856</b>      | <b>28.149.954</b>   | <b>54.196.428</b>    | <b>–</b>              | <b>86.860.238</b> |

## Global Opportunistic Bond

## 31. Dezember 2024

| Umlaufvermögen  | Bis zu 1 Jahr<br>US\$ | 1 - 5 Jahre<br>US\$ | Über 5 Jahre<br>US\$ | Unverzinslich<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|-------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 659.455               | 13.807.294          | 44.349.863           | 2.199                 | 58.818.811        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 5.289.493             | –                   | –                    | –                     | 5.289.493         |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>5.948.948</b>      | <b>13.807.294</b>   | <b>44.349.863</b>    | <b>2.199</b>          | <b>64.108.304</b> |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>–</b>              | <b>–</b>            | <b>–</b>             | <b>–</b>              | <b>–</b>          |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>5.948.948</b>      | <b>13.807.294</b>   | <b>44.349.863</b>    | <b>2.199</b>          | <b>64.108.304</b> |

## 31. Dezember 2023

| Umlaufvermögen  | Bis zu 1 Jahr<br>US\$ | 1 - 5 Jahre<br>US\$ | Über 5 Jahre<br>US\$ | Unverzinslich<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|-------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 1.205.126             | 8.733.528           | 54.990.329           | 21.165                | 64.950.148        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 1.529.454             | –                   | –                    | –                     | 1.529.454         |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>2.734.580</b>      | <b>8.733.528</b>    | <b>54.990.329</b>    | <b>21.165</b>         | <b>66.479.602</b> |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>–</b>              | <b>–</b>            | <b>–</b>             | <b>–</b>              | <b>–</b>          |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>2.734.580</b>      | <b>8.733.528</b>    | <b>54.990.329</b>    | <b>21.165</b>         | <b>66.479.602</b> |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

High Yield Bond

31. Dezember 2024

| Umlaufvermögen  | Bis zu 1 Jahr<br>US\$ | 1 - 5 Jahre<br>US\$ | Über 5 Jahre<br>US\$ | Unverzinslich<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$    |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|----------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 66.000.000            | 966.827.038         | 881.759.784          | 375.146               | 1.914.961.968        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 11.279.907            | –                   | –                    | –                     | 11.279.907           |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>77.279.907</b>     | <b>966.827.038</b>  | <b>881.759.784</b>   | <b>375.146</b>        | <b>1.926.241.875</b> |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>–</b>              | <b>–</b>            | <b>–</b>             | <b>–</b>              | <b>–</b>             |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>77.279.907</b>     | <b>966.827.038</b>  | <b>881.759.784</b>   | <b>375.146</b>        | <b>1.926.241.875</b> |

31. Dezember 2023

| Umlaufvermögen  | Bis zu 1 Jahr<br>US\$ | 1 - 5 Jahre<br>US\$ | Über 5 Jahre<br>US\$ | Unverzinslich<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$    |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|----------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 11.110.249            | 925.395.910         | 1.152.879.000        | 3.611.285             | 2.092.996.444        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 73.617.932            | –                   | –                    | –                     | 73.617.932           |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>84.728.181</b>     | <b>925.395.910</b>  | <b>1.152.879.000</b> | <b>3.611.285</b>      | <b>2.166.614.376</b> |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>–</b>              | <b>–</b>            | <b>–</b>             | <b>–</b>              | <b>–</b>             |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>84.728.181</b>     | <b>925.395.910</b>  | <b>1.152.879.000</b> | <b>3.611.285</b>      | <b>2.166.614.376</b> |

Macro Opportunities FX\*

31. Dezember 2023

| Umlaufvermögen  | Bis zu 1 Jahr<br>EUR | 1 - 5 Jahre<br>EUR | Über 5 Jahre<br>EUR | Unverzinslich<br>EUR | Insgesamt<br>EUR |
|---|----------------------|--------------------|---------------------|----------------------|------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 2.754.542            | –                  | –                   | –                    | 2.754.542        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 126.875              | –                  | –                   | –                    | 126.875          |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>2.881.417</b>     | <b>–</b>           | <b>–</b>            | <b>–</b>             | <b>2.881.417</b> |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>–</b>             | <b>–</b>           | <b>–</b>            | <b>–</b>             | <b>–</b>         |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>2.881.417</b>     | <b>–</b>           | <b>–</b>            | <b>–</b>             | <b>2.881.417</b> |

\* Das Portfolio wurde am 8. Februar 2024 aufgelöst.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

## Short Duration Emerging Market Debt

## 31. Dezember 2024

|   | Bis zu 1 Jahr      | 1 - 5 Jahre          | Über 5 Jahre       | Unverzinslich | Insgesamt            |
|---|--------------------|----------------------|--------------------|---------------|----------------------|
| Umlaufvermögen  | US\$               | US\$                 | US\$               | US\$          | US\$                 |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 441.612.301        | 2.532.579.683        | 785.497.478        | –             | 3.759.689.462        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 21.417.061         | –                    | –                  | –             | 21.417.061           |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>463.029.362</b> | <b>2.532.579.683</b> | <b>785.497.478</b> | <b>–</b>      | <b>3.781.106.523</b> |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>–</b>           | <b>–</b>             | <b>–</b>           | <b>–</b>      | <b>–</b>             |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>463.029.362</b> | <b>2.532.579.683</b> | <b>785.497.478</b> | <b>–</b>      | <b>3.781.106.523</b> |

## 31. Dezember 2023

|   | Bis zu 1 Jahr      | 1 - 5 Jahre          | Über 5 Jahre       | Unverzinslich     | Insgesamt            |
|---|--------------------|----------------------|--------------------|-------------------|----------------------|
| Umlaufvermögen  | US\$               | US\$                 | US\$               | US\$              | US\$                 |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 709.354.762        | 2.565.462.463        | 493.196.793        | 49.810.000        | 3.817.824.018        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 14.257.955         | –                    | –                  | –                 | 14.257.955           |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>723.612.717</b> | <b>2.565.462.463</b> | <b>493.196.793</b> | <b>49.810.000</b> | <b>3.832.081.973</b> |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>–</b>           | <b>–</b>             | <b>–</b>           | <b>–</b>          | <b>–</b>             |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>723.612.717</b> | <b>2.565.462.463</b> | <b>493.196.793</b> | <b>49.810.000</b> | <b>3.832.081.973</b> |

## Short Duration Euro Bond

## 31. Dezember 2024

|   | Bis zu 1 Jahr      | 1 - 5 Jahre        | Über 5 Jahre       | Unverzinslich     | Insgesamt            |
|---|--------------------|--------------------|--------------------|-------------------|----------------------|
| Umlaufvermögen  | EUR                | EUR                | EUR                | EUR               | EUR                  |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 146.186.646        | 776.663.419        | 819.802.898        | 33.954.800        | 1.776.607.763        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 79.541.949         | –                  | –                  | –                 | 79.541.949           |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>225.728.595</b> | <b>776.663.419</b> | <b>819.802.898</b> | <b>33.954.800</b> | <b>1.856.149.712</b> |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>–</b>           | <b>–</b>           | <b>–</b>           | <b>–</b>          | <b>–</b>             |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>225.728.595</b> | <b>776.663.419</b> | <b>819.802.898</b> | <b>33.954.800</b> | <b>1.856.149.712</b> |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Short Duration Euro Bond (Fortsetzung)

31. Dezember 2023

| Umlaufvermögen  | Bis zu 1 Jahr<br>EUR | 1 - 5 Jahre<br>EUR | Über 5 Jahre<br>EUR | Unverzinslich<br>EUR | Insgesamt<br>EUR   |
|---|----------------------|--------------------|---------------------|----------------------|--------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 151.715.505          | 550.851.730        | 261.634.553         | –                    | 964.201.788        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 11.222.572           | –                  | –                   | –                    | 11.222.572         |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>162.938.077</b>   | <b>550.851.730</b> | <b>261.634.553</b>  | <b>–</b>             | <b>975.424.360</b> |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>–</b>             | <b>–</b>           | <b>–</b>            | <b>–</b>             | <b>–</b>           |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>162.938.077</b>   | <b>550.851.730</b> | <b>261.634.553</b>  | <b>–</b>             | <b>975.424.360</b> |

Short Duration High Yield Engagement

31. Dezember 2024

| Umlaufvermögen  | Bis zu 1 Jahr<br>US\$ | 1 - 5 Jahre<br>US\$ | Über 5 Jahre<br>US\$ | Unverzinslich<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|--------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 19.761.515            | 482.707.767         | 47.470.541           | 5.111.662             | 555.051.485        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 2.746.504             | –                   | –                    | –                     | 2.746.504          |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>22.508.019</b>     | <b>482.707.767</b>  | <b>47.470.541</b>    | <b>5.111.662</b>      | <b>557.797.989</b> |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>–</b>              | <b>–</b>            | <b>–</b>             | <b>–</b>              | <b>–</b>           |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>22.508.019</b>     | <b>482.707.767</b>  | <b>47.470.541</b>    | <b>5.111.662</b>      | <b>557.797.989</b> |

31. Dezember 2023

| Umlaufvermögen  | Bis zu 1 Jahr<br>US\$ | 1 - 5 Jahre<br>US\$ | Über 5 Jahre<br>US\$ | Unverzinslich<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|--------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 9.930.122             | 639.212.714         | 28.290.948           | 241.028               | 677.674.812        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 44.469.256            | –                   | –                    | –                     | 44.469.256         |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>54.399.378</b>     | <b>639.212.714</b>  | <b>28.290.948</b>    | <b>241.028</b>        | <b>722.144.068</b> |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>–</b>              | <b>–</b>            | <b>–</b>             | <b>–</b>              | <b>–</b>           |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>54.399.378</b>     | <b>639.212.714</b>  | <b>28.290.948</b>    | <b>241.028</b>        | <b>722.144.068</b> |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

## Strategic Income

## 31. Dezember 2024

| Umlaufvermögen  | Bis zu 1 Jahr<br>US\$ | 1 - 5 Jahre<br>US\$ | Über 5 Jahre<br>US\$ | Unverzinslich<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$    |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|----------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 87.694.535            | 562.601.555         | 3.892.503.890        | 56.497.686            | 4.599.297.666        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 155.822.200           | –                   | –                    | –                     | 155.822.200          |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>243.516.735</b>    | <b>562.601.555</b>  | <b>3.892.503.890</b> | <b>56.497.686</b>     | <b>4.755.119.866</b> |
| Kontenüberziehung   | 463                   | –                   | –                    | –                     | 463                  |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>463</b>            | <b>–</b>            | <b>–</b>             | <b>–</b>              | <b>463</b>           |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>243.516.272</b>    | <b>562.601.555</b>  | <b>3.892.503.890</b> | <b>56.497.686</b>     | <b>4.755.119.403</b> |

## 31. Dezember 2023

| Umlaufvermögen  | Bis zu 1 Jahr<br>US\$ | 1 - 5 Jahre<br>US\$ | Über 5 Jahre<br>US\$ | Unverzinslich<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$    |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|----------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 222.715.766           | 226.693.883         | 1.626.771.226        | 60.788.966            | 2.136.969.841        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 55.205.634            | –                   | –                    | –                     | 55.205.634           |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>277.921.400</b>    | <b>226.693.883</b>  | <b>1.626.771.226</b> | <b>60.788.966</b>     | <b>2.192.175.475</b> |
| Kontenüberziehung   | 377                   | –                   | –                    | –                     | 377                  |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>377</b>            | <b>–</b>            | <b>–</b>             | <b>–</b>              | <b>377</b>           |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>277.921.023</b>    | <b>226.693.883</b>  | <b>1.626.771.226</b> | <b>60.788.966</b>     | <b>2.192.175.098</b> |

## Sustainable Asia High Yield

## 31. Dezember 2024

| Umlaufvermögen  | Bis zu 1 Jahr<br>US\$ | 1 - 5 Jahre<br>US\$ | Über 5 Jahre<br>US\$ | Unverzinsliche<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|------------------------|-------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 1.164.122             | 14.988.221          | 13.235.077           | –                      | 29.387.420        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 2.032.201             | –                   | –                    | –                      | 2.032.201         |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>3.196.323</b>      | <b>14.988.221</b>   | <b>13.235.077</b>    | <b>–</b>               | <b>31.419.621</b> |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>–</b>              | <b>–</b>            | <b>–</b>             | <b>–</b>               | <b>–</b>          |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>3.196.323</b>      | <b>14.988.221</b>   | <b>13.235.077</b>    | <b>–</b>               | <b>31.419.621</b> |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Sustainable Asia High Yield (Fortsetzung)

31. Dezember 2023

| Umlaufvermögen  | Bis zu 1 Jahr<br>US\$ | 1 - 5 Jahre<br>US\$ | Über 5 Jahre<br>US\$ | Unverzinslich<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|-------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 2.041.966             | 13.296.029          | 11.531.216           | –                     | 26.869.211        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 1.163.077             | –                   | –                    | –                     | 1.163.077         |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>3.205.043</b>      | <b>13.296.029</b>   | <b>11.531.216</b>    | <b>–</b>              | <b>28.032.288</b> |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>–</b>              | <b>–</b>            | <b>–</b>             | <b>–</b>              | <b>–</b>          |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>3.205.043</b>      | <b>13.296.029</b>   | <b>11.531.216</b>    | <b>–</b>              | <b>28.032.288</b> |

Sustainable Emerging Market Debt- Hard Currency

31. Dezember 2024

| Umlaufvermögen  | Bis zu 1 Jahr<br>US\$ | 1 - 5 Jahre<br>US\$ | Über 5 Jahre<br>US\$ | Unverzinslich<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|--------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 13.000.000            | 53.095.460          | 516.043.270          | –                     | 582.138.730        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 7.048.460             | –                   | –                    | –                     | 7.048.460          |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>20.048.460</b>     | <b>53.095.460</b>   | <b>516.043.270</b>   | <b>–</b>              | <b>589.187.190</b> |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>–</b>              | <b>–</b>            | <b>–</b>             | <b>–</b>              | <b>–</b>           |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>20.048.460</b>     | <b>53.095.460</b>   | <b>516.043.270</b>   | <b>–</b>              | <b>589.187.190</b> |

31. Dezember 2023

| Umlaufvermögen  | Bis zu 1 Jahr<br>US\$ | 1 - 5 Jahre<br>US\$ | Über 5 Jahre<br>US\$ | Unverzinslich<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|-----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|--------------------|
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 1.961.557             | 28.611.823          | 385.228.828          | –                     | 415.802.208        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 7.042.532             | –                   | –                    | –                     | 7.042.532          |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>9.004.089</b>      | <b>28.611.823</b>   | <b>385.228.828</b>   | <b>–</b>              | <b>422.844.740</b> |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>–</b>              | <b>–</b>            | <b>–</b>             | <b>–</b>              | <b>–</b>           |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>9.004.089</b>      | <b>28.611.823</b>   | <b>385.228.828</b>   | <b>–</b>              | <b>422.844.740</b> |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Tactical Macro<sup>1</sup>

## 31. Dezember 2024

|   | Bis zu 1 Jahr     | 1 - 5 Jahre | Über 5 Jahre | Unverzinslich | Insgesamt         |
|---|-------------------|-------------|--------------|---------------|-------------------|
|   | US\$              | US\$        | US\$         | US\$          | US\$              |
| <b>Umlaufvermögen</b>   |                   |             |              |               |                   |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 33.319.914        | –           | –            | –             | 33.319.914        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 2.804.175         | –           | –            | –             | 2.804.175         |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>36.124.089</b> | <b>–</b>    | <b>–</b>     | <b>–</b>      | <b>36.124.089</b> |
| Kontenüberziehung   | 45.930            | –           | –            | –             | 45.930            |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>45.930</b>     | <b>–</b>    | <b>–</b>     | <b>–</b>      | <b>45.930</b>     |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>36.078.159</b> | <b>–</b>    | <b>–</b>     | <b>–</b>      | <b>36.078.159</b> |

## 31. Dezember 2023

|   | Bis zu 1 Jahr     | 1 - 5 Jahre | Über 5 Jahre | Unverzinslich | Insgesamt         |
|---|-------------------|-------------|--------------|---------------|-------------------|
|   | US\$              | US\$        | US\$         | US\$          | US\$              |
| <b>Umlaufvermögen</b>   |                   |             |              |               |                   |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 22.994.103        | –           | –            | –             | 22.994.103        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 3.554.300         | –           | –            | –             | 3.554.300         |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>26.548.403</b> | <b>–</b>    | <b>–</b>     | <b>–</b>      | <b>26.548.403</b> |
| Kontenüberziehung   | 68.223            | –           | –            | –             | 68.223            |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>68.223</b>     | <b>–</b>    | <b>–</b>     | <b>–</b>      | <b>68.223</b>     |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>26.480.180</b> | <b>–</b>    | <b>–</b>     | <b>–</b>      | <b>26.480.180</b> |

## Uncorrelated Strategies

## 31. Dezember 2024

|   | Bis zu 1 Jahr      | 1 - 5 Jahre       | Über 5 Jahre      | Unverzinslich     | Insgesamt          |
|---|--------------------|-------------------|-------------------|-------------------|--------------------|
|   | US\$               | US\$              | US\$              | US\$              | US\$               |
| <b>Umlaufvermögen</b>   |                    |                   |                   |                   |                    |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 337.034.530        | 32.746.881        | 12.600.260        | 17.084.333        | 399.466.004        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 148.249.077        | –                 | –                 | –                 | 148.249.077        |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>485.283.607</b> | <b>32.746.881</b> | <b>12.600.260</b> | <b>17.084.333</b> | <b>547.715.081</b> |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>–</b>           | <b>–</b>          | <b>–</b>          | <b>–</b>          | <b>–</b>           |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>485.283.607</b> | <b>32.746.881</b> | <b>12.600.260</b> | <b>17.084.333</b> | <b>547.715.081</b> |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

31. Dezember 2023

|   | Bis zu 1 Jahr      | 1 - 5 Jahre       | Über 5 Jahre      | Unverzinslich     | Insgesamt            |
|---|--------------------|-------------------|-------------------|-------------------|----------------------|
|   | US\$               | US\$              | US\$              | US\$              | US\$                 |
| <b>Umlaufvermögen</b>   |                    |                   |                   |                   |                      |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 726.121.264        | 97.774.544        | 42.920.336        | 78.510.108        | 945.326.252          |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 215.995.568        | –                 | –                 | –                 | 215.995.568          |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>942.116.832</b> | <b>97.774.544</b> | <b>42.920.336</b> | <b>78.510.108</b> | <b>1.161.321.820</b> |
| Kontenüberziehung   | 659                | –                 | –                 | –                 | 659                  |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>659</b>         | <b>–</b>          | <b>–</b>          | <b>–</b>          | <b>659</b>           |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>942.116.173</b> | <b>97.774.544</b> | <b>42.920.336</b> | <b>78.510.108</b> | <b>1.161.321.161</b> |

US Equity Premium

31. Dezember 2024

|   | Bis zu 1 Jahr      | 1 - 5 Jahre        | Über 5 Jahre | Unverzinslich | Insgesamt          |
|---|--------------------|--------------------|--------------|---------------|--------------------|
|   | US\$               | US\$               | US\$         | US\$          | US\$               |
| <b>Umlaufvermögen</b>   |                    |                    |              |               |                    |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 320.386.256        | 313.686.065        | –            | –             | 634.072.321        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 44.525.390         | –                  | –            | –             | 44.525.390         |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>364.911.646</b> | <b>313.686.065</b> | <b>–</b>     | <b>–</b>      | <b>678.597.711</b> |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>–</b>           | <b>–</b>           | <b>–</b>     | <b>–</b>      | <b>–</b>           |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>364.911.646</b> | <b>313.686.065</b> | <b>–</b>     | <b>–</b>      | <b>678.597.711</b> |

31. Dezember 2023

|   | Bis zu 1 Jahr      | 1 - 5 Jahre        | Über 5 Jahre | Unverzinslich | Insgesamt          |
|---|--------------------|--------------------|--------------|---------------|--------------------|
|   | US\$               | US\$               | US\$         | US\$          | US\$               |
| <b>Umlaufvermögen</b>   |                    |                    |              |               |                    |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | 344.736.832        | 318.620.304        | –            | –             | 663.357.136        |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 56.170.541         | –                  | –            | –             | 56.170.541         |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | <b>400.907.373</b> | <b>318.620.304</b> | <b>–</b>     | <b>–</b>      | <b>719.527.677</b> |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | <b>–</b>           | <b>–</b>           | <b>–</b>     | <b>–</b>      | <b>–</b>           |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | <b>400.907.373</b> | <b>318.620.304</b> | <b>–</b>     | <b>–</b>      | <b>719.527.677</b> |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

## US Long Short Equity

## 31. Dezember 2024

|   | Bis zu 1 Jahr | 1 - 5 Jahre | Über 5 Jahre | Unverzinslich | Insgesamt   |
|---|---------------|-------------|--------------|---------------|-------------|
|   | US\$          | US\$        | US\$         | US\$          | US\$        |
| <b>Umlaufvermögen</b>   |               |             |              |               |             |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | –             | 497.587     | –            | 195.297.807   | 195.795.394 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 26.581.969    | –           | –            | –             | 26.581.969  |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | 26.581.969    | 497.587     | –            | 195.297.807   | 222.377.363 |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | –             | –           | –            | –             | –           |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | 26.581.969    | 497.587     | –            | 195.297.807   | 222.377.363 |

## 31. Dezember 2023

|   | Bis zu 1 Jahr | 1 - 5 Jahre | Über 5 Jahre | Unverzinslich | Insgesamt   |
|---|---------------|-------------|--------------|---------------|-------------|
|   | US\$          | US\$        | US\$         | US\$          | US\$        |
| <b>Umlaufvermögen</b>   |               |             |              |               |             |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet  | –             | 1.381.526   | 6.776.840    | 170.117.450   | 178.275.816 |
| Barmittel und Barmitteläquivalente  | 4.926.902     | –           | –            | –             | 4.926.902   |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>   | 4.926.902     | 1.381.526   | 6.776.840    | 170.117.450   | 183.202.718 |
| <b>Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)</b>                 | –             | –           | –            | –             | –           |
| <b>Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen</b> | 4.926.902     | 1.381.526   | 6.776.840    | 170.117.450   | 183.202.718 |

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

## (d) Kredit-/Gegenparteirisiko

Das Kreditrisiko (oder Ausfallrisiko) ist das Risiko, dass ein Emittent oder eine Gegenpartei einer gegenüber dem Fonds eingegangenen Verbindlichkeit nicht nachkommen kann. Der Fonds hat zum Grundsatz, Finanzinstrumente mit unterschiedlichen, bonitätsmäßig einwandfreien Gegenparteien einzugehen. Deshalb erwartet der Fonds keine wesentlichen Kreditverluste aus seinen Finanzinstrumenten. Der Manager bewertet die Kreditqualität der Gegenparteien, die von dem Fonds genutzt werden. Diese Bewertung beinhaltet mindestens eine anfängliche und eine jährliche Kreditbewertung auf Grundlage der Finanzdaten und/oder Ratings Dritter. Gegenparteien, die für Devisenterminkontrakte und andere außerbörsliche Derivategeschäfte (OTC-Derivate) genutzt werden, unterliegen einer strengeren Überwachung, zu der auch detaillierte Kreditprüfungen mit Ratings Dritter und/oder Faktoren wie Kapitalausstattung, die Qualität der Vermögenswerte, Qualität der Verwaltung, Gewinne und Liquidität gehören. Der Manager verfolgt zudem die Nachrichten aus dem Finanzsektor, um einen Überblick über Trends in Sektoren und Ereignisse zu bekommen, die einen direkten Einfluss auf spezielle Gegenparteien haben können.

Das maximale Kreditrisiko der Gesellschaft (wobei der Wert von gehaltenen Sicherheiten oder anderen Wertpapieren unberücksichtigt bleibt) in dem Fall, dass Gegenparteien ihren Verpflichtungen zum 31. Dezember 2024 und zum 31. Dezember 2023 in Bezug auf jede Klasse erfasster finanzieller Vermögenswerte, mit Ausnahme von Derivaten, nicht nachkommen, ist der Buchwert dieser Vermögenswerte gemäß Angabe in der Bilanz.

**FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR**

**12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)**

**(d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)**

Transaktionen im Zusammenhang mit derivativen Finanzinstrumenten werden in der Regel mit Gegenparteien getätigt, mit denen das Portfolio Master Netting Agreements unterzeichnet hat. Master Netting Agreements sehen die Nettoabwicklung von Kontrakten mit derselben Gegenpartei bei einem Ausfall vor. Das mit derivativen finanziellen Vermögenswerten, die einer Master-Netting-Vereinbarung unterliegen, verbundene Kreditrisiko wird nur insoweit eliminiert, als dass gegenüber derselben Gegenpartei fällige finanzielle Verbindlichkeiten abgerechnet werden, nachdem die Vermögenswerte veräußert wurden. Das Risiko wird auch durch Sicherheiten gesteuert, auf die der Fonds bei einem Zahlungsausfall einer Gegenpartei ohne Rückgriff auf diese Gegenpartei sofortigen Zugriff hat.

Kassenbestände, die über in den Büchern von Brown Brothers Harriman & Co. („BBH“) geführte Konten gehalten werden, sind Verbindlichkeiten von BBH, während Kassenbestände, die über direkt in den Büchern einer Drittbank als Korrespondenzbank für Kassenbestände, einer Unterdepotbank oder eines Maklers geführte Konten gehalten werden (zusammen die „Vertreterkonten“), Verbindlichkeiten des Vertreters sind. Kassenbestände, die über Vertreterkonten gehalten werden, sind Verbindlichkeiten des Vertreters und begründen ein direktes Schuldner/Gläubiger-Verhältnis zwischen dem Vertreter und dem Fonds. Dementsprechend ist BBH dafür verantwortlich, bei der Verwaltung dieser Vertreterkonten, wenn sie den Vertreter ernannt hat (d. h. im Falle von Korrespondenzbanken für Kassenbestände und Unterdepotbanken), angemessene Sorgfalt walten zu lassen, haftet jedoch nicht für die Rückzahlung, wenn der Vertreter aufgrund eines Konkurses, einer Insolvenz oder aus anderen Gründen die Rückzahlung nicht leistet. Zum 31. Dezember 2024 lagen sämtliche als Tagesgelder gehaltenen Barmittel und Bankguthaben wie in Anmerkung 3 angegeben bei Drittinstituten. Barmittel und Barmitteläquivalente mit einem langfristigen Kreditrating von Investment Grade gemäß Standard & Poor’s (31. Dezember 2023: gleich). BBH hat ein langfristiges Kreditrating von A+ (31. Dezember 2023: A+) gemäß Fitch-Rating.

Die Verwahrstelle muss sicherstellen, dass die gesetzliche Trennung der von ihr verwahrten unbaren Vermögenswerte eingehalten wird, dass diese Vermögenswerte auf treuhänderischer Basis gehalten werden und dass geeignete interne Kontrollsysteme vorhanden sind, so dass in den Aufzeichnungen klar die Art und Höhe aller verwahrten Vermögenswerte identifiziert werden. Als Verwahrstelle muss Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited („BBHTS“) das Eigentum jedes Vermögenswertes und den Aufbewahrungsort der Eigentumstitel für jeden Vermögenswert sicherstellen.

Das zentrale Risiko für den Fonds bleibt das Kreditrisiko, d. h. dass der Manager einen Schuldtitel oder eine Anleihe eines bestimmten Emittenten erwirbt und sie sich nicht erwartungsgemäß entwickelt und entweder Zahlungen ausfallen oder ein erheblicher Rückgang des Sekundärmarktwerts eintritt.

Um dieses Risiko zu mindern, führt der Manager eine unabhängige Due-Diligence-Prüfung jedes Kreditnehmers durch und fokussiert sich auf stabile, leistungsfähige Anleihen mit soliden Erfolgsbilanzen über vorausgegangenen Konjunkturzyklen. Außerdem wird auch die Größe eines Emittenten berücksichtigt. Der Manager favorisiert weiterhin die größeren Emittenten auf dem Markt, die sich über ein Emissionsvolumen von mehr als 500 Mio. US\$ definieren. Hinter diesen Emittenten stehen breitere Konsortien, was die Liquidität auf dem Sekundärmarkt steigern kann. Der Manager filtert nicht nur kleinere Emittenten heraus, sondern schließt auch stark zyklische Branchen und Unternehmen mit begrenzter Ertragstransparenz aus seinem Anlageverfahren aus.

Wurde eine bestimmte Anlage getätigt, wird sie vom Manager überwacht. Es wird für jede Anlage fortlaufend ein Spektrum einschlägiger Daten überprüft, insbesondere maßgebliche Finanztreiber, Rohstoffpreise, Aktienkurse, aufsichtsrechtliche Entwicklungen, Finanzergebnisse, Pressemeldungen und Kommentare des Managements, um Hinweise auf eine Verschlechterung der Bonität zu erkennen.

Um dieses Risiko zusätzlich zu steuern, stellen die Direktoren sicher, dass der Manager die von den Direktoren festgelegten Richtlinien zu Anlagelimits und -einschränkungen einhält. Die Direktoren überwachen mit dem Manager auf jeder ihrer Sitzungen die Umsetzung und die Ergebnisse des Anlageverfahrens und sie überwachen ferner die Risikofaktoren für jedes Portfolio.

Bei den Wertpapieren, die BBH in Verwahrung hat, handelt es sich um Aktien, festverzinsliche Wertpapiere, Participatory Notes, ABS-Anleihen und REITs. Alle von BBH (als globale Unterdepotbank für und im Namen von BBHTS und zu Gunsten von deren jeweiligen Kunden) verwahrten Wertpapiere werden von den eigenen Vermögenswerten der BBH getrennt, ungeachtet dessen, ob sie im Tresor von BBH, auf separaten Konten in den Büchern ihrer Unterdepotbanken oder auf einem bei einer Wertpapiersammelbank (Central Securities Depository) geführten Konto gehalten werden. BBH führt für jeden Kunden in ihren Büchern sowie in den Büchern der Unterdepotbank auf dem lokalen Markt, wenn dies möglich ist, separate Konten. Als Verwahrstelle muss BBHTS auch sicherstellen, dass unbare Vermögenswerte auf treuhänderischer Basis über das Netzwerk globaler Unterdepotbanken der BBH gehalten werden.

Die Unterdepotbanken von BBH sind durch Verträge mit BBH und allgemein gemäß dem Gesetz verpflichtet, die Wertpapiere von Depotkunden getrennt vom allgemeinen Bankvermögen der Unterdepotbank zu verwahren.

BBH führt über ihre Network Management Group zu Beginn und danach auf laufender Basis Due-Diligence-Prüfungen bei den Unterdepotbanken in ihrem globalen Verwahrstellennetz durch. Diese Prüfungen beinhalten eine Beurteilung der Service-Standards, des Sachverstandes des Managements, der Marktinformationen, des Verwahrstellenbetriebs, der Berichts- und technologischen Kapazitäten der Unterdepotbank sowie Prüfungen in Bezug auf ihre Reputation und Bonität am Markt und ihr dauerhaftes Engagement im Bereich der Verwahrstellendienstleistungen.

Mit jeder Unterdepotbank werden ein Service Level Agreement sowie die üblichen vertraglichen Vereinbarungen getroffen und diese regelmäßig im Rahmen von Service Review Meetings, einschließlich Due-Diligence-Meetings vor Ort, überprüft.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

Die Risk and Credit Group von BBH führt regelmäßig Finanzanalysen bei allen Unterdepotbanken durch und konzentriert sich dabei unter anderem auf die Kapitalausstattung, die Qualität der Vermögenswerte, Gewinne, Liquidität und Kredit-Ratings als wesentliche Kennzahlen. Diese Überprüfungen sind Bestandteil der Routineprüfungen, die BBH im Hinblick auf die finanzielle Stärke und Bonität einer Unterdepotbank vornimmt.

Die Manager überwacht das Risiko für die Gesellschaft gemäß den Richtlinien für OGAW-Fonds und berichtet den Direktoren auf regelmäßiger Basis.

Der Fonds investiert in Schuldtitel, die ein Bonitätsrating einer renommierten Ratingagentur erhalten können. Die Bonitätsratings in den nachstehenden Tabellen werden als Prozentsatz der festverzinslichen Wertpapiere berechnet, wenn ein wesentlicher Anteil des betreffenden Portfolios als festverzinsliche Wertpapiere gehalten wird. Ein Schuldtitel wird als Investment-Grade-Titel betrachtet, wenn er ein Bonitätsrating von BBB- oder höher von Standard & Poor's und von Baa3 oder höher von Moody's hat. Per 31. Dezember 2024 und 31. Dezember 2023 stellten sich die Engagements nach Bonitätsratings wie folgt dar:

## Asia Responsible Transition Bond

| Anlagen:                                  | 31. Dezember 2024<br>US\$ | 31. Dezember 2023<br>US\$ |
|---|---------------------------|---------------------------|
| Unternehmensanleihen                      | 21.012.411                | 45.692.223                |
| Staatsanleihen                            | 5.093.501                 | 12.025.196                |
| Schatzwechsel                             | –                         | 2.496.736                 |
| <b>Derivate</b>                           | <b>(15.927)</b>           | <b>120.024</b>            |
| <b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b> | <b>1.834.346</b>          | <b>2.708.868</b>          |
| <b>Forderungen gegenüber Brokern</b>      | <b>299.921</b>            | <b>128.088</b>            |

## Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2024<br>% | 31. Dezember 2023<br>% |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade      | 70,58                  | 75,65                  |
| Ohne Investment Grade | 25,84                  | 21,04                  |
| Ohne Rating           | 3,58                   | 3,31                   |
| <b>Insgesamt</b>      | <b>100,00</b>          | <b>100,00</b>          |

## China Bond

| Anlagen:                                  | 31. Dezember 2024<br>CNY | 31. Dezember 2023<br>CNY |
|---|--------------------------|--------------------------|
| Einlagenzertifikate                       | –                        | 58.557.000               |
| Unternehmensanleihen                      | 69.415.652               | 290.154.114              |
| Staatsanleihen                            | 47.383.173               | 95.858.682               |
| <b>Derivate</b>                           | <b>165.980</b>           | <b>185.388</b>           |
| <b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b> | <b>7.556.799</b>         | <b>9.446.611</b>         |
| <b>Forderungen gegenüber Brokern</b>      | <b>113.148</b>           | <b>682.867</b>           |

## Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2024<br>% | 31. Dezember 2023<br>% |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade      | 56,91                  | 41,43                  |
| Ohne Investment Grade | 8,58                   | 5,73                   |
| Ohne Rating           | 34,51                  | 52,84                  |
| <b>Insgesamt</b>      | <b>100,00</b>          | <b>100,00</b>          |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

CLO Income

| Anlagen:  | 31. Dezember 2024<br>US\$ | 31. Dezember 2023<br>US\$ |
|---|---------------------------|---------------------------|
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) | 934.118.980               | 159.687.075               |
| Pensionsgeschäfte                               | 84.500.000                | –                         |
| Schatzwechsel                                   | 80.045.443                | 4.994.907                 |
| <b>Derivate</b>                                 | 20.405.072                | (176.734)                 |
| <b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b>       | 13.609.709                | 12.287.209                |
| <b>Forderungen gegenüber Brokern</b>            | 280.000                   | –                         |

Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2024<br>% | 31. Dezember 2023<br>% |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade      | 47,25                  | 3,03                   |
| Ohne Investment Grade | 52,75                  | 96,97                  |
| <b>Insgesamt</b>      | 100,00                 | 100,00                 |

Commodities

| Anlagen:                                  | 31. Dezember 2024<br>US\$ | 31. Dezember 2023<br>US\$ |
|---|---------------------------|---------------------------|
| Unternehmensanleihen                      | 85.264.336                | 77.031.796                |
| Schatzwechsel                             | 47.615.993                | 43.941.161                |
| <b>Derivate</b>                           | (1.288.042)               | 1.363.262                 |
| <b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b> | 22.706.391                | 33.206.631                |
| <b>Forderungen gegenüber Brokern</b>      | 1.280.000                 | 7.330.000                 |

Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2024<br>% | 31. Dezember 2023<br>% |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade      | 100,00                 | 100,00                 |
| <b>Insgesamt</b>      | 100,00                 | 100,00                 |

Corporate Hybrid Bond

| Anlagen:                                  | 31. Dezember 2024<br>EUR | 31. Dezember 2023<br>EUR |
|---|--------------------------|--------------------------|
| Unternehmensanleihen                      | 2.167.985.323            | 1.743.583.625            |
| Pensionsgeschäfte                         | 14.002.897               | –                        |
| <b>Derivate</b>                           | (8.481.885)              | 4.369.046                |
| <b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b> | 112.576.339              | 79.423.824               |

Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2024<br>% | 31. Dezember 2023<br>% |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade      | 51,87                  | 52,83                  |
| Ohne Investment Grade | 48,13                  | 47,17                  |
| <b>Insgesamt</b>      | 100,00                 | 100,00                 |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

Developed Market FMP – 2027<sup>1</sup>

| Anlagen:                                  | 31. Dezember 2024<br>US\$ | 31. Dezember 2023<br>US\$ |
|---|---------------------------|---------------------------|
| Unternehmensanleihen                      | 125.679.450               | 135.777.186               |
| <b>Derivate</b>                           | (68.828)                  | 39.476                    |
| <b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b> | 563.777                   | 503.437                   |
| <b>Kreditratings der Schuldtitel</b>      |                           |                           |
| Portfolio nach Rating                     | 31. Dezember 2024<br>%    | 31. Dezember 2023<br>%    |
| Investment Grade                          | 79,82                     | 78,86                     |
| Ohne Investment Grade                     | 20,18                     | 21,14                     |
| <b>Insgesamt</b>                          | 100,00                    | 100,00                    |

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

## EMD Corporate – Social and Environmental Transition

| Anlagen:                                  | 31. Dezember 2024<br>US\$ | 31. Dezember 2023<br>US\$ |
|---|---------------------------|---------------------------|
| Unternehmensanleihen                      | 105.120.488               | 83.464.415                |
| Staatsanleihen                            | 6.781.268                 | 7.168.384                 |
| <b>Derivate</b>                           | (1.998.513)               | 1.461.588                 |
| <b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b> | 1.999.150                 | 3.976.271                 |
| <b>Forderungen gegenüber Brokern</b>      | 108.497                   | 425.554                   |
| <b>Kreditratings der Schuldtitel</b>      |                           |                           |
| Portfolio nach Rating                     | 31. Dezember 2024<br>%    | 31. Dezember 2023<br>%    |
| Investment Grade                          | 45,16                     | 51,32                     |
| Ohne Investment Grade                     | 53,56                     | 46,60                     |
| Ohne Rating                               | 1,28                      | 2,08                      |
| <b>Insgesamt</b>                          | 100,00                    | 100,00                    |

## Emerging Market Debt - Hard Currency

| Anlagen:                                  | 31. Dezember 2024<br>US\$ | 31. Dezember 2023<br>US\$ |
|---|---------------------------|---------------------------|
| Unternehmensanleihen                      | 741.805.425               | 732.442.764               |
| Staatsanleihen                            | 1.813.828.146             | 1.794.182.602             |
| Pensionsgeschäfte                         | 60.000.000                | –                         |
| <b>Derivate</b>                           | (5.919.357)               | 28.532.535                |
| <b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b> | 39.879.035                | 2.306.275                 |
| <b>Kontenüberziehung</b>                  | –                         | (31.716)                  |
| <b>Forderungen gegenüber Brokern</b>      | 5.396.830                 | 22.175.962                |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2024<br>% | 31. Dezember 2023<br>% |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade      | 34,61                  | 33,68                  |
| Ohne Investment Grade | 64,91                  | 65,67                  |
| Ohne Rating           | 0,48                   | 0,65                   |
| <b>Insgesamt</b>      | <b>100,00</b>          | <b>100,00</b>          |

Emerging Market Debt - Local Currency

| Anlagen:                                   | 31. Dezember 2024<br>US\$ | 31. Dezember 2023<br>US\$ |
|--|---------------------------|---------------------------|
| Unternehmensanleihen                       | 55.840.021                | 41.825.600                |
| Staatsanleihen                             | 974.722.981               | 1.124.421.834             |
| Schatzwechsel                              | –                         | 33.341.150                |
| <b>Derivate</b>                            | <b>(14.834.544)</b>       | <b>933.685</b>            |
| <b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b>  | <b>12.909.847</b>         | <b>34.899.630</b>         |
| <b>Kontenüberziehung</b>                   | <b>(2.396)</b>            | <b>–</b>                  |
| <b>Forderungen gegenüber Brokern</b>       | <b>22.598.277</b>         | <b>16.010.321</b>         |
| <b>Verbindlichkeiten gegenüber Maklern</b> | <b>(1.230.000)</b>        | <b>(2.230.000)</b>        |

Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2024<br>% | 31. Dezember 2023<br>% |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade      | 80,32                  | 83,77                  |
| Ohne Investment Grade | 17,70                  | 14,66                  |
| Ohne Rating           | 1,98                   | 1,57                   |
| <b>Insgesamt</b>      | <b>100,00</b>          | <b>100,00</b>          |

Emerging Market Debt Blend

| Anlagen:                                   | 31. Dezember 2024<br>US\$ | 31. Dezember 2023<br>US\$ |
|--|---------------------------|---------------------------|
| Unternehmensanleihen                       | 152.243.177               | 148.077.852               |
| Staatsanleihen                             | 304.516.261               | 330.568.106               |
| Schatzwechsel                              | –                         | 1.006.392                 |
| <b>Derivate</b>                            | <b>(7.735.223)</b>        | <b>1.629.543</b>          |
| <b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b>  | <b>45.252.303</b>         | <b>15.095.815</b>         |
| <b>Forderungen gegenüber Brokern</b>       | <b>8.615.226</b>          | <b>7.902.696</b>          |
| <b>Verbindlichkeiten gegenüber Maklern</b> | <b>(620.000)</b>          | <b>(390.000)</b>          |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

## Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

## Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2024<br>% | 31. Dezember 2023<br>% |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade      | 58,24                  | 63,64                  |
| Ohne Investment Grade | 40,19                  | 34,73                  |
| Ohne Rating           | 1,57                   | 1,63                   |
| <b>Insgesamt</b>      | <b>100,00</b>          | <b>100,00</b>          |

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend

| Anlagen:                                  | 31. Dezember 2024<br>US\$ | 31. Dezember 2023<br>US\$ |
|---|---------------------------|---------------------------|
| Unternehmensanleihen                      | 10.355.204                | 9.239.606                 |
| Staatsanleihen                            | 41.785.641                | 48.266.565                |
| Schatzwechsel                             | –                         | 821.151                   |
| <b>Derivate</b>                           | <b>(826.964)</b>          | <b>2.496.697</b>          |
| <b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b> | <b>4.462.142</b>          | <b>2.754.078</b>          |
| <b>Forderungen gegenüber Brokern</b>      | <b>940.360</b>            | <b>679.691</b>            |

## Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2024<br>% | 31. Dezember 2023<br>% |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade      | 100,00                 | 99,70                  |
| Ohne Rating           | –                      | 0,30                   |
| <b>Insgesamt</b>      | <b>100,00</b>          | <b>100,00</b>          |

## Euro Bond

| Anlagen:  | 31. Dezember 2024<br>EUR | 31. Dezember 2023<br>EUR |
|---|--------------------------|--------------------------|
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) | –                        | 4.100                    |
| Unternehmensanleihen                            | 33.145.394               | 4.770.071                |
| Staatsanleihen                                  | 34.603.245               | 5.399.389                |
| <b>Derivate</b>                                 | <b>(329.730)</b>         | <b>(35.197)</b>          |
| <b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b>       | <b>410.347</b>           | <b>127.676</b>           |
| <b>Forderungen gegenüber Brokern</b>            | <b>830.152</b>           | <b>217.984</b>           |

## Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2024<br>% | 31. Dezember 2023<br>% |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade      | 85,97                  | 89,48                  |
| Ohne Investment Grade | 14,03                  | 10,52                  |
| <b>Insgesamt</b>      | <b>100,00</b>          | <b>100,00</b>          |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

Euro Bond Absolute Return

| Anlagen:  | 31. Dezember 2024<br>EUR | 31. Dezember 2023<br>EUR |
|---|--------------------------|--------------------------|
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) | 3.996.647                | 158.727                  |
| Unternehmensanleihen                            | 41.216.156               | 18.558.164               |
| Staatsanleihen                                  | 36.582.154               | 14.456.150               |
| <b>Derivate</b>                                 | 1.905.973                | (1.402.468)              |
| <b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b>       | 1.875.873                | 460.317                  |
| <b>Kontenüberziehung</b>                        | (2.588)                  | (412.247)                |
| <b>Forderungen gegenüber Brokern</b>            | 649.932                  | 1.822.858                |

Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2024<br>% | 31. Dezember 2023<br>% |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade      | 86,42                  | 87,19                  |
| Ohne Investment Grade | 13,58                  | 12,81                  |
| <b>Insgesamt</b>      | 100,00                 | 100,00                 |

European High Yield Bond

| Anlagen:  | 31. Dezember 2024<br>EUR | 31. Dezember 2023<br>EUR |
|---|--------------------------|--------------------------|
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) | 4.796.698                | 2.425.341                |
| Unternehmensanleihen                            | 529.414.084              | 384.433.736              |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen            | –                        | 114.727                  |
| <b>Derivate</b>                                 | 590.901                  | (620.006)                |
| <b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b>       | 17.956.780               | 16.624.528               |

Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2024<br>% | 31. Dezember 2023<br>% |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade      | 2,66                   | 4,64                   |
| Ohne Investment Grade | 97,34                  | 95,36                  |
| <b>Insgesamt</b>      | 100,00                 | 100,00                 |

Event Driven

| Anlagen:                                  | 31. Dezember 2024<br>US\$ | 31. Dezember 2023<br>US\$ |
|---|---------------------------|---------------------------|
| Unternehmensanleihen                      | 195.788.600               | –                         |
| Schatzwechsel                             | 81.352.423                | 115.039.719               |
| <b>Derivate</b>                           | (10.359.467)              | 4.862.107                 |
| <b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b> | 24.610.182                | 13.500.176                |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

## Event Driven (Fortsetzung)

## Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2024<br>% | 31. Dezember 2023<br>% |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade      | 100,00                 | 100,00                 |
| <b>Insgesamt</b>      | <b>100,00</b>          | <b>100,00</b>          |

## Global Bond

| Anlagen:  | 31. Dezember 2024<br>US\$ | 31. Dezember 2023<br>US\$ |
|---|---------------------------|---------------------------|
| Agency Bonds                                    | 882.160                   | 1.146.538                 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) | 13.298.144                | 10.864.506                |
| Unternehmensanleihen                            | 31.448.688                | 28.855.602                |
| Staatsanleihen                                  | 32.141.381                | 42.481.574                |
| Mortgage-Backed Securities                      | 18.149.436                | 22.645.649                |
| Kommunalanleihen                                | 1.123.978                 | 1.278.776                 |
| <b>Derivate</b>                                 | <b>(148.607)</b>          | <b>12.036</b>             |
| <b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b>       | <b>4.741.796</b>          | <b>1.162.072</b>          |
| <b>Forderungen gegenüber Brokern</b>            | <b>345.486</b>            | <b>802.148</b>            |

## Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2024<br>% | 31. Dezember 2023<br>% |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade      | 99,43                  | 75,01                  |
| Ohne Investment Grade | 0,57                   | 0,68                   |
| Ohne Rating           | –                      | 24,31                  |
| <b>Insgesamt</b>      | <b>100,00</b>          | <b>100,00</b>          |

## Global Diversified Income FMP – 2024\*

| Anlagen:                                  | 31. Dezember 2024<br>US\$ | 31. Dezember 2023<br>US\$ |
|---|---------------------------|---------------------------|
| Unternehmensanleihen                      | –                         | 123.463.985               |
| Staatsanleihen                            | –                         | 1.727.993                 |
| Schatzwechsel                             | –                         | 18.765.889                |
| <b>Derivate</b>                           | <b>–</b>                  | <b>281.732</b>            |
| <b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b> | <b>48.338</b>             | <b>11.026.949</b>         |
| <b>Kontenüberziehung</b>                  | <b>–</b>                  | <b>(13)</b>               |

## Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2024<br>% | 31. Dezember 2023<br>% |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade      | –                      | 84,08                  |
| Ohne Investment Grade | –                      | 15,92                  |
| <b>Insgesamt</b>      | <b>–</b>               | <b>100,00</b>          |

\* Das Portfolio wurde am 28. Juni 2024 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

Global Flexible Credit Income

| Anlagen:  | 31. Dezember 2024<br>US\$ | 31. Dezember 2023<br>US\$ |
|---|---------------------------|---------------------------|
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) | 65.219.905                | 23.118.219                |
| Unternehmensanleihen                            | 318.686.087               | 296.273.462               |
| Staatsanleihen                                  | 9.614.540                 | 15.379.748                |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen            | 37.505.823                | 15.105.874                |
| <b>Derivate</b>                                 | (2.840.499)               | 3.511.941                 |
| <b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b>       | 6.639.688                 | 25.482.094                |
| <b>Forderungen gegenüber Brokern</b>            | 3.049.931                 | 3.225.584                 |
| <b>Verbindlichkeiten gegenüber Maklern</b>      | –                         | (200.000)                 |

Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2024<br>% | 31. Dezember 2023<br>% |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade      | 25,12                  | 26,71                  |
| Ohne Investment Grade | 73,15                  | 72,28                  |
| Ohne Rating           | 1,73                   | 1,01                   |
| <b>Insgesamt</b>      | 100,00                 | 100,00                 |

Global High Yield Engagement

| Anlagen:                                  | 31. Dezember 2024<br>US\$ | 31. Dezember 2023<br>US\$ |
|---|---------------------------|---------------------------|
| Unternehmensanleihen                      | 584.788.441               | 532.499.481               |
| Pensionsgeschäfte                         | 15.500.000                | –                         |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen      | 6.832.101                 | 4.933                     |
| <b>Derivate</b>                           | (1.939.448)               | 5.197.440                 |
| <b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b> | 6.987.154                 | 10.709.205                |
| <b>Forderungen gegenüber Brokern</b>      | 187.302                   | –                         |

Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2024<br>% | 31. Dezember 2023<br>% |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade      | 4,25                   | 2,38                   |
| Ohne Investment Grade | 95,61                  | 97,18                  |
| Ohne Rating           | 0,14                   | 0,44                   |
| <b>Insgesamt</b>      | 100,00                 | 100,00                 |

Global Investment Grade Credit

| Anlagen:                                  | 31. Dezember 2024<br>US\$ | 31. Dezember 2023<br>US\$ |
|---|---------------------------|---------------------------|
| Unternehmensanleihen                      | 172.176.706               | 81.376.321                |
| Staatsanleihen                            | –                         | 2.082.454                 |
| <b>Derivate</b>                           | 164.555                   | (1.106.335)               |
| <b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b> | 5.007.265                 | 3.401.463                 |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

## Global Investment Grade Credit (Fortsetzung)

## Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2024<br>% | 31. Dezember 2023<br>% |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade      | 97,27                  | 98,32                  |
| Ohne Investment Grade | 2,73                   | 1,68                   |
| <b>Insgesamt</b>      | <b>100,00</b>          | <b>100,00</b>          |

## Global Opportunistic Bond

| Anlagen:  | 31. Dezember 2024<br>US\$ | 31. Dezember 2023<br>US\$ |
|---|---------------------------|---------------------------|
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) | 354.846                   | 1.817.743                 |
| Unternehmensanleihen                            | 26.885.560                | 27.412.055                |
| Staatsanleihen                                  | 20.058.262                | 21.133.383                |
| Mortgage-Backed Securities                      | 11.517.944                | 14.565.802                |
| <b>Derivate</b>                                 | <b>2.396.040</b>          | <b>(2.049.562)</b>        |
| <b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b>       | <b>5.289.493</b>          | <b>1.529.454</b>          |
| <b>Forderungen gegenüber Brokern</b>            | <b>1.735.251</b>          | <b>1.153.721</b>          |

## Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2024<br>% | 31. Dezember 2023<br>% |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade      | 71,49                  | 52,33                  |
| Ohne Investment Grade | 28,26                  | 24,77                  |
| Ohne Rating           | 0,25                   | 22,90                  |
| <b>Insgesamt</b>      | <b>100,00</b>          | <b>100,00</b>          |

## High Yield Bond

| Anlagen:  | 31. Dezember 2024<br>US\$ | 31. Dezember 2023<br>US\$ |
|---|---------------------------|---------------------------|
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) | 29.468.224                | 10.897.982                |
| Unternehmensanleihen                            | 1.753.492.450             | 1.999.177.351             |
| Staatsanleihen                                  | –                         | 36.225.768                |
| Pensionsgeschäfte                               | 66.000.000                | –                         |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen            | 65.626.148                | 43.084.058                |
| <b>Derivate</b>                                 | <b>(40.792.940)</b>       | <b>25.265.889</b>         |
| <b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b>       | <b>11.279.907</b>         | <b>73.617.932</b>         |

## Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2024<br>% | 31. Dezember 2023<br>% |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade      | 4,99                   | 6,90                   |
| Ohne Investment Grade | 94,68                  | 92,07                  |
| Ohne Rating           | 0,33                   | 1,03                   |
| <b>Insgesamt</b>      | <b>100,00</b>          | <b>100,00</b>          |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

Macro Opportunities FX\*

| Anlagen:                                  | 31. Dezember 2024<br>EUR | 31. Dezember 2023<br>EUR |
|---|--------------------------|--------------------------|
| Staatsanleihen                            | –                        | 347.166                  |
| Schatzwechsel                             | –                        | 2.407.376                |
| <b>Derivate</b>                           | –                        | 13.600                   |
| <b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b> | 35.694                   | 126.875                  |
| <b>Kreditratings der Schuldtitel</b>      |                          |                          |
| Portfolio nach Rating                     | 31. Dezember 2024<br>%   | 31. Dezember 2023<br>%   |
| Investment Grade                          | –                        | 100,00                   |
| <b>Insgesamt</b>                          | –                        | 100,00                   |

\* Das Portfolio wurde am 8. Februar 2024 aufgelöst.

Short Duration Emerging Market Debt

| Anlagen:                                   | 31. Dezember 2024<br>US\$ | 31. Dezember 2023<br>US\$ |
|--|---------------------------|---------------------------|
| Unternehmensanleihen                       | 2.430.571.401             | 2.406.487.373             |
| Staatsanleihen                             | 1.320.118.061             | 1.307.631.941             |
| Pensionsgeschäfte                          | 9.000.000                 | –                         |
| Schatzwechsel                              | –                         | 53.894.704                |
| <b>Derivate</b>                            | (59.738.370)              | 55.420.371                |
| <b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b>  | 21.417.061                | 14.257.955                |
| <b>Forderungen gegenüber Brokern</b>       | –                         | 5.350.000                 |
| <b>Verbindlichkeiten gegenüber Maklern</b> | (2.100.000)               | –                         |
| <b>Kreditratings der Schuldtitel</b>       |                           |                           |
| Portfolio nach Rating                      | 31. Dezember 2024<br>%    | 31. Dezember 2023<br>%    |
| Investment Grade                           | 55,69                     | 54,66                     |
| Ohne Investment Grade                      | 44,30                     | 43,56                     |
| Ohne Rating                                | 0,01                      | 1,78                      |
| <b>Insgesamt</b>                           | 100,00                    | 100,00                    |

Short Duration Euro Bond

| Anlagen:  | 31. Dezember 2024<br>EUR | 31. Dezember 2023<br>EUR |
|---|--------------------------|--------------------------|
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) | 276.388.490              | 90.687.160               |
| Unternehmensanleihen                            | 1.372.639.876            | 789.167.617              |
| Staatsanleihen                                  | 93.624.597               | 75.386.047               |
| Schatzwechsel                                   | –                        | 8.960.964                |
| <b>Derivate</b>                                 | (905.608)                | (6.740.350)              |
| <b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b>       | 79.541.949               | 11.222.572               |
| <b>Forderungen gegenüber Brokern</b>            | 6.372.371                | 11.144.095               |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

## Short Duration Euro Bond (Fortsetzung)

## Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2024<br>% | 31. Dezember 2023<br>% |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade      | 83,21                  | 91,38                  |
| Ohne Investment Grade | 16,44                  | 7,69                   |
| Ohne Rating           | 0,35                   | 0,93                   |
| <b>Insgesamt</b>      | <b>100,00</b>          | <b>100,00</b>          |

## Short Duration High Yield Engagement

| Anlagen:                                  | 31. Dezember 2024<br>US\$ | 31. Dezember 2023<br>US\$ |
|---|---------------------------|---------------------------|
| Unternehmensanleihen                      | 490.955.600               | 664.013.737               |
| Pensionsgeschäfte                         | 16.000.000                | –                         |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen      | 42.984.223                | 13.420.047                |
| <b>Derivate</b>                           | <b>(16.658.634)</b>       | <b>12.140.835</b>         |
| <b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b> | <b>2.746.504</b>          | <b>44.469.256</b>         |

## Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2024<br>% | 31. Dezember 2023<br>% |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade      | 1,09                   | 3,73                   |
| Ohne Investment Grade | 98,91                  | 95,93                  |
| Ohne Rating           | –                      | 0,34                   |
| <b>Insgesamt</b>      | <b>100,00</b>          | <b>100,00</b>          |

## Strategic Income

| Anlagen:  | 31. Dezember 2024<br>US\$ | 31. Dezember 2023<br>US\$ |
|---|---------------------------|---------------------------|
| Agency Bonds                                    | 739.410                   | 781.434                   |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) | 1.185.508.405             | 211.031.917               |
| Unternehmensanleihen                            | 1.159.321.497             | 535.844.310               |
| Staatsanleihen                                  | 317.221.334               | 175.669.880               |
| Mortgage-Backed Securities                      | 1.530.842.706             | 918.338.562               |
| Kommunalanleihen                                | 12.931.828                | 12.918.823                |
| Pensionsgeschäfte                               | 82.500.000                | –                         |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen            | 253.734.800               | 429.819                   |
| Schatzwechsel                                   | –                         | 221.166.130               |
| <b>Derivate</b>                                 | <b>(32.937.754)</b>       | <b>930.018</b>            |
| <b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b>       | <b>155.822.200</b>        | <b>55.205.634</b>         |
| <b>Kontenüberziehung</b>                        | <b>(463)</b>              | <b>(377)</b>              |
| <b>Forderungen gegenüber Brokern</b>            | <b>6.262.842</b>          | <b>22.631.176</b>         |
| <b>Verbindlichkeiten gegenüber Maklern</b>      | <b>–</b>                  | <b>(520.000)</b>          |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

Strategic Income (Fortsetzung)

Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2024<br>% | 31. Dezember 2023<br>% |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade      | 70,31                  | 36,88                  |
| Ohne Investment Grade | 28,45                  | 16,69                  |
| Ohne Rating           | 1,24                   | 46,43                  |
| <b>Insgesamt</b>      | <b>100,00</b>          | <b>100,00</b>          |

Sustainable Asia High Yield

| Anlagen:                                  | 31. Dezember 2024<br>US\$ | 31. Dezember 2023<br>US\$ |
|---|---------------------------|---------------------------|
| Unternehmensanleihen                      | 25.362.503                | 24.364.117                |
| Staatsanleihen                            | 4.024.917                 | 2.505.094                 |
| <b>Derivate</b>                           | <b>(14.055)</b>           | <b>(17.944)</b>           |
| <b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b> | <b>2.032.201</b>          | <b>1.163.077</b>          |
| <b>Forderungen gegenüber Brokern</b>      | <b>90.851</b>             | <b>108.311</b>            |

Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2024<br>% | 31. Dezember 2023<br>% |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade      | 5,37                   | 18,00                  |
| Ohne Investment Grade | 83,53                  | 76,61                  |
| Ohne Rating           | 11,10                  | 5,39                   |
| <b>Insgesamt</b>      | <b>100,00</b>          | <b>100,00</b>          |

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency

| Anlagen:                                  | 31. Dezember 2024<br>US\$ | 31. Dezember 2023<br>US\$ |
|---|---------------------------|---------------------------|
| Unternehmensanleihen                      | 62.183.538                | 28.120.429                |
| Staatsanleihen                            | 506.955.192               | 387.681.779               |
| Pensionsgeschäfte                         | 13.000.000                | –                         |
| <b>Derivate</b>                           | <b>(6.885.018)</b>        | <b>10.665.593</b>         |
| <b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b> | <b>7.048.460</b>          | <b>7.042.532</b>          |
| <b>Forderungen gegenüber Brokern</b>      | <b>6.404.490</b>          | <b>4.811.634</b>          |

Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2024<br>% | 31. Dezember 2023<br>% |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade      | 38,69                  | 37,18                  |
| Ohne Investment Grade | 61,31                  | 59,56                  |
| Ohne Rating           | –                      | 3,26                   |
| <b>Insgesamt</b>      | <b>100,00</b>          | <b>100,00</b>          |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

Tactical Macro<sup>1</sup>

| Anlagen:                                  | 31. Dezember 2024<br>US\$ | 31. Dezember 2023<br>US\$ |
|---|---------------------------|---------------------------|
| Schatzwechsel                             | 33.319.914                | 22.994.103                |
| <b>Derivate</b>                           | (247.253)                 | 173.202                   |
| <b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b> | 2.804.175                 | 3.554.300                 |
| <b>Kontenüberziehung</b>                  | (45.930)                  | (68.223)                  |
| <b>Forderungen gegenüber Brokern</b>      | 164.282                   | 526.958                   |

## Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2024<br>% | 31. Dezember 2023<br>% |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade      | 100,00                 | 100,00                 |
| <b>Insgesamt</b>      | 100,00                 | 100,00                 |

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

## Uncorrelated Strategies

| Anlagen:                                   | 31. Dezember 2024<br>US\$ | 31. Dezember 2023<br>US\$ |
|--|---------------------------|---------------------------|
| Unternehmensanleihen                       | 63.149.917                | 120.618.827               |
| Staatsanleihen                             | 10.311.805                | 38.964.571                |
| Schatzwechsel                              | 308.758.915               | 707.195.701               |
| <b>Derivate</b>                            | 25.948.867                | 30.977.706                |
| <b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b>  | 148.249.077               | 215.995.568               |
| <b>Kontenüberziehung</b>                   | –                         | (659)                     |
| <b>Forderungen gegenüber Brokern</b>       | 240.481.867               | 456.802.391               |
| <b>Verbindlichkeiten gegenüber Maklern</b> | (3.308.087)               | –                         |

## Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2024<br>% | 31. Dezember 2023<br>% |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade      | 80,96                  | 81,99                  |
| Ohne Investment Grade | 3,30                   | 5,87                   |
| Ohne Rating           | 15,74                  | 12,14                  |
| <b>Insgesamt</b>      | 100,00                 | 100,00                 |

## US Equity Premium

| Anlagen:                                  | 31. Dezember 2024<br>US\$ | 31. Dezember 2023<br>US\$ |
|---|---------------------------|---------------------------|
| Staatsanleihen                            | 634.072.321               | 663.357.136               |
| <b>Derivate</b>                           | (21.448.063)              | 6.338.906                 |
| <b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b> | 44.525.390                | 56.170.541                |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

US Equity Premium (Fortsetzung)

Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2024<br>% | 31. Dezember 2023<br>% |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade      | 100,00                 | 100,00                 |
| <b>Insgesamt</b>      | <b>100,00</b>          | <b>100,00</b>          |

US Long Short Equity

| Anlagen:                                  | 31. Dezember 2024<br>US\$ | 31. Dezember 2023<br>US\$ |
|---|---------------------------|---------------------------|
| Unternehmensanleihen                      | –                         | 7.670.535                 |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen      | 497.587                   | 487.831                   |
| <b>Derivate</b>                           | <b>(2.682.650)</b>        | <b>(4.829.968)</b>        |
| <b>Barmittel und Barmitteläquivalente</b> | <b>26.581.969</b>         | <b>4.926.902</b>          |
| <b>Forderungen gegenüber Brokern</b>      | <b>6.455.750</b>          | <b>18.176.471</b>         |

Kreditratings der Schuldtitel

| Portfolio nach Rating | 31. Dezember 2024<br>% | 31. Dezember 2023<br>% |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| Investment Grade      | –                      | 87,43                  |
| Ohne Investment Grade | –                      | 6,59                   |
| Ohne Rating           | 100,00                 | 5,98                   |
| <b>Insgesamt</b>      | <b>100,00</b>          | <b>100,00</b>          |

(e) Liquiditätsrisiko

Die größten Liquiditätsrisiken des Fonds bestehen darin, die Aufträge von Anteilhabern zur Rücknahme zu erfüllen. Für den Fonds können täglich Barrücknahmen von rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen anfallen. Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile sind auf Verlangen nach Wahl des Inhabers auf Basis des Nettoinventarwerts je Anteil des Portfolio zum Zeitpunkt der Rücknahme zurückzunehmen. Dieses Risiko wird vom Fonds gemildert, indem er vorwiegend in Wertpapiere investiert, die an den anerkannten Märkten in OECD-Mitgliedstaaten und anderen Ländern notiert sind oder gehandelt werden. Dadurch bestehen die Vermögenswerte aus realisierbaren Wertpapieren, die jederzeit verkauft werden können, ausgenommen Investments, die in Stufe 3 der Zeitwerthierarchie eingestuft wurden, wie in Anmerkung 12 (f) angegeben. Des Weiteren begrenzen Sicherheitenvereinbarungen das Ausmaß, in dem Verbindlichkeiten an den Fonds ausgedehnt werden können. Darüber hinaus steht dem Fonds, wie in Anmerkung 19 dargestellt, eine zugesagte Liquiditätsfazilität zur Verfügung.

Finanzielle Verbindlichkeiten

Die Fälligkeitsgruppierung basiert auf der Restlaufzeit ab dem Ende des Berichtszeitraums bis zum vertraglichen Fälligkeitsdatum. Kann die Gegenpartei den Zahlungszeitpunkt auswählen, wird die Verbindlichkeit dem frühestmöglichen Zeitpunkt zugeordnet, zu dem der Fonds zur Zahlung aufgefordert werden kann.

Zum 31. Dezember 2024 und zum 31. Dezember 2023 waren alle Verbindlichkeiten innerhalb eines Monats zahlbar. Zu den Fälligkeiten der derivativen finanziellen Verbindlichkeiten sehen Sie bitte die Aufstellung des Wertpapierbestands. Andere Verbindlichkeiten als derivative finanzielle Verbindlichkeiten sind innerhalb eines Monats fällig.

(f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen

FRS 102 Section 11.27 zum „Zeitwert: Offenlegung“ erfordert die Offenlegung in Bezug auf die Zeitwerthierarchie, in der Zeitwertbewertungen für Aktiva und Passiva kategorisiert sind. Die Offenlegungen basieren auf einer Zeitwerthierarchie mit drei Stufen für die Eingangswerte, die zur Bewertung des Zeitwerts in Bewertungstechniken verwendet werden.

**FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR****12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)****(f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)**

Der Fonds legt der Bewertung nach dem beizulegenden Zeitwert eine Zeitwerthierarchie zu Grunde, die die Bedeutung der zur Bewertung herangezogenen Parameter berücksichtigt. Die drei Stufen der Zeitwerthierarchie gemäß FRS 102 werden nachstehend beschrieben:

Stufe 1 – Unangepasste, auf aktiven Märkten notierte Preise, die zum Bewertungszeitpunkt für identische, unbeschränkte Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten verfügbar sind.

Stufe 2 – Bewertungsparameter, die für den Vermögenswert oder die Verbindlichkeit entweder direkt (d. h. als Preise) oder indirekt (d. h. abgeleitet aus Preisen) beobachtbar sind und die nicht der Stufe 1 angehören.

Stufe 3 – Bewertungsparameter für den Vermögenswert oder die Verbindlichkeit, die nicht auf beobachtbaren Marktdaten basieren (d. h. nicht beobachtbare Parameter). Nicht beobachtbare Preisparameter werden bei Anlagen und in Situationen herangezogen, bei denen keine oder nur eine geringe Marktaktivität für das Instrument vorhanden ist. Die zur Ermittlung des beizulegenden Zeitwerts herangezogenen Parameter erfordern ein hohes Maß an Verwaltung, Beurteilung und Schätzung. Da für diese Wertpapiere keine beobachtbaren Preise verfügbar sind, hätten die Portfolios gegebenenfalls Bewertungstechniken angewandt, um dem beizulegenden Zeitwert zu ermitteln.

Die Stufe in der Zeitwerthierarchie, der die Zeitwertbewertung in ihrer Gesamtheit zugeordnet wird, wird anhand des niedrigsten Bewertungsparameters festgelegt, der für die Zeitwertbewertung in ihrer Gesamtheit maßgeblich ist. Zu diesem Zweck wird die Maßgeblichkeit eines Parameters anhand der Zeitwertbewertung in ihrer Gesamtheit beurteilt. Werden zum Beispiel bei einer Zeitwertbewertung beobachtbare Parameter angewandt, die aufgrund von nicht beobachtbaren Parametern eine maßgebliche Anpassung erfordern, so ist diese Bewertung der Stufe 3 zuzuordnen.

Die Beurteilung der Maßgeblichkeit eines bestimmten Parameters für die Zeitwertbewertung in ihrer Gesamtheit erfordert Urteilsvermögen und die Abwägung von Faktoren, die für den Vermögenswert oder die Verbindlichkeit spezifisch sind.

Die Entscheidung, welche Parameter als beobachtbar gelten, erfordert beträchtliches Urteilsvermögen seitens des Managers. Als beobachtbare Parameter erachtet der Manager Marktdaten, die jederzeit verfügbar sind, auf Markttransaktionen basieren, nicht geschützt sind, regelmäßig veröffentlicht werden, transparent, überprüfbar, verlässlich und konsensgestützt sind und von unabhängigen Quellen bereitgestellt werden, die aktiv an dem betreffenden Markt beteiligt sind.

Der Wert der Anlagen der Portfolios in Aktien, börsengehandelten Indexfonds, Optionsscheinen und ge- und verkauften börsengehandelten Optionen, für die Marktnotierungen zugänglich sind, wird in der Regel durch die Einholung von Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern auf der Grundlage des letzten an einer Hauptbörse oder einem Hauptmarkt für dieses Wertpapier notierten Verkaufspreises ermittelt (Parameter der Stufe 1). An der NASDAQ gehandelte Wertpapiere werden normalerweise mit dem offiziellen NASDAQ-Schlusskurs („NOCP“) bewertet, der von der NASDAQ an jedem Geschäftstag bereitgestellt wird. Der NOCP ist der zuletzt gemeldete Kurs um 16:00:02 Uhr, Eastern Time, außer wenn dieser Kurs außerhalb der „internen“ Geld- und Briefkursspanne (d. h. der Geld- und Briefkurse, die sich die Händler gegenseitig beim Handel für ihre eigenen Konten nennen) liegt. In diesem Fall passt die NASDAQ den Kurs so an, dass er dem internen Geld- oder Briefkurs entspricht, je nachdem, welcher näher liegt. Aufgrund von Verzögerungen bei der Meldung von Transaktionen basiert der NOCP möglicherweise nicht auf dem Preis des letzten Geschäfts vor dem Marktschluss. Wenn es an einem bestimmten Tag keinen Verkauf eines Wertpapiers gibt, können die unabhängigen Pricing-Service-Anbieter das Wertpapier auf der Grundlage von Marktnotierungen bewerten.

Der Wert von Participatory Notes wird ermittelt, indem Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern eingeholt werden, die auf der zugrunde liegenden Aktien und dem anwendbaren Wechselkurs basieren (Inputfaktoren der Stufe 1).

Der Wert der Anlagen des Portfolios in Schuldtiteln wird in erster Linie durch die Einholung von Bewertungen unabhängiger Pricing-Service-Anbietern auf der Grundlage zugänglicher Mittelkurse bestimmt. Falls keine solchen verfügbar sind, werden Methoden genutzt, die verschiedene Überlegungen auf der Grundlage des Wertpapiertyps beinhalten (allgemein Inputfaktoren der Stufe 2). Wenn mehr als eine Marktnotierung für ein Wertpapier verfügbar ist, wird das Wertpapier auf Stufe 2 eingestuft. Neben der Berücksichtigung von Renditen oder Kursen von Wertpapieren vergleichbarer Qualität, des Kupons, der Laufzeit und des Typs, von Hinweisen auf Werte von Händlern und der allgemeinen Marktbedingungen werden im Folgenden weitere Parameter der Stufe 2 und damit verbundene Bewertungstechniken beschrieben, die von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern zur Bewertung bestimmter Arten, von den Portfolios gehaltenen Schuldtiteln verwendet werden:

**Unternehmensanleihen.** Zu den Parametern, die für die Bewertung von Unternehmensanleihen verwendet werden, gehören im Allgemeinen relevante Kreditinformationen, beobachtete Marktbewegungen, sektorrelevante Nachrichten, die Renditekurve der US-Staatsanleihen oder die relevante Benchmark-Renditekurve sowie andere Marktinformationen, zu denen die Renditekurve der Benchmark, gemeldete Transaktionen, Broker-Dealer-Quotierungen, Emittentenspreads, vergleichbare Wertpapiere und Referenzdaten, wie z. B. verfügbar Veröffentlichtungen im Bereich der Marktforschung („andere Marktinformationen“).

**Wandelanleihen.** Die zur Bewertung von Wandelanleihen (einschließlich CoCos) herangezogenen Parameter beinhalten gewöhnlich Daten zu den zugrunde liegenden Aktien, Wandelprämien, Kurse börsennotierter Anleihen und Vorzugsaktien und andere Marktinformationen. Darunter können gegebenenfalls Benchmarkkurven, Transaktionsausführungsdaten und Sensitivitätsanalysen sein.

**US-Staatsanleihen.** Die zur Bewertung von US-Staatsanleihen herangezogenen Parameter beinhalten gewöhnlich Notierungen verschiedener Inter-Dealer-Broker und andere Marktinformationen.

**FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR**

**12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)**

**(f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)**

*Quasistaatliche US-Wertpapiere.* Die zur Bewertung quasistaatlicher US-Wertpapiere herangezogenen Parameter beinhalten gewöhnlich das Einholen von Benchmark-Notierungen und andere Marktinformationen.

*Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS) und hypothekarisch besicherte Wertpapiere (MBS).* Zu den Parametern, die für die Bewertung von forderungsbesicherten Wertpapieren und hypothekarisch besicherten Wertpapieren verwendet werden, gehören im Allgemeinen Modelle, die eine Reihe von Faktoren berücksichtigen, darunter: vorzeitige Rückzahlungen, Cashflows, Spreadanpassungen und andere Marktinformationen.

*Hochzinstitel.* Zu den Parametern, die für die Bewertung von Hochzinstiteln verwendet werden, gehören im Allgemeinen eine Reihe von emittentenbezogenen Beobachtungen von Aktien- und Credit-Default-Swap-Kurven sowie sonstige Marktinformationen.

Schwellenländeranleihen und ausländische Staatsanleihen. Zu den Parametern, die für die Bewertung von Schuldtiteln aus Schwellenländern und ausländischen Staatspapieren verwendet werden, gehören im Allgemeinen Händlernerotierungen, Anleihemarktaktivitäten, diskontierte Cashflow-Modelle und andere relevante Informationen wie Kreditspreads, Benchmarkkurven und andere Marktinformationen.

*Besicherte Schuldtitel (Collateralized Loan Obligations, CLOs).* Der Wert besicherter Schuldtiteln wird vorrangig durch Cashflow-Daten, relevante Daten zur Preisgestaltung von Darlehen und Marktfarben (Informationen, die für ein Unternehmen, eine Branche oder einen Markt spezifischer sind als öffentliche Informationen) sowie durch das Research von Marktteilnehmern und Trading Desks bestimmt (Inputfaktoren der Stufe 2 oder 3).

Der Wert von Laufzeitkrediten wird in erster Linie durch Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern auf der Grundlage von Broker-Quotierungen ermittelt (im Allgemeinen Inputfaktoren der Stufe 2 oder 3, je nach Anzahl der verfügbaren Quotierungen).

Der Wert der Insurance-Linked Securities wird vom Manager überwiegend durch Einholung von Bewertungen seitens unabhängiger externer Preisdienste auf der Grundlage von Mittelkursen (Inputfaktoren der Stufe 2 oder 3) bestimmt.

Der Wert von Futures-Kontrakten wird ermittelt, indem Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern zum Abrechnungskurs bei Börsenschluss eingeholt werden (Inputfaktoren der Stufe 1).

Der Wert von Devisenterminkontrakten wird bestimmt, indem Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern eingeholt werden, die auf tatsächlich gehandelten Währungskursen in den Netzwerken dieser unabhängigen Dienste sowie auf anderen gehandelten und notierten Währungskursen basieren, die den Pricing-Service-Anbietern von führenden Marktteilnehmern zur Verfügung gestellt werden (Inputfaktoren der Stufe 2).

Der Wert von Credit Default Swaps wird ermittelt, indem Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern eingeholt werden. Dabei kommt ein Modell zum Einsatz, das eine Reihe von Faktoren berücksichtigt, darunter möglicherweise Ausfallwahrscheinlichkeiten, Kreditkurven, Wiedereinbringungsquoten und Cashflows (Inputfaktoren der Stufe 2 oder 3).

Der Wert von Inflationswaps wird in erster Linie durch die Einholung von Bewertungen unabhängiger Pricing-Service-Anbieter unter Bezugnahme auf die zugrunde liegenden Inflationsraten einschließlich der prognostizierten erwarteten Inflationsrate und der jeweiligen Interbank Offered Forward Rate für den Tagessatz ermittelt. Der Barwert wird anhand der erwarteten Cashflows auf Basis der Swap-Parameter sowie unter Bezugnahme auf die zugrunde liegende Inflationserwartungskurve und den Referenzsatz berechnet (Inputfaktoren der Stufe 2).

Der Wert von Zinsswaps wird in erster Linie durch die Einholung von Bewertungen unabhängiger Pricing-Service-Anbieter auf der Grundlage von Referenzen zu den zugrunde liegenden Sätzen einschließlich des lokalen OIS (Overnight Index Swap) und des jeweiligen IBOR (Interbank Offered Forward) für den Tagessatz ermittelt. Der Barwert wird anhand der erwarteten Cashflows auf Basis der Swap-Parameter sowie unter Bezugnahme auf die zugrunde liegende Zinskurve und den Referenzzinssatz berechnet (Inputfaktoren der Stufe 2).

Der Wert von Total Return Swaps wird bestimmt, indem Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern unter Verwendung des zugrunde liegenden Vermögenswerts und des angegebenen Zinssatzes der Benchmark eingeholt werden (Inputfaktoren der Stufe 2).

Der Wert von Cross-Currency-Swaps wird durch die Einholung von Bewertungen unabhängiger Pricing-Service-Anbieter anhand des Barwerts der erwarteten Cashflows auf Basis der Swap-Parameter sowie unter Bezugnahme auf die zugrunde liegende Zinskurve und den Referenzzinssatz berechnet (Inputfaktoren der Stufe 2).

Der Wert von Volatility-Swaps wird in erster Linie durch die Einholung von Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern ermittelt und basiert auf einem vorab festgestellten Volatilitätsniveau gegenüber der tatsächlichen, über einen gewissen Zeitraum realisierten Volatilität auf Grundlage von Daten des Referenzwerts (Inputfaktoren der Stufe 2 oder 3).

Der Wert von Variance-Swaps wird in erster Linie durch die Einholung von Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern ermittelt und basiert auf der in der Vergangenheit realisierten und der voraussichtlichen künftigen Varianz (oder fairen Varianz) des Referenzwerts (Inputfaktoren der Stufe 2 oder 3).

**FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR****12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)****(f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)**

Der Wert von Correlation-Swaps wird in erster Linie durch die Einholung von Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern ermittelt und basiert auf der Differenzen zwischen der realisierten Korrelation und einem festen Korrelationswert (Inputfaktoren der Stufe 2 oder 3).

Der Wert von Differenzkontrakten („CFD“) wird in erster Linie durch die Einholung von Bewertungen unabhängiger Pricing-Service-Anbieter ermittelt, die auf der Bezugnahme auf den zugrunde liegenden Vermögenswert sowie den angegebenen Referenzzinssatz beruhen (Inputfaktoren der Stufe 2 oder 3).

Der Wert von Swaptions wird ermittelt, indem Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern oder von Gegenparteien zum Abrechnungskurs bei Börsenschluss eingeholt werden (Inputfaktoren der Stufe 2).

Optionskontrakte, die im Freiverkehr gehandelt werden, werden generell auf der Grundlage von Notierungen bewertet, die von Broker-Dealern gestellt werden, oder von Preisen, die von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern bereitgestellt werden, welche eine Reihe von Methoden einsetzen, unter anderem simulierte Preismodelle und/oder Kurvenanpassung (Bootstrapping), was die Ermittlung des Barwerts der Kontrakte erleichtert. Die Preismodelle ziehen Parameter heran, die auf aktiv notierten Märkten beobachtet werden, wie Angaben zum Emittenten, Indizes, Spreads, Zinssätze, Renditekurven, Volatilitätsoberflächen und Wechselkurse (Inputfaktoren der Stufe 2).

Einlagenzertifikate werden zu fortgeschriebenen Anschaffungskosten bewertet (Inputfaktoren der Stufe 2).

Der Wert von Pensionsgeschäften und umgekehrten Pensionsgeschäften wird vom Manager überwiegend durch das Einholen von Bewertungen seitens unabhängiger Pricing-Service-Anbieter bestimmt und gemäß den Marktkonventionen zum Nennwert (Inputfaktoren der Stufe 2) bewertet.

Der Manager hat einen Prozess entwickelt, um die von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern bereitgestellten Informationen für alle Arten von Wertpapieren regelmäßig zu überprüfen.

Anlagen in nicht börsengehandelte Investmentfonds werden anhand des täglich berechneten Nettoinventarwerts („NIW“) pro Anteil des jeweiligen Fonds bewertet (Inputfaktoren der Stufe 2), sofern verfügbar.

Wenn keine Bewertung von einem unabhängigen Pricing-Service-Anbieter verfügbar ist oder wenn der Manager Grund zu der Annahme hat, dass die erhaltene Bewertung nicht dem Betrag entspricht, den ein Portfolio bei einem aktuellen Verkauf in einer ordnungsgemäßen Transaktion vernünftigerweise erwarten könnte, versucht der Manager, Quotierungen von Brokern oder Händlern einzuholen (sie werden im Allgemeinen je nach der Anzahl der verfügbaren Angebote als Inputfaktoren der Stufe 2 oder der Stufe 3 erachtet). Wenn solche Quotierungen nicht verfügbar sind, wird das Wertpapier anhand von Methoden bewertet, welche die Direktoren in dem guten Glauben genehmigt haben, dass die resultierende Bewertung den beizulegenden Zeitwert des Wertpapiers widerspiegelt.

Parameter und Annahmen, die bei der Bestimmung des beizulegenden Zeitwerts eines Wertpapiers auf der Grundlage von Inputfaktoren der Stufe 2 oder 3 berücksichtigt werden, gehören unter anderem die Art des Wertpapiers, die Anschaffungskosten des Wertpapiers, das Vorhandensein vertraglicher Beschränkungen für die Veräußerung des Wertpapiers, der Preis und der Umfang des öffentlichen Handels mit ähnlichen Wertpapieren des Emittenten oder vergleichbarer Unternehmen; Notierungen oder bewertete Preise von Broker-Dealern und/oder Pricing-Service-Anbietern; Informationen, die vom Emittenten und/oder von Analysten eingeholt wurden; eine Analyse der Abschlüsse des Unternehmens oder des Emittenten; eine Bewertung der Parameter, die den Emittenten beeinflussen, und des Marktes/der Märkte, auf dem/denen das Wertpapier gekauft und verkauft wird.

Der Wert der Anlagen der Portfolios in ausländischen Wertpapieren wird in der Regel mit denselben Bewertungsmethoden und Parametern wie bei anderen Portfolioanlagen und wie oben beschrieben bestimmt. Die in Landeswährung ausgedrückten Preise ausländischer Wertpapiere werden normalerweise von der Landeswährung in US-Dollar umgerechnet. Dabei werden die Wechselkurse um 16:00 Uhr Eastern Time an Tagen verwendet, an denen die New York Stock Exchange („NYSE“) für den Geschäftsverkehr geöffnet ist. Die Direktoren haben die Inanspruchnahme der Interactive Data Pricing & Reference Data LLC („ICE“) genehmigt, um bei der Ermittlung des beizulegenden Zeitwerts ausländischer Dividendenpapiere mitzuwirken, wenn Änderungen im Wert eines bestimmten Index andeuten, dass die Schlusskurse an den ausländischen Börsen ggf. nicht länger repräsentativ für den Preis sind, den ein Portfolio für diese Wertpapiere oder an Tagen erwarten könnte, wenn ausländische Märkte geschlossen und US-Märkte offen sind. In jedem dieser Fälle liefert ICE mittels einer statistischen Analyse historischer Korrelationen mehrerer Faktoren angepasste Kurse für bestimmte ausländische Dividendenpapiere (Inputfaktoren der Stufe 2). Die Direktoren haben zudem die Verwendung von ICE genehmigt, um die Preise ausländischer Schuldtiteln zu dem Zeitpunkt zu bewerten, zu dem der Anteilspreis eines Portfolios berechnet wird. ICE verwendet Benchmark-Spread- und Renditekurven und wertet die verfügbaren Marktaktivitäten vom lokalen Börsenschluss bis zu dem Zeitpunkt aus, zu dem der Anteilspreis eines Portfolios berechnet wird (Inputfaktoren der Stufe 2), um so bei der Ermittlung der Preise bestimmter ausländischer Schuldtitel zu helfen.

Sowohl bei ausländischen Aktien als auch bei ausländischen Schuldtiteln haben die Direktoren Mangels genauer Informationen über die Marktwerte dieser ausländischen Wertpapiere zu dem Zeitpunkt, wenn der Anteilspreis eines Portfolios berechnet wird anhand verfügbarer Daten entschieden, dass auf diese Art und Weise angepasste oder geschätzte Preise wahrscheinlich eher den Preisen entsprechen, die ein Portfolio bei einem aktuellen Verkauf erzielen könnte, als die Preise derjenigen Wertpapiere, die bei Börsenschluss der ausländischen Märkte ermittelt werden, auf denen die Wertpapiere vorwiegend gehandelt werden.

Preise zum beizulegenden Zeitwert sind notwendigerweise Schätzungen. Es gibt keine Gewähr, dass ein solcher Preis dem tatsächlichen Preis, zu dem das Wertpapier als nächstes notiert oder gehandelt wird, entspricht oder diesem nahe kommt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Die nachstehenden Tabellen zeigen Finanzanlagen nach den Stufen in der Zeitwerthierarchie:

**Absolute Return Multi Strategy\***

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3**<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-------------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte |                 |                 |                   |                   |
| Aktien  | –               | –               | 0                 | 0                 |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                     | <b>–</b>        | <b>–</b>        | <b>0</b>          | <b>0</b>          |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3**<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-------------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte |                 |                 |                   |                   |
| Aktien  | –               | –               | 6.311             | 6.311             |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                     | <b>–</b>        | <b>–</b>        | <b>6.311</b>      | <b>6.311</b>      |

\* Das Portfolio wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

\*\* Aktien der Stufe 3 wurden in Übereinstimmung mit den von den Direktoren genehmigten Verfahren bewertet.

**Asia Responsible Transition Bond**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$   | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|--|-----------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte    |                 |                   |                 |                   |
| Unternehmensanleihen                                   | –               | 21.012.411        | –               | 21.012.411        |
| Staatsanleihen   | –               | 5.093.501         | –               | 5.093.501         |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten  | –               | 101.004           | –               | 101.004           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten       | 32.814          | –                 | –               | 32.814            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten       | –               | 171               | –               | 171               |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                        | <b>32.814</b>   | <b>26.207.087</b> | <b>–</b>        | <b>26.239.901</b> |
|  |                 |                   |                 |                   |
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                 |                   |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –               | (81.996)          | –               | (81.996)          |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten      | (67.920)        | –                 | –               | (67.920)          |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>(67.920)</b> | <b>(81.996)</b>   | <b>–</b>        | <b>(149.916)</b>  |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Asia Responsible Transition Bond (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$   | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-----------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                 |                   |                 |                   |
| Schatzwechsel   | –               | 2.496.736         | –               | 2.496.736         |
| Unternehmensanleihen                                  | –               | 45.692.223        | –               | 45.692.223        |
| Staatsanleihen  | –               | 12.025.196        | –               | 12.025.196        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –               | 127.055           | –               | 127.055           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten      | 255.858         | –                 | –               | 255.858           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten      | –               | 575               | –               | 575               |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>255.858</b>  | <b>60.341.785</b> | <b>–</b>        | <b>60.597.643</b> |

|  | Stufe 1<br>US\$  | Stufe 2<br>US\$  | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|--|------------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                  |                  |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –                | (135.330)        | –               | (135.330)         |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten      | (128.113)        | –                | –               | (128.113)         |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten      | –                | (21)             | –               | (21)              |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>(128.113)</b> | <b>(135.351)</b> | <b>–</b>        | <b>(263.464)</b>  |

## China A-Share Equity

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|   | Stufe 1<br>CNY    | Stufe 2<br>CNY | Stufe 3<br>CNY | Insgesamt<br>CNY  |
|---|-------------------|----------------|----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte |                   |                |                |                   |
| Aktien  | 14.682.825        | –              | –              | 14.682.825        |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                     | <b>14.682.825</b> | <b>–</b>       | <b>–</b>       | <b>14.682.825</b> |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|   | Stufe 1<br>CNY    | Stufe 2<br>CNY | Stufe 3<br>CNY | Insgesamt<br>CNY  |
|---|-------------------|----------------|----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte |                   |                |                |                   |
| Aktien  | 13.480.937        | –              | –              | 13.480.937        |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                     | <b>13.480.937</b> | <b>–</b>       | <b>–</b>       | <b>13.480.937</b> |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

China Bond

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|  | Stufe 1<br>CNY | Stufe 2<br>CNY     | Stufe 3<br>CNY | Insgesamt<br>CNY   |
|--|----------------|--------------------|----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte    |                |                    |                |                    |
| Unternehmensanleihen                                   | –              | 69.415.652         | –              | 69.415.652         |
| Staatsanleihen   | –              | 47.383.173         | –              | 47.383.173         |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten  | –              | 1.649.026          | –              | 1.649.026          |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten       | 14.109         | –                  | –              | 14.109             |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten       | –              | 5.674              | –              | 5.674              |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                        | <b>14.109</b>  | <b>118.453.525</b> | <b>–</b>       | <b>118.467.634</b> |
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                |                    |                |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –              | (1.502.829)        | –              | (1.502.829)        |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>–</b>       | <b>(1.502.829)</b> | <b>–</b>       | <b>(1.502.829)</b> |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|  | Stufe 1<br>CNY | Stufe 2<br>CNY     | Stufe 3<br>CNY | Insgesamt<br>CNY   |
|--|----------------|--------------------|----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte    |                |                    |                |                    |
| Einlagezertifikat                                      | –              | 58.557.000         | –              | 58.557.000         |
| Unternehmensanleihen                                   | –              | 290.154.114        | –              | 290.154.114        |
| Staatsanleihen   | –              | 95.858.682         | –              | 95.858.682         |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten  | –              | 1.943.751          | –              | 1.943.751          |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten       | 603.582        | –                  | –              | 603.582            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                        | <b>603.582</b> | <b>446.513.547</b> | <b>–</b>       | <b>447.117.129</b> |
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                |                    |                |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –              | (2.361.945)        | –              | (2.361.945)        |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>–</b>       | <b>(2.361.945)</b> | <b>–</b>       | <b>(2.361.945)</b> |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## China Equity

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|   | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|--------------------|-----------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                    |                 |                 |                    |
| Aktien  | 134.512.686        | –               | –               | 134.512.686        |
| Participatory Notes                                   | –                  | 255.378         | –               | 255.378            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –                  | 685.905         | –               | 685.905            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>134.512.686</b> | <b>941.283</b>  | <b>–</b>        | <b>135.453.969</b> |

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$  | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|--|-----------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                 |                  |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –               | (866.976)        | –               | (866.976)         |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>–</b>        | <b>(866.976)</b> | <b>–</b>        | <b>(866.976)</b>  |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|   | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|--------------------|-----------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                    |                 |                 |                    |
| Aktien  | 171.916.351        | –               | –               | 171.916.351        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –                  | 547.220         | –               | 547.220            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>171.916.351</b> | <b>547.220</b>  | <b>–</b>        | <b>172.463.571</b> |

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$  | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|--|-----------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                 |                  |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –               | (423.344)        | –               | (423.344)         |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>–</b>        | <b>(423.344)</b> | <b>–</b>        | <b>(423.344)</b>  |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Climate Innovation<sup>1</sup>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|   | Stufe 1<br>US\$  | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|------------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte |                  |                 |                 |                   |
| Aktien  | 2.142.953        | 806.229         | –               | 2.949.182         |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                     | <b>2.142.953</b> | <b>806.229</b>  | <b>–</b>        | <b>2.949.182</b>  |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|   | Stufe 1<br>US\$  | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|------------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte |                  |                 |                 |                   |
| Aktien  | 2.603.137        | 228.261         | –               | 2.831.398         |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                     | <b>2.603.137</b> | <b>228.261</b>  | <b>–</b>        | <b>2.831.398</b>  |

CLO Income

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$      | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$    |
|---|-----------------|----------------------|-----------------|----------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                 |                      |                 |                      |
| Schatzwechsel   | –               | 80.045.443           | –               | 80.045.443           |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)       | –               | 934.118.980          | –               | 934.118.980          |
| Pensionsgeschäfte                                     | –               | 84.500.000           | –               | 84.500.000           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –               | 28.699.677           | –               | 28.699.677           |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>–</b>        | <b>1.127.364.100</b> | <b>–</b>        | <b>1.127.364.100</b> |

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten      |                 |                    |                 |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten      | –               | (8.100.316)        | –               | (8.100.316)        |
| Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten | –               | (194.289)          | –               | (194.289)          |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                         | <b>–</b>        | <b>(8.294.605)</b> | <b>–</b>        | <b>(8.294.605)</b> |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## CLO Income (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|  | Stufe 1<br>US\$   | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|--|-------------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte        |                   |                    |                 |                    |
| Schatzwechsel  | –                 | 4.994.906          | –               | 4.994.906          |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)            | –                 | 159.687.075        | –               | 159.687.075        |
| Investmentfonds  | 12.221.060        | –                  | –               | 12.221.060         |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten      | –                 | 2.345.289          | –               | 2.345.289          |
| Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten | –                 | 48.732             | –               | 48.732             |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                            | <b>12.221.060</b> | <b>167.076.002</b> | <b>–</b>        | <b>179.297.062</b> |

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|--|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                 |                    |                 |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –               | (2.570.754)        | –               | (2.570.754)        |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>–</b>        | <b>(2.570.754)</b> | <b>–</b>        | <b>(2.570.754)</b> |

## Commodities

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                 |                    |                 |                    |
| Schatzwechsel   | –               | 47.615.993         | –               | 47.615.993         |
| Unternehmensanleihen                                  | –               | 85.264.336         | –               | 85.264.336         |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –               | 329.265            | –               | 329.265            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>–</b>        | <b>133.209.594</b> | <b>–</b>        | <b>133.209.594</b> |

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|--|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                 |                    |                 |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –               | (1.617.307)        | –               | (1.617.307)        |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>–</b>        | <b>(1.617.307)</b> | <b>–</b>        | <b>(1.617.307)</b> |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Commodities (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|--|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte        |                 |                    |                 |                    |
| Schatzwechsel  | –               | 43.941.161         | –               | 43.941.161         |
| Unternehmensanleihen                                       | –               | 77.031.796         | –               | 77.031.796         |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten      | –               | 1.573.388          | –               | 1.573.388          |
| Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten | –               | 0                  | –               | 0                  |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                            | <b>–</b>        | <b>122.546.345</b> | <b>–</b>        | <b>122.546.345</b> |

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$  | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-----------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten      |                 |                  |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten      | –               | (210.126)        | –               | (210.126)         |
| Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten | –               | (0)              | –               | (0)               |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                         | <b>–</b>        | <b>(210.126)</b> | <b>–</b>        | <b>(210.126)</b>  |

Corporate Hybrid Bond

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|   | Stufe 1<br>EUR | Stufe 2<br>EUR       | Stufe 3<br>EUR | Insgesamt<br>EUR     |
|---|----------------|----------------------|----------------|----------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                |                      |                |                      |
| Unternehmensanleihen                                  | –              | 2.167.985.323        | –              | 2.167.985.323        |
| Pensionsgeschäfte                                     | –              | 14.002.897           | –              | 14.002.897           |
| Investmentfonds                                       | –              | 12.265.572           | –              | 12.265.572           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –              | 19.233.303           | –              | 19.233.303           |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>–</b>       | <b>2.213.487.095</b> | <b>–</b>       | <b>2.213.487.095</b> |

|  | Stufe 1<br>EUR | Stufe 2<br>EUR      | Stufe 3<br>EUR | Insgesamt<br>EUR    |
|--|----------------|---------------------|----------------|---------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                |                     |                |                     |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –              | (27.715.188)        | –              | (27.715.188)        |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>–</b>       | <b>(27.715.188)</b> | <b>–</b>       | <b>(27.715.188)</b> |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|   | Stufe 1<br>EUR | Stufe 2<br>EUR       | Stufe 3<br>EUR | Insgesamt<br>EUR     |
|---|----------------|----------------------|----------------|----------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                |                      |                |                      |
| Unternehmensanleihen                                  | –              | 1.743.583.625        | –              | 1.743.583.625        |
| Investmentfonds                                       | –              | 10.956.412           | –              | 10.956.412           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –              | 12.101.176           | –              | 12.101.176           |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>–</b>       | <b>1.766.641.213</b> | <b>–</b>       | <b>1.766.641.213</b> |

|  | Stufe 1<br>EUR | Stufe 2<br>EUR     | Stufe 3<br>EUR | Insgesamt<br>EUR   |
|--|----------------|--------------------|----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                |                    |                |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –              | (7.732.130)        | –              | (7.732.130)        |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>–</b>       | <b>(7.732.130)</b> | <b>–</b>       | <b>(7.732.130)</b> |

Developed Market FMP – 2027<sup>1</sup>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                 |                    |                 |                    |
| Unternehmensanleihen                                  | –               | 125.679.450        | –               | 125.679.450        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –               | 619                | –               | 619                |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>–</b>        | <b>125.680.069</b> | <b>–</b>        | <b>125.680.069</b> |

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|--|-----------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                 |                 |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –               | (69.447)        | –               | (69.447)          |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>–</b>        | <b>(69.447)</b> | <b>–</b>        | <b>(69.447)</b>   |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Developed Market FMP – 2027<sup>1</sup> (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                 |                    |                 |                    |
| Unternehmensanleihen                                  | –               | 135.777.186        | –               | 135.777.186        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –               | 39.869             | –               | 39.869             |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>–</b>        | <b>135.817.055</b> | <b>–</b>        | <b>135.817.055</b> |

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|--|-----------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                 |                 |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –               | (393)           | –               | (393)             |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>–</b>        | <b>(393)</b>    | <b>–</b>        | <b>(393)</b>      |

EMD Corporate – Social and Environmental Transition

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte       |                 |                    |                 |                    |
| Unternehmensanleihen                                      | –               | 105.120.488        | –               | 105.120.488        |
| Staatsanleihen  | –               | 6.781.268          | –               | 6.781.268          |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten     | –               | 268.863            | –               | 268.863            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten          | 115.178         | –                  | –               | 115.178            |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten | –               | 125.331            | –               | 125.331            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                           | <b>115.178</b>  | <b>112.295.950</b> | <b>–</b>        | <b>112.411.128</b> |

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|--|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                 |                    |                 |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –               | (2.500.151)        | –               | (2.500.151)        |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten      | (7.734)         | –                  | –               | (7.734)            |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>(7.734)</b>  | <b>(2.500.151)</b> | <b>–</b>        | <b>(2.507.885)</b> |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## EMD Corporate – Social and Environmental Transition (Fortsetzung)

## Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|  | Stufe 1<br>US\$  | Stufe 2<br>US\$   | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|--|------------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte    |                  |                   |                 |                   |
| Unternehmensanleihen                                   | –                | 83.464.415        | –               | 83.464.415        |
| Staatsanleihen   | –                | 7.168.384         | –               | 7.168.384         |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten  | –                | 1.906.675         | –               | 1.906.675         |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten       | 27.031           | –                 | –               | 27.031            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                        | <b>27.031</b>    | <b>92.539.474</b> | <b>–</b>        | <b>92.566.505</b> |
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                  |                   |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –                | (235.957)         | –               | (235.957)         |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten      | (236.161)        | –                 | –               | (236.161)         |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>(236.161)</b> | <b>(235.957)</b>  | <b>–</b>        | <b>(472.118)</b>  |

## Emerging Market Debt - Hard Currency

## Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|   | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$      | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$    |
|---|--------------------|----------------------|-----------------|----------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte       |                    |                      |                 |                      |
| Unternehmensanleihen                                      | –                  | 741.805.425          | –               | 741.805.425          |
| Staatsanleihen  | –                  | 1.813.828.146        | –               | 1.813.828.146        |
| Pensionsgeschäfte   | –                  | 60.000.000           | –               | 60.000.000           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten     | –                  | 9.083.011            | –               | 9.083.011            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten          | 7.790.478          | –                    | –               | 7.790.478            |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten | –                  | 3.456.849            | –               | 3.456.849            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                           | <b>7.790.478</b>   | <b>2.628.173.431</b> | <b>–</b>        | <b>2.635.963.909</b> |
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten    |                    |                      |                 |                      |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten    | –                  | (22.032.237)         | –               | (22.032.237)         |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten         | (4.217.458)        | –                    | –               | (4.217.458)          |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                       | <b>(4.217.458)</b> | <b>(22.032.237)</b>  | <b>–</b>        | <b>(26.249.695)</b>  |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|   | Stufe 1<br>US\$   | Stufe 2<br>US\$      | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$    |
|---|-------------------|----------------------|-----------------|----------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                   |                      |                 |                      |
| Unternehmensanleihen                                  | –                 | 732.442.764          | –               | 732.442.764          |
| Staatsanleihen  | –                 | 1.794.182.602        | –               | 1.794.182.602        |
| Investmentfonds                                       | –                 | 17.580.000           | –               | 17.580.000           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –                 | 24.839.124           | –               | 24.839.124           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten      | 19.568.314        | –                    | –               | 19.568.314           |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>19.568.314</b> | <b>2.569.044.490</b> | <b>–</b>        | <b>2.588.612.804</b> |

|  | Stufe 1<br>US\$     | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$   |
|--|---------------------|--------------------|-----------------|---------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                     |                    |                 |                     |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –                   | (5.652.118)        | –               | (5.652.118)         |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten      | (10.222.785)        | –                  | –               | (10.222.785)        |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>(10.222.785)</b> | <b>(5.652.118)</b> | <b>–</b>        | <b>(15.874.903)</b> |

Emerging Market Debt - Local Currency

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$      | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$    |
|---|-----------------|----------------------|-----------------|----------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                 |                      |                 |                      |
| Unternehmensanleihen                                  | –               | 55.840.021           | –               | 55.840.021           |
| Staatsanleihen  | –               | 974.722.981          | –               | 974.722.981          |
| Investmentfonds                                       | –               | 4.040.368            | –               | 4.040.368            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –               | 12.896.398           | –               | 12.896.398           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten      | 170.988         | –                    | –               | 170.988              |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten      | –               | 9.523.599            | –               | 9.523.599            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>170.988</b>  | <b>1.057.023.367</b> | <b>–</b>        | <b>1.057.194.355</b> |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$     | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$   |
|--|-----------------|---------------------|-----------------|---------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                 |                     |                 |                     |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –               | (19.531.329)        | –               | (19.531.329)        |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten      | –               | (17.894.200)        | –               | (17.894.200)        |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>–</b>        | <b>(37.425.529)</b> | <b>–</b>        | <b>(37.425.529)</b> |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$      | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$    |
|---|-----------------|----------------------|-----------------|----------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                 |                      |                 |                      |
| Schatzwechsel   | –               | 33.341.150           | –               | 33.341.150           |
| Unternehmensanleihen                                  | –               | 41.825.600           | –               | 41.825.600           |
| Staatsanleihen  | –               | 1.124.421.834        | –               | 1.124.421.834        |
| Investmentfonds                                       | –               | 16.173.300           | –               | 16.173.300           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –               | 17.116.276           | –               | 17.116.276           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten      | 313.668         | –                    | –               | 313.668              |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten      | –               | 11.479.756           | –               | 11.479.756           |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>313.668</b>  | <b>1.244.357.916</b> | <b>–</b>        | <b>1.244.671.584</b> |

|  | Stufe 1<br>US\$  | Stufe 2<br>US\$     | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$   |
|--|------------------|---------------------|-----------------|---------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                  |                     |                 |                     |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –                | (12.281.584)        | –               | (12.281.584)        |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten      | (716.676)        | –                   | –               | (716.676)           |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten      | –                | (14.977.755)        | –               | (14.977.755)        |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>(716.676)</b> | <b>(27.259.339)</b> | <b>–</b>        | <b>(27.976.015)</b> |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Emerging Market Debt Blend

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte       |                 |                    |                 |                    |
| Unternehmensanleihen                                      | –               | 152.243.177        | –               | 152.243.177        |
| Staatsanleihen  | –               | 304.516.261        | –               | 304.516.261        |
| Investmentfonds   | –               | 4.001.641          | –               | 4.001.641          |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten     | –               | 3.978.941          | –               | 3.978.941          |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten          | 515.959         | –                  | –               | 515.959            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten          | –               | 3.564.172          | –               | 3.564.172          |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten | –               | 563.137            | –               | 563.137            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                           | <b>515.959</b>  | <b>468.867.329</b> | <b>–</b>        | <b>469.383.288</b> |

|  | Stufe 1<br>US\$  | Stufe 2<br>US\$     | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$   |
|--|------------------|---------------------|-----------------|---------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                  |                     |                 |                     |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –                | (9.007.086)         | –               | (9.007.086)         |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten      | (353.288)        | –                   | –               | (353.288)           |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten      | –                | (6.997.058)         | –               | (6.997.058)         |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>(353.288)</b> | <b>(16.004.144)</b> | <b>–</b>        | <b>(16.357.432)</b> |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|   | Stufe 1<br>US\$  | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|------------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                  |                    |                 |                    |
| Schatzwechsel   | –                | 1.006.392          | –               | 1.006.392          |
| Unternehmensanleihen                                  | –                | 148.077.852        | –               | 148.077.852        |
| Staatsanleihen  | –                | 330.568.106        | –               | 330.568.106        |
| Investmentfonds                                       | –                | 14.297.035         | –               | 14.297.035         |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –                | 6.637.946          | –               | 6.637.946          |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten      | 1.199.361        | –                  | –               | 1.199.361          |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten      | –                | 2.641.912          | –               | 2.641.912          |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>1.199.361</b> | <b>503.229.243</b> | <b>–</b>        | <b>504.428.604</b> |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|  | Stufe 1<br>US\$  | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|--|------------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                  |                    |                 |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –                | (2.075.226)        | –               | (2.075.226)        |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten      | (969.525)        | –                  | –               | (969.525)          |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten      | –                | (5.804.925)        | –               | (5.804.925)        |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>(969.525)</b> | <b>(7.880.151)</b> | <b>–</b>        | <b>(8.849.676)</b> |

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$   | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-----------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                 |                   |                 |                   |
| Unternehmensanleihen                                  | –               | 10.355.204        | –               | 10.355.204        |
| Staatsanleihen  | –               | 41.785.641        | –               | 41.785.641        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –               | 370.527           | –               | 370.527           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten      | 286.707         | –                 | –               | 286.707           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten      | –               | 89.612            | –               | 89.612            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>286.707</b>  | <b>52.600.984</b> | <b>–</b>        | <b>52.887.691</b> |

|   | Stufe 1<br>US\$  | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|------------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten    |                  |                    |                 |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten    | –                | (1.223.159)        | –               | (1.223.159)        |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten         | (238.510)        | –                  | –               | (238.510)          |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten | –                | (4.783)            | –               | (4.783)            |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten         | –                | (107.358)          | –               | (107.358)          |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                       | <b>(238.510)</b> | <b>(1.335.300)</b> | <b>–</b>        | <b>(1.573.810)</b> |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$   | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-----------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                 |                   |                 |                   |
| Schatzwechsel   | –               | 821.151           | –               | 821.151           |
| Unternehmensanleihen                                  | –               | 9.239.606         | –               | 9.239.606         |
| Staatsanleihen  | –               | 48.266.565        | –               | 48.266.565        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –               | 2.325.031         | –               | 2.325.031         |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten      | 832.110         | –                 | –               | 832.110           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten      | –               | 19.138            | –               | 19.138            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>832.110</b>  | <b>60.671.491</b> | <b>–</b>        | <b>61.503.601</b> |

|  | Stufe 1<br>US\$  | Stufe 2<br>US\$  | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|--|------------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                  |                  |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –                | (284.238)        | –               | (284.238)         |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten      | (356.901)        | –                | –               | (356.901)         |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten      | –                | (38.443)         | –               | (38.443)          |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>(356.901)</b> | <b>(322.681)</b> | <b>–</b>        | <b>(679.582)</b>  |

Emerging Markets Equity

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|   | Stufe 1<br>US\$   | Stufe 2<br>US\$   | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|-------------------|-------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                   |                   |                 |                    |
| Aktien  | 85.600.592        | 16.695.973        | –               | 102.296.565        |
| Immobilienaktiengesellschaften                        | 869.911           | –                 | –               | 869.911            |
| Participatory Notes                                   | –                 | 3.146.146         | –               | 3.146.146          |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –                 | 874.873           | –               | 874.873            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>86.470.503</b> | <b>20.716.992</b> | <b>–</b>        | <b>107.187.495</b> |

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|--|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                 |                    |                 |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –               | (1.965.401)        | –               | (1.965.401)        |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>–</b>        | <b>(1.965.401)</b> | <b>–</b>        | <b>(1.965.401)</b> |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Emerging Markets Equity (Fortsetzung)

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|
| <b>Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 1</b> |                 |                 |                 |
| Aktien                                      | 1.282.965       | (1.282.965)     | –               |

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024 wurde eine Aktie von Stufe 2 in Stufe 1 übertragen, da diese die von den Direktoren genehmigten Verfahren nicht mehr verwendet.

## Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

## Zum 31. Dezember 2023

|   | Stufe 1<br>US\$   | Stufe 2<br>US\$   | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-------------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                   |                   |                 |                   |
| Aktien  | 67.541.404        | 19.761.296        | –               | 87.302.700        |
| Immobilienaktiengesellschaften                        | 481.105           | –                 | –               | 481.105           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –                 | 1.272.409         | –               | 1.272.409         |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>68.022.509</b> | <b>21.033.705</b> | <b>–</b>        | <b>89.056.214</b> |

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$  | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|--|-----------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                 |                  |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –               | (787.152)        | –               | (787.152)         |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>–</b>        | <b>(787.152)</b> | <b>–</b>        | <b>(787.152)</b>  |

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|
| <b>Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 1</b> |                 |                 |                 |
| Aktien                                      | 2.701.849       | (2.701.849)     | –               |

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurden bestimmte Aktien von Stufe 2 in Stufe 1 übertragen, da die Preisfindung durch einen Pricing-Anbieter erfolgte.

## Euro Bond

## Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

## Zum 31. Dezember 2024

|   | Stufe 1<br>EUR | Stufe 2<br>EUR    | Stufe 3<br>EUR | Insgesamt<br>EUR  |
|---|----------------|-------------------|----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte |                |                   |                |                   |
| Unternehmensanleihen                                | –              | 33.145.394        | –              | 33.145.394        |
| Staatsanleihen                                      | –              | 34.603.245        | –              | 34.603.245        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten    | 141.000        | –                 | –              | 141.000           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten    | –              | 1.698             | –              | 1.698             |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                     | <b>141.000</b> | <b>67.750.337</b> | <b>–</b>       | <b>67.891.337</b> |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Euro Bond (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|   | Stufe 1<br>EUR   | Stufe 2<br>EUR   | Stufe 3<br>EUR | Insgesamt<br>EUR |
|---|------------------|------------------|----------------|------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten    |                  |                  |                |                  |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten         | (226.870)        | –                | –              | (226.870)        |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten         | –                | (6.230)          | –              | (6.230)          |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten | –                | (239.328)        | –              | (239.328)        |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                       | <b>(226.870)</b> | <b>(245.558)</b> | <b>–</b>       | <b>(472.428)</b> |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|   | Stufe 1<br>EUR | Stufe 2<br>EUR    | Stufe 3<br>EUR | Insgesamt<br>EUR  |
|---|----------------|-------------------|----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte     |                |                   |                |                   |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)         | –              | 4.100             | –              | 4.100             |
| Unternehmensanleihen                                    | –              | 4.770.071         | –              | 4.770.071         |
| Staatsanleihen  | –              | 5.399.389         | –              | 5.399.389         |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten        | 32.300         | –                 | –              | 32.300            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten | –              | 6.642             | –              | 6.642             |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten        | –              | 7.001             | –              | 7.001             |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                         | <b>32.300</b>  | <b>10.187.203</b> | <b>–</b>       | <b>10.219.503</b> |

|   | Stufe 1<br>EUR  | Stufe 2<br>EUR  | Stufe 3<br>EUR | Insgesamt<br>EUR |
|---|-----------------|-----------------|----------------|------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten    |                 |                 |                |                  |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten         | (19.007)        | –               | –              | (19.007)         |
| Nicht realisierter Verlust aus Inflation-Swap-Kontrakten  | –               | (3.665)         | –              | (3.665)          |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten         | –               | (3.982)         | –              | (3.982)          |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten | –               | (54.486)        | –              | (54.486)         |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                       | <b>(19.007)</b> | <b>(62.133)</b> | <b>–</b>       | <b>(81.140)</b>  |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Euro Bond Absolute Return

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|   | Stufe 1<br>EUR | Stufe 2<br>EUR    | Stufe 3<br>EUR | Insgesamt<br>EUR  |
|---|----------------|-------------------|----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                |                   |                |                   |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)       | –              | 3.996.647         | –              | 3.996.647         |
| Unternehmensanleihen                                  | –              | 41.216.156        | –              | 41.216.156        |
| Staatsanleihen  | –              | 36.582.154        | –              | 36.582.154        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –              | 1.998.238         | –              | 1.998.238         |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten      | 383.089        | –                 | –              | 383.089           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten      | –              | 6.217             | –              | 6.217             |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>383.089</b> | <b>83.799.412</b> | <b>–</b>       | <b>84.182.501</b> |

|   | Stufe 1<br>EUR  | Stufe 2<br>EUR   | Stufe 3<br>EUR | Insgesamt<br>EUR |
|---|-----------------|------------------|----------------|------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten    |                 |                  |                |                  |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten    | –               | (172.800)        | –              | (172.800)        |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten         | (27.780)        | –                | –              | (27.780)         |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten         | –               | (9.491)          | –              | (9.491)          |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten | –               | (271.500)        | –              | (271.500)        |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                       | <b>(27.780)</b> | <b>(453.791)</b> | <b>–</b>       | <b>(481.571)</b> |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|   | Stufe 1<br>EUR | Stufe 2<br>EUR    | Stufe 3<br>EUR | Insgesamt<br>EUR  |
|---|----------------|-------------------|----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte     |                |                   |                |                   |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)         | –              | 158.727           | –              | 158.727           |
| Unternehmensanleihen                                    | –              | 18.558.164        | –              | 18.558.164        |
| Staatsanleihen  | –              | 14.456.150        | –              | 14.456.150        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten   | –              | 25.383            | –              | 25.383            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten        | 47.035         | –                 | –              | 47.035            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten | –              | 26.569            | –              | 26.569            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten        | –              | 113.881           | –              | 113.881           |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                         | <b>47.035</b>  | <b>33.338.874</b> | <b>–</b>       | <b>33.385.909</b> |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

**Euro Bond Absolute Return (Fortsetzung)**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|   | Stufe 1<br>EUR   | Stufe 2<br>EUR     | Stufe 3<br>EUR | Insgesamt<br>EUR   |
|---|------------------|--------------------|----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten    |                  |                    |                |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten    | –                | (1.117.757)        | –              | (1.117.757)        |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten         | (301.831)        | –                  | –              | (301.831)          |
| Nicht realisierter Verlust aus Inflation-Swap-Kontrakten  | –                | (14.661)           | –              | (14.661)           |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten | –                | (181.087)          | –              | (181.087)          |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                       | <b>(301.831)</b> | <b>(1.313.505)</b> | <b>–</b>       | <b>(1.615.336)</b> |

**European High Yield Bond**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|   | Stufe 1<br>EUR | Stufe 2<br>EUR     | Stufe 3<br>EUR | Insgesamt<br>EUR   |
|---|----------------|--------------------|----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                |                    |                |                    |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)       | –              | 4.796.698          | –              | 4.796.698          |
| Unternehmensanleihen                                  | –              | 529.414.084        | –              | 529.414.084        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –              | 2.677.489          | –              | 2.677.489          |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>–</b>       | <b>536.888.271</b> | <b>–</b>       | <b>536.888.271</b> |

|  | Stufe 1<br>EUR | Stufe 2<br>EUR     | Stufe 3<br>EUR | Insgesamt<br>EUR   |
|--|----------------|--------------------|----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                |                    |                |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –              | (2.086.588)        | –              | (2.086.588)        |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>–</b>       | <b>(2.086.588)</b> | <b>–</b>       | <b>(2.086.588)</b> |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|  | Stufe 1<br>EUR | Stufe 2<br>EUR     | Stufe 3<br>EUR | Insgesamt<br>EUR   |
|--|----------------|--------------------|----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte        |                |                    |                |                    |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)            | –              | 2.425.341          | –              | 2.425.341          |
| Unternehmensanleihen                                       | –              | 384.433.736        | –              | 384.433.736        |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen                       | –              | 114.727            | –              | 114.727            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten      | –              | 643.091            | –              | 643.091            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten | –              | 18.355             | –              | 18.355             |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                            | <b>–</b>       | <b>387.635.250</b> | <b>–</b>       | <b>387.635.250</b> |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## European High Yield Bond (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|  | Stufe 1<br>EUR | Stufe 2<br>EUR     | Stufe 3<br>EUR | Insgesamt<br>EUR   |
|--|----------------|--------------------|----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                |                    |                |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –              | (1.281.452)        | –              | (1.281.452)        |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>–</b>       | <b>(1.281.452)</b> | <b>–</b>       | <b>(1.281.452)</b> |

## European Sustainable Equity

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|   | Stufe 1<br>EUR    | Stufe 2<br>EUR    | Stufe 3<br>EUR | Insgesamt<br>EUR   |
|---|-------------------|-------------------|----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte |                   |                   |                |                    |
| Aktien  | 89.785.394        | 57.452.765        | –              | 147.238.159        |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                     | <b>89.785.394</b> | <b>57.452.765</b> | <b>–</b>       | <b>147.238.159</b> |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|   | Stufe 1<br>EUR     | Stufe 2<br>EUR | Stufe 3<br>EUR | Insgesamt<br>EUR   |
|---|--------------------|----------------|----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte |                    |                |                |                    |
| Aktien  | 171.225.790        | –              | –              | 171.225.790        |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                     | <b>171.225.790</b> | <b>–</b>       | <b>–</b>       | <b>171.225.790</b> |

|   | Stufe 1<br>EUR | Stufe 2<br>EUR | Stufe 3<br>EUR |
|---|----------------|----------------|----------------|
| <b>Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 1</b> |                |                |                |
| Aktien                                      | 111.860.905    | (111.860.905)  | –              |

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurden bestimmte Aktien von Stufe 2 in Stufe 1 übertragen, da die Preisfindung durch einen Pricing-Anbieter erfolgte.

## Event Driven

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|--|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte        |                 |                    |                 |                    |
| Schatzwechsel  | –               | 81.352.423         | –               | 81.352.423         |
| Unternehmensanleihen                                       | –               | 195.788.600        | –               | 195.788.600        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten      | –               | 136.424            | –               | 136.424            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten | –               | 139.204            | –               | 139.204            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                            | <b>–</b>        | <b>277.416.651</b> | <b>–</b>        | <b>277.416.651</b> |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Event Driven (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$     | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$   |
|---|-----------------|---------------------|-----------------|---------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten      |                 |                     |                 |                     |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten      | –               | (10.107.971)        | –               | (10.107.971)        |
| Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten | –               | (527.124)           | –               | (527.124)           |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                         | <b>–</b>        | <b>(10.635.095)</b> | <b>–</b>        | <b>(10.635.095)</b> |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|--|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte        |                 |                    |                 |                    |
| Schatzwechsel  | –               | 115.039.719        | –               | 115.039.719        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten      | –               | 4.057.943          | –               | 4.057.943          |
| Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten | –               | 959.529            | –               | 959.529            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                            | <b>–</b>        | <b>120.057.191</b> | <b>–</b>        | <b>120.057.191</b> |

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$  | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|--|-----------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                 |                  |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –               | (155.365)        | –               | (155.365)         |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>–</b>        | <b>(155.365)</b> | <b>–</b>        | <b>(155.365)</b>  |

Global Bond

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                 |                    |                 |                    |
| Agency Bonds  | –               | 882.160            | –               | 882.160            |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)       | –               | 13.298.144         | –               | 13.298.144         |
| Unternehmensanleihen                                  | –               | 31.448.688         | –               | 31.448.688         |
| Staatsanleihen  | –               | 32.141.381         | –               | 32.141.381         |
| Mortgage-Backed Securities                            | –               | 18.149.436         | –               | 18.149.436         |
| Kommunalanleihen                                      | –               | 1.123.978          | –               | 1.123.978          |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –               | 4.327.396          | –               | 4.327.396          |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten      | 214.164         | –                  | –               | 214.164            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten      | –               | 63.983             | –               | 63.983             |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>214.164</b>  | <b>101.435.166</b> | <b>–</b>        | <b>101.649.330</b> |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Global Bond (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|  | Stufe 1<br>US\$  | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|--|------------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                  |                    |                 |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –                | (4.564.309)        | –               | (4.564.309)        |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten      | (173.617)        | –                  | –               | (173.617)          |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten      | –                | (16.224)           | –               | (16.224)           |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>(173.617)</b> | <b>(4.580.533)</b> | <b>–</b>        | <b>(4.754.150)</b> |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                 |                    |                 |                    |
| Agency Bonds  | –               | 1.146.538          | –               | 1.146.538          |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)       | –               | 10.864.506         | –               | 10.864.506         |
| Unternehmensanleihen                                  | –               | 28.855.602         | –               | 28.855.602         |
| Staatsanleihen  | –               | 42.481.574         | –               | 42.481.574         |
| Mortgage-Backed Securities                            | –               | 22.645.649         | –               | 22.645.649         |
| Kommunalanleihen                                      | –               | 1.278.776          | –               | 1.278.776          |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –               | 3.337.129          | –               | 3.337.129          |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten      | 440.690         | –                  | –               | 440.690            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten      | –               | 124.708            | –               | 124.708            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>440.690</b>  | <b>110.734.482</b> | <b>–</b>        | <b>111.175.172</b> |

|   | Stufe 1<br>US\$  | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|------------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten        |                  |                    |                 |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –                | (3.195.228)        | –               | (3.195.228)        |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten             | (622.972)        | –                  | –               | (622.972)          |
| Nicht realisierter Verlust aus Credit Default Swap-Kontrakten | –                | (72.291)           | –               | (72.291)           |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>(622.972)</b> | <b>(3.267.519)</b> | <b>–</b>        | <b>(3.890.491)</b> |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Global Diversified Income FMP – 2024\*

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                 |                    |                 |                    |
| Schatzwechsel   | –               | 18.765.889         | –               | 18.765.889         |
| Unternehmensanleihen                                  | –               | 123.463.985        | –               | 123.463.985        |
| Staatsanleihen  | –               | 1.727.993          | –               | 1.727.993          |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –               | 281.732            | –               | 281.732            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>–</b>        | <b>144.239.599</b> | <b>–</b>        | <b>144.239.599</b> |

\* Das Portfolio wurde am 28. Juni 2024 aufgelöst.

Global Equity Megatrends

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|   | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|--------------------|-----------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                    |                 |                 |                    |
| Aktien  | 493.457.264        | –               | –               | 493.457.264        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –                  | 33.919          | –               | 33.919             |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>493.457.264</b> | <b>33.919</b>   | <b>–</b>        | <b>493.491.183</b> |

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$  | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|--|-----------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                 |                  |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –               | (249.051)        | –               | (249.051)         |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>–</b>        | <b>(249.051)</b> | <b>–</b>        | <b>(249.051)</b>  |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|   | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|--------------------|-----------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                    |                 |                 |                    |
| Aktien  | 141.492.601        | –               | –               | 141.492.601        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –                  | 444             | –               | 444                |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>141.492.601</b> | <b>444</b>      | <b>–</b>        | <b>141.493.045</b> |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Global Equity Megatrends (Fortsetzung)

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|
| <b>Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 1</b> |                 |                 |                 |
| Aktien                                      | 7.576.699       | (7.576.699)     | –               |

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurde eine Aktie von Stufe 2 in Stufe 1 übertragen, da die Preisfindung durch einen Pricing-Anbieter erfolgte.

## Global Flexible Credit Income

## Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

## Zum 31. Dezember 2024

|   | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$     | Stufe 3*<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$   |
|---|--------------------|---------------------|------------------|---------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                    |                     |                  |                     |
| Aktien  | –                  | –                   | 6.584.306        | 6.584.306           |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)               | –                  | 65.219.905          | –                | 65.219.905          |
| Unternehmensanleihen  | –                  | 318.686.087         | –                | 318.686.087         |
| Staatsanleihen  | –                  | 9.614.540           | –                | 9.614.540           |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen                          | –                  | 34.604.543          | 2.901.280        | 37.505.823          |
| Investmentfonds   | –                  | 6.944               | –                | 6.944               |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –                  | 8.877.042           | –                | 8.877.042           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten              | 1.115.433          | –                   | –                | 1.115.433           |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten     | –                  | 333.841             | –                | 333.841             |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>1.115.433</b>   | <b>437.342.902</b>  | <b>9.485.586</b> | <b>447.943.921</b>  |
|   |                    |                     |                  |                     |
|   | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$     | Stufe 3*<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$   |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                    |                     |                  |                     |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –                  | (11.858.313)        | –                | (11.858.313)        |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten             | (1.308.502)        | –                   | –                | (1.308.502)         |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>(1.308.502)</b> | <b>(11.858.313)</b> | <b>–</b>         | <b>(13.166.815)</b> |

\* Mittelfristige Schuldverschreibungen der Stufe 3 wurden basierend auf von Händlern verfügbaren Einzelnotierungen bewertet. Alle anderen Anlagen der Stufe 3 wurden in Übereinstimmung mit den von den Direktoren genehmigten Verfahren bewertet.

## Quantitative Informationen zu Zeitwertbewertungen der Stufe 3:

| Anlagegattung | Beizulegender<br>Zeitwert zum<br>31. Dezember 2024<br>USD | Bewertungsansatz<br>der Stufe | Maßgebliche(r) nicht<br>beobachtbare(r)<br>Parameter | Wert/Spanne<br>des/der<br>Parameter | Gewichteter<br>Durchschnitt <sup>(a)</sup> | Effekt steigender Parameter<br>auf die Bewertung <sup>(b)</sup> |
|---------------|---|-------------------------------|--|-------------------------------------|--|---|
| Vorzugsaktien | 6.584.306   | Ertragsansatz                 | Credit Yield Spread                                  | 3,15 %                              | 3,15 %                                     | Rückgang  |

<sup>(a)</sup> Der in vorstehender Tabelle angegebene gewichtete Durchschnitt wurde nach dem relativen beizulegenden Zeitwert gewichtet.

<sup>(b)</sup> Stellt die erwartete Richtungsänderung im beizulegenden Zeitwert der Anlagen der Stufe 3 dar, die sich aus einem Anstieg oder einem Rückgang des entsprechenden Parameters ergeben würde. Maßgebliche Veränderungen dieser Parameter könnten zu deutlich höheren oder deutlich niedrigeren Zeitwertbewertungen führen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Global Flexible Credit Income (Fortsetzung)

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|
| <b>Übertragungen von Stufe 3 in Stufe 2</b> |                 |                 |                 |
| Unternehmensanleihen                        | –               | 1.247.160       | (1.247.160)     |
| <b>Übertragungen von Stufe 1 in Stufe 2</b> |                 |                 |                 |
| Investmentfonds                             | (6.944)         | 6.944           | –               |

Im am 31. Dezember 2024 beendeten Geschäftsjahr wurde eine Unternehmensanleihe von Stufe 3 in Stufe 2 übertragen, da die für die Bewertung verfügbaren Dealerquotierungen gestiegen sind.

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024 wurde ein Investmentfonds von Stufe 1 in Stufe 2 übertragen, da die für die Bewertung verfügbaren Dealerquotierungen zurückgegangen sind.

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|  | Stufe 1<br>US\$  | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3*<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|--|------------------|--------------------|------------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte        |                  |                    |                  |                    |
| Aktien   | –                | –                  | 6.022.083        | 6.022.083          |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)            | –                | 23.118.219         | –                | 23.118.219         |
| Unternehmensanleihen                                       | –                | 295.514.545        | 758.917          | 296.273.462        |
| Staatsanleihen   | –                | 15.379.748         | –                | 15.379.748         |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen                       | –                | 14.359.621         | 746.253          | 15.105.874         |
| Investmentfonds  | 66.832           | –                  | –                | 66.832             |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten      | –                | 8.130.820          | –                | 8.130.820          |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten           | 3.733.739        | –                  | –                | 3.733.739          |
| Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten | –                | 268.263            | –                | 268.263            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                            | <b>3.800.571</b> | <b>356.771.216</b> | <b>7.527.253</b> | <b>368.099.040</b> |

|  | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3*<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|--|--------------------|--------------------|------------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                    |                    |                  |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –                  | (3.447.658)        | –                | (3.447.658)        |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten      | (5.173.223)        | –                  | –                | (5.173.223)        |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>(5.173.223)</b> | <b>(3.447.658)</b> | <b>–</b>         | <b>(8.620.881)</b> |

\* Eine mittelfristige Schuldverschreibung der Stufe 3 wurde basierend auf einer von einem Händler verfügbaren Einzelnotierung bewertet. Das Portfolio hat keinen Zugang zu nicht beobachtbaren Parametern und kann daher derartige Parameter, die bei der Erstellung dieser Gleichung eingesetzt werden, nicht offenlegen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Global Flexible Credit Income (Fortsetzung)

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|
| <b>Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 3</b> |                 |                 |                 |
| Unternehmensanleihe                         | –               | (247.792)       | 247.792         |

Zum Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurde eine Unternehmensanleihe von Stufe 2 in Stufe 3 übertragen, da von den Direktoren genehmigten Preisfindungsverfahren verwendet werden.

## Global High Yield Engagement

## Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

## Zum 31. Dezember 2024

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$     | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$   |
|---|-----------------|---------------------|-----------------|---------------------|
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte</b>    |                 |                     |                 |                     |
| Unternehmensanleihen  | –               | 584.788.441         | –               | 584.788.441         |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen                          | –               | 6.832.101           | –               | 6.832.101           |
| Pensionsgeschäfte   | –               | 15.500.000          | –               | 15.500.000          |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten         | –               | 15.450.103          | –               | 15.450.103          |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                               | <b>–</b>        | <b>622.570.645</b>  | <b>–</b>        | <b>622.570.645</b>  |
| <b>Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten</b> |                 |                     |                 |                     |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                                  | –               | (999.796)           | –               | (999.796)           |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –               | (17.319.842)        | –               | (17.319.842)        |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten             | (69.709)        | –                   | –               | (69.709)            |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>(69.709)</b> | <b>(18.319.638)</b> | <b>–</b>        | <b>(18.389.347)</b> |
| <b>Übertragungen von Stufe 3 in Stufe 2</b>                   |                 |                     |                 |                     |
| Unternehmensanleihen  | –               | 908.020             | (908.020)       |                     |

Im am 31. Dezember 2024 beendeten Geschäftsjahr wurde eine Unternehmensanleihe von Stufe 3 in Stufe 2 übertragen, da die für die Bewertung verfügbaren Dealerquotierungen gestiegen sind.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Global High Yield Engagement (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3*<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|-----------------|--------------------|------------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                 |                    |                  |                    |
| Unternehmensanleihen                                  | –               | 530.465.171        | 2.034.310        | 532.499.481        |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen                  | –               | 4.933              | –                | 4.933              |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –               | 11.935.674         | –                | 11.935.674         |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>–</b>        | <b>542.405.778</b> | <b>2.034.310</b> | <b>544.440.088</b> |

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3*<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|--|-----------------|--------------------|------------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                 |                    |                  |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –               | (6.738.234)        | –                | (6.738.234)        |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>–</b>        | <b>(6.738.234)</b> | <b>–</b>         | <b>(6.738.234)</b> |

\* Unternehmensanleihen der Stufe 3 wurden in Übereinstimmung mit den von den Direktoren genehmigten Verfahren bewertet.

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|
| <b>Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 3</b> |                 |                 |                 |
| Unternehmensanleihen                        | –               | (1.136.259)     | 1.136.259       |
| <b>Übertragungen von Stufe 3 in Stufe 2</b> |                 |                 |                 |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen        | –               | 4.933           | (4.933)         |

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurden bestimmte Unternehmensanleihen von Stufe 2 in Stufe 3 übertragen, da von den Direktoren genehmigten Preisfindungsverfahren verwendet werden.

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurden mittelfristige Schuldverschreibungen von Stufe 3 in Stufe 2 übertragen, da diese die von den Direktoren genehmigten Bewertungsverfahren nicht mehr verwenden.

Global Investment Grade Credit

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                 |                    |                 |                    |
| Unternehmensanleihen                                  | –               | 172.176.706        | –               | 172.176.706        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –               | 3.851.457          | –               | 3.851.457          |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>–</b>        | <b>176.028.163</b> | <b>–</b>        | <b>176.028.163</b> |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Global Investment Grade Credit (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|--|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                 |                    |                 |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –               | (3.686.902)        | –               | (3.686.902)        |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>–</b>        | <b>(3.686.902)</b> | <b>–</b>        | <b>(3.686.902)</b> |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$   | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-----------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                 |                   |                 |                   |
| Unternehmensanleihen                                  | –               | 81.376.321        | –               | 81.376.321        |
| Staatsanleihen  | –               | 2.082.454         | –               | 2.082.454         |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –               | 1.115             | –               | 1.115             |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>–</b>        | <b>83.459.890</b> | <b>–</b>        | <b>83.459.890</b> |

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|--|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                 |                    |                 |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –               | (1.107.450)        | –               | (1.107.450)        |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>–</b>        | <b>(1.107.450)</b> | <b>–</b>        | <b>(1.107.450)</b> |

## Global Opportunistic Bond

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$   | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-----------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte       |                 |                   |                 |                   |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)           | –               | 354.846           | –               | 354.846           |
| Unternehmensanleihen                                      | –               | 26.885.560        | –               | 26.885.560        |
| Staatsanleihen  | –               | 20.058.262        | –               | 20.058.262        |
| Mortgage-Backed Securities                                | –               | 11.517.944        | –               | 11.517.944        |
| Investmentfonds   | –               | 2.199             | –               | 2.199             |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten     | –               | 6.280.307         | –               | 6.280.307         |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten          | 159.212         | –                 | –               | 159.212           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten          | –               | 102.409           | –               | 102.409           |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten | –               | 160.073           | –               | 160.073           |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                           | <b>159.212</b>  | <b>65.361.600</b> | <b>–</b>        | <b>65.520.812</b> |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Global Opportunistic Bond (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|   | Stufe 1<br>US\$  | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|------------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten    |                  |                    |                 |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten    | –                | (3.105.825)        | –               | (3.105.825)        |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten         | (313.243)        | –                  | –               | (313.243)          |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten | –                | (858.585)          | –               | (858.585)          |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten         | –                | (28.308)           | –               | (28.308)           |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                       | <b>(313.243)</b> | <b>(3.992.718)</b> | <b>–</b>        | <b>(4.305.961)</b> |

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|
| <b>Übertragungen von Stufe 1 in Stufe 2</b> |                 |                 |                 |
| Investmentfonds                             | (2.199)         | 2.199           | –               |

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024 wurde ein Investmentfonds von Stufe 1 in Stufe 2 übertragen, da die für die Bewertung verfügbaren Dealerquotierungen zurückgegangen sind.

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$   | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-----------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte       |                 |                   |                 |                   |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)           | –               | 1.817.743         | –               | 1.817.743         |
| Unternehmensanleihen                                      | –               | 27.412.055        | –               | 27.412.055        |
| Staatsanleihen  | –               | 21.133.383        | –               | 21.133.383        |
| Mortgage-Backed Securities                                | –               | 14.565.802        | –               | 14.565.802        |
| Investmentfonds   | 21.165          | –                 | –               | 21.165            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten     | –               | 4.673.609         | –               | 4.673.609         |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten          | 839.044         | –                 | –               | 839.044           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten          | –               | 76                | –               | 76                |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten | –               | 193.716           | –               | 193.716           |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                           | <b>860.209</b>  | <b>69.796.384</b> | <b>–</b>        | <b>70.656.593</b> |

|   | Stufe 1<br>US\$  | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|------------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten        |                  |                    |                 |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten        | –                | (6.577.836)        | –               | (6.577.836)        |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten             | (356.573)        | –                  | –               | (356.573)          |
| Nicht realisierter Verlust aus Credit Default Swap-Kontrakten | –                | (821.571)          | –               | (821.571)          |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten             | –                | (27)               | –               | (27)               |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                           | <b>(356.573)</b> | <b>(7.399.434)</b> | <b>–</b>        | <b>(7.756.007)</b> |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Global Real Estate Securities\*

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                 |                 |                 |                   |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –               | 7.820           | –               | 7.820             |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>–</b>        | <b>7.820</b>    | <b>–</b>        | <b>7.820</b>      |

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|--|-----------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                 |                 |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –               | (65.379)        | –               | (65.379)          |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>–</b>        | <b>(65.379)</b> | <b>–</b>        | <b>(65.379)</b>   |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|   | Stufe 1<br>US\$   | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-------------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                   |                 |                 |                   |
| Aktien  | 3.015.990         | –               | –               | 3.015.990         |
| Immobilienaktiengesellschaften                        | 17.071.668        | –               | –               | 17.071.668        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –                 | 422.478         | –               | 422.478           |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>20.087.658</b> | <b>422.478</b>  | <b>–</b>        | <b>20.510.136</b> |

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$  | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|--|-----------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                 |                  |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –               | (250.684)        | –               | (250.684)         |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>–</b>        | <b>(250.684)</b> | <b>–</b>        | <b>(250.684)</b>  |

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|
| <b>Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 1</b> |                 |                 |                 |
| Aktien                                      | 157.095         | (157.095)       | –               |
| Immobilienaktiengesellschaften              | 1.198.728       | (1.198.728)     | –               |

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurden eine Aktie und eine Immobilienaktiengesellschaft von Stufe 2 in Stufe 1 übertragen, da die Preisfindung durch einen Pricing-Anbieter erfolgte.

\* Das Portfolio wurde am 31. Dezember 2024 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Global Sustainable Equity

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|   | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$   | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|--------------------|-------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte |                    |                   |                 |                    |
| Aktien  | 119.095.310        | 20.540.520        | –               | 139.635.830        |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                     | <b>119.095.310</b> | <b>20.540.520</b> | <b>–</b>        | <b>139.635.830</b> |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|   | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|--------------------|-----------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte |                    |                 |                 |                    |
| Aktien  | 153.603.419        | –               | –               | 153.603.419        |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                     | <b>153.603.419</b> | <b>–</b>        | <b>–</b>        | <b>153.603.419</b> |

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|
| <b>Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 1</b> |                 |                 |                 |
| Aktien                                      | 34.643.299      | (34.643.299)    | –               |

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurden bestimmte Aktien von Stufe 2 in Stufe 1 übertragen, da die Preisfindung durch einen Pricing-Anbieter erfolgte.

Global Value

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|   | Stufe 1<br>US\$   | Stufe 2<br>US\$  | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-------------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                   |                  |                 |                   |
| Aktien  | 40.166.984        | 5.708.575        | –               | 45.875.559        |
| Immobilienaktiengesellschaften                        | 791.293           | –                | –               | 791.293           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –                 | 77.347           | –               | 77.347            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>40.958.277</b> | <b>5.785.922</b> | <b>–</b>        | <b>46.744.199</b> |

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$  | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|--|-----------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                 |                  |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –               | (106.217)        | –               | (106.217)         |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>–</b>        | <b>(106.217)</b> | <b>–</b>        | <b>(106.217)</b>  |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Global Value (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|   | Stufe 1<br>US\$   | Stufe 2<br>US\$  | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-------------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                   |                  |                 |                   |
| Aktien  | 52.447.814        | 1.361.257        | –               | 53.809.071        |
| Immobilienaktiengesellschaften                        | 1.116.404         | –                | –               | 1.116.404         |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –                 | 66.448           | –               | 66.448            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>53.564.218</b> | <b>1.427.705</b> | <b>–</b>        | <b>54.991.923</b> |

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|--|-----------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                 |                 |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –               | (46.897)        | –               | (46.897)          |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>–</b>        | <b>(46.897)</b> | <b>–</b>        | <b>(46.897)</b>   |

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|
| <b>Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 1</b> |                 |                 |                 |
| Aktien                                      | 5.120.024       | (5.120.024)     | –               |
| Immobilienaktiengesellschaften              | 87.109          | (87.109)        | –               |

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurden bestimmte Aktien und eine Immobilienaktiengesellschaft von Stufe 2 in Stufe 1 übertragen, da die Preisfindung durch einen Pricing-Anbieter erfolgte.

## High Yield Bond

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$      | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$    |
|---|-----------------|----------------------|-----------------|----------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                 |                      |                 |                      |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)       | –               | 29.468.224           | –               | 29.468.224           |
| Unternehmensanleihen                                  | –               | 1.753.492.450        | –               | 1.753.492.450        |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen                  | –               | 65.626.148           | –               | 65.626.148           |
| Pensionsgeschäfte                                     | –               | 66.000.000           | –               | 66.000.000           |
| Investmentfonds                                       | –               | 375.146              | –               | 375.146              |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –               | 20.418.669           | –               | 20.418.669           |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>–</b>        | <b>1.935.380.637</b> | <b>–</b>        | <b>1.935.380.637</b> |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

High Yield Bond (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$     | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$   |
|--|-----------------|---------------------|-----------------|---------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                 |                     |                 |                     |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                           | –               | (3.063.764)         | –               | (3.063.764)         |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –               | (61.211.609)        | –               | (61.211.609)        |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>–</b>        | <b>(64.275.373)</b> | <b>–</b>        | <b>(64.275.373)</b> |
|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$     | Stufe 3<br>US\$ |                     |
| <b>Übertragungen von Stufe 3 in Stufe 2</b>            |                 |                     |                 |                     |
| Unternehmensanleihen                                   | –               | 4.882.361           | (4.882.361)     |                     |
| <b>Übertragungen von Stufe 1 in Stufe 2</b>            |                 |                     |                 |                     |
| Investmentfonds  | (375.146)       | 375.146             | –               |                     |

Im am 31. Dezember 2024 beendeten Geschäftsjahr wurde eine Unternehmensanleihe von Stufe 3 in Stufe 2 übertragen, da die für die Bewertung verfügbaren Dealerquotierungen gestiegen sind.

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024 wurde ein Investmentfonds von Stufe 1 in Stufe 2 übertragen, da die für die Bewertung verfügbaren Dealerquotierungen zurückgegangen sind.

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|  | Stufe 1<br>US\$  | Stufe 2<br>US\$      | Stufe 3*<br>US\$  | Insgesamt<br>US\$    |
|--|------------------|----------------------|-------------------|----------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte    |                  |                      |                   |                      |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)        | –                | 10.897.982           | –                 | 10.897.982           |
| Unternehmensanleihen                                   | –                | 1.984.515.926        | 14.661.425        | 1.999.177.351        |
| Staatsanleihen   | –                | 36.225.768           | –                 | 36.225.768           |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen                   | –                | 43.084.058           | –                 | 43.084.058           |
| Investmentfonds  | 3.611.285        | –                    | –                 | 3.611.285            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten  | –                | 40.709.223           | –                 | 40.709.223           |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                        | <b>3.611.285</b> | <b>2.115.432.957</b> | <b>14.661.425</b> | <b>2.133.705.667</b> |
|  | Stufe 1<br>US\$  | Stufe 2<br>US\$      | Stufe 3*<br>US\$  | Insgesamt<br>US\$    |
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                  |                      |                   |                      |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –                | (15.391.406)         | –                 | (15.391.406)         |
| Nicht realisierter Verlust aus Return--Swap-Kontrakten | –                | (51.928)             | –                 | (51.928)             |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>–</b>         | <b>(15.443.334)</b>  | <b>–</b>          | <b>(15.443.334)</b>  |

\* Unternehmensanleihen der Stufe 3 wurden in Übereinstimmung mit den von den Direktoren genehmigten Verfahren bewertet.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## High Yield Bond (Fortsetzung)

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|
| <b>Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 3</b> |                 |                 |                 |
| Unternehmensanleihen                        | –               | (7.195.550)     | 7.195.550       |
| <b>Übertragungen von Stufe 3 in Stufe 2</b> |                 |                 |                 |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen        | –               | 4.940           | (4.940)         |

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurden bestimmte Unternehmensanleihen von Stufe 2 in Stufe 3 übertragen, da von den Direktoren genehmigten Preisfindungsverfahren verwendet werden.

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurde ein Laufzeitkredit von Stufe 3 in Stufe 2 übertragen, da die für die Bewertung verfügbaren Dealerquotierungen gestiegen sind.

## InnovAsia

## Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

## Zum 31. Dezember 2024

|  | Stufe 1<br>US\$  | Stufe 2<br>US\$  | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|--|------------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte    |                  |                  |                 |                   |
| Aktien   | 8.363.961        | 5.820.328        | –               | 14.184.289        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten  | –                | 46.906           | –               | 46.906            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                        | <b>8.363.961</b> | <b>5.867.234</b> | <b>–</b>        | <b>14.231.195</b> |
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                  |                  |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –                | (452.531)        | –               | (452.531)         |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>–</b>         | <b>(452.531)</b> | <b>–</b>        | <b>(452.531)</b>  |

## Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

## Zum 31. Dezember 2023

|   | Stufe 1<br>US\$   | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-------------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                   |                 |                 |                   |
| Aktien  | 22.524.887        | –               | –               | 22.524.887        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –                 | 299.135         | –               | 299.135           |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>22.524.887</b> | <b>299.135</b>  | <b>–</b>        | <b>22.824.022</b> |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

InnovAsia (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|--|-----------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                 |                 |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –               | (60.136)        | –               | (60.136)          |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>–</b>        | <b>(60.136)</b> | <b>–</b>        | <b>(60.136)</b>   |

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ |  |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|--|
| <b>Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 1</b> |                 |                 |                 |  |
| Aktien                                      | 1.003.652       | (1.003.652)     | –               |  |

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurde eine Aktie von Stufe 2 in Stufe 1 übertragen, da die Preisfindung durch einen Pricing-Anbieter erfolgte.

Japan Equity Engagement

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|   | Stufe 1<br>JPY | Stufe 2<br>JPY        | Stufe 3<br>JPY | Insgesamt<br>JPY      |
|---|----------------|-----------------------|----------------|-----------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                |                       |                |                       |
| Aktien  | –              | 24.001.431.600        | –              | 24.001.431.600        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –              | 860.770               | –              | 860.770               |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>–</b>       | <b>24.002.292.370</b> | <b>–</b>       | <b>24.002.292.370</b> |

|  | Stufe 1<br>JPY | Stufe 2<br>JPY   | Stufe 3<br>JPY | Insgesamt<br>JPY |
|--|----------------|------------------|----------------|------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                |                  |                |                  |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –              | (132.669)        | –              | (132.669)        |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>–</b>       | <b>(132.669)</b> | <b>–</b>       | <b>(132.669)</b> |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|   | Stufe 1<br>JPY        | Stufe 2<br>JPY     | Stufe 3<br>JPY | Insgesamt<br>JPY      |
|---|-----------------------|--------------------|----------------|-----------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                       |                    |                |                       |
| Aktien  | 15.961.893.000        | –                  | –              | 15.961.893.000        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –                     | 128.484.079        | –              | 128.484.079           |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>15.961.893.000</b> | <b>128.484.079</b> | <b>–</b>       | <b>16.090.377.079</b> |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Japan Equity Engagement (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|  | Stufe 1<br>JPY | Stufe 2<br>JPY      | Stufe 3<br>JPY | Insgesamt<br>JPY    |
|--|----------------|---------------------|----------------|---------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                |                     |                |                     |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –              | (42.002.252)        | –              | (42.002.252)        |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>–</b>       | <b>(42.002.252)</b> | <b>–</b>       | <b>(42.002.252)</b> |

## Macro Opportunities FX\*

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|  | Stufe 1<br>EUR | Stufe 2<br>EUR     | Stufe 3<br>EUR | Insgesamt<br>EUR   |
|--|----------------|--------------------|----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte    |                |                    |                |                    |
| Schatzwechsel  | –              | 2.407.376          | –              | 2.407.376          |
| Staatsanleihen   | –              | 347.166            | –              | 347.166            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten  | –              | 4.627.295          | –              | 4.627.295          |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                        | <b>–</b>       | <b>7.381.837</b>   | <b>–</b>       | <b>7.381.837</b>   |
|  |                |                    |                |                    |
|  | Stufe 1<br>EUR | Stufe 2<br>EUR     | Stufe 3<br>EUR | Insgesamt<br>EUR   |
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                |                    |                |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –              | (4.613.695)        | –              | (4.613.695)        |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>–</b>       | <b>(4.613.695)</b> | <b>–</b>       | <b>(4.613.695)</b> |

\* Das Portfolio wurde am 8. Februar 2024 aufgelöst.

## Next Generation Connectivity

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|   | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$    |
|---|--------------------|--------------------|-----------------|----------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                    |                    |                 |                      |
| Aktien  | 874.601.569        | 165.328.171        | –               | 1.039.929.740        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –                  | 2.683.376          | –               | 2.683.376            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>874.601.569</b> | <b>168.011.547</b> | <b>–</b>        | <b>1.042.613.116</b> |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Next Generation Connectivity (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$     | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$   |
|--|-----------------|---------------------|-----------------|---------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                 |                     |                 |                     |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –               | (12.934.421)        | –               | (12.934.421)        |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>–</b>        | <b>(12.934.421)</b> | <b>–</b>        | <b>(12.934.421)</b> |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|   | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$   | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|--------------------|-------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                    |                   |                 |                    |
| Aktien  | 963.698.691        | 26.816.617        | –               | 990.515.308        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –                  | 6.342.222         | –               | 6.342.222          |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>963.698.691</b> | <b>33.158.839</b> | <b>–</b>        | <b>996.857.530</b> |

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|--|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                 |                    |                 |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –               | (1.033.321)        | –               | (1.033.321)        |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>–</b>        | <b>(1.033.321)</b> | <b>–</b>        | <b>(1.033.321)</b> |

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|
| <b>Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 1</b> |                 |                 |                 |
| Aktien                                      | 33.229.577      | (33.229.577)    | –               |

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurde eine Aktie von Stufe 2 in Stufe 1 übertragen, da die Preisfindung durch einen Pricing-Anbieter erfolgte.

Next Generation Mobility

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|   | Stufe 1<br>US\$   | Stufe 2<br>US\$   | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|-------------------|-------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                   |                   |                 |                    |
| Aktien  | 92.834.673        | 28.602.887        | –               | 121.437.560        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –                 | 1.574             | –               | 1.574              |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>92.834.673</b> | <b>28.604.461</b> | <b>–</b>        | <b>121.439.134</b> |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Next Generation Mobility (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|--|-----------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                 |                 |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –               | (12.261)        | –               | (12.261)          |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>–</b>        | <b>(12.261)</b> | <b>–</b>        | <b>(12.261)</b>   |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|   | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$  | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|--------------------|------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                    |                  |                 |                    |
| Aktien  | 149.804.841        | 1.389.795        | –               | 151.194.636        |
| Immobilienaktiengesellschaften                        | 1.619.728          | –                | –               | 1.619.728          |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –                  | 20.789           | –               | 20.789             |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>151.424.569</b> | <b>1.410.584</b> | <b>–</b>        | <b>152.835.153</b> |

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|--|-----------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                 |                 |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –               | (10.365)        | –               | (10.365)          |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>–</b>        | <b>(10.365)</b> | <b>–</b>        | <b>(10.365)</b>   |

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|
| <b>Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 1</b> |                 |                 |                 |
| Aktien                                      | 10.502.393      | (10.502.393)    | –               |

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurden bestimmte Aktien von Stufe 2 in Stufe 1 übertragen, da die Preisfindung durch einen Pricing-Anbieter erfolgte.

## Next Generation Space Economy

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|   | Stufe 1<br>US\$   | Stufe 2<br>US\$  | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-------------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte |                   |                  |                 |                   |
| Aktien  | 47.927.428        | 7.275.311        | –               | 55.202.739        |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                     | <b>47.927.428</b> | <b>7.275.311</b> | <b>–</b>        | <b>55.202.739</b> |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Next Generation Space Economy (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|   | Stufe 1<br>US\$   | Stufe 2<br>US\$  | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-------------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte |                   |                  |                 |                   |
| Aktien  | 17.658.423        | 1.016.293        | –               | 18.674.716        |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                     | <b>17.658.423</b> | <b>1.016.293</b> | <b>–</b>        | <b>18.674.716</b> |

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ |  |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|--|
| <b>Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 1</b> |                 |                 |                 |  |
| Aktien                                      | 2.205.585       | (2.205.585)     | –               |  |

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurden bestimmte Aktien von Stufe 2 in Stufe 1 übertragen, da die Preisfindung durch einen Pricing-Anbieter erfolgte.

Short Duration Emerging Market Debt

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$      | Stufe 3*<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$    |
|---|-----------------|----------------------|------------------|----------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                 |                      |                  |                      |
| Unternehmensanleihen                                  | –               | 2.430.071.401        | 500.000          | 2.430.571.401        |
| Staatsanleihen  | –               | 1.320.118.061        | –                | 1.320.118.061        |
| Pensionsgeschäfte                                     | –               | 9.000.000            | –                | 9.000.000            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –               | 9.042.854            | –                | 9.042.854            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>–</b>        | <b>3.768.232.316</b> | <b>500.000</b>   | <b>3.768.732.316</b> |

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$     | Stufe 3*<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$   |
|--|-----------------|---------------------|------------------|---------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                 |                     |                  |                     |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –               | (68.781.224)        | –                | (68.781.224)        |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>–</b>        | <b>(68.781.224)</b> | <b>–</b>         | <b>(68.781.224)</b> |

\* Unternehmensanleihen der Stufe 3 wurden in Übereinstimmung mit den von den Direktoren genehmigten Verfahren bewertet. Diese Anlagen hatten keinen wesentlichen Einfluss auf das Nettovermögen des Portfolios, weshalb bei der Bewertungsformel keine Angaben zu nicht beobachtbaren Parametern erfolgen.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$      | Stufe 3*<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$    |
|--|-----------------|----------------------|------------------|----------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte    |                 |                      |                  |                      |
| Schatzwechsel  | –               | 53.894.704           | –                | 53.894.704           |
| Unternehmensanleihen                                   | –               | 2.405.987.373        | 500.000          | 2.406.487.373        |
| Staatsanleihen   | –               | 1.307.631.941        | –                | 1.307.631.941        |
| Investmentfonds  | –               | 49.810.000           | –                | 49.810.000           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten  | –               | 64.552.046           | –                | 64.552.046           |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                        | <b>–</b>        | <b>3.881.876.064</b> | <b>500.000</b>   | <b>3.882.376.064</b> |
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                 |                      |                  |                      |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –               | (9.131.675)          | –                | (9.131.675)          |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>–</b>        | <b>(9.131.675)</b>   | <b>–</b>         | <b>(9.131.675)</b>   |

\* Unternehmensanleihen der Stufe 3 wurden in Übereinstimmung mit den von den Direktoren genehmigten Verfahren bewertet.

## Short Duration Euro Bond

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|   | Stufe 1<br>EUR   | Stufe 2<br>EUR       | Stufe 3<br>EUR | Insgesamt<br>EUR     |
|---|------------------|----------------------|----------------|----------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                  |                      |                |                      |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)       | –                | 276.388.490          | –              | 276.388.490          |
| Unternehmensanleihen                                  | –                | 1.372.639.876        | –              | 1.372.639.876        |
| Staatsanleihen  | –                | 93.624.597           | –              | 93.624.597           |
| Investmentfonds                                       | –                | 33.954.800           | –              | 33.954.800           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –                | 1.543.824            | –              | 1.543.824            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten      | 2.541.820        | –                    | –              | 2.541.820            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>2.541.820</b> | <b>1.778.151.587</b> | <b>–</b>       | <b>1.780.693.407</b> |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Short Duration Euro Bond (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|   | Stufe 1<br>EUR   | Stufe 2<br>EUR     | Stufe 3<br>EUR | Insgesamt<br>EUR   |
|---|------------------|--------------------|----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten    |                  |                    |                |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten    | –                | (1.449.270)        | –              | (1.449.270)        |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten         | (996.740)        | –                  | –              | (996.740)          |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten | –                | (2.448.213)        | –              | (2.448.213)        |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten         | –                | (97.029)           | –              | (97.029)           |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                       | <b>(996.740)</b> | <b>(3.994.512)</b> | <b>–</b>       | <b>(4.991.252)</b> |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|   | Stufe 1<br>EUR | Stufe 2<br>EUR     | Stufe 3<br>EUR | Insgesamt<br>EUR   |
|---|----------------|--------------------|----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte     |                |                    |                |                    |
| Schatzwechsel   | –              | 8.960.964          | –              | 8.960.964          |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)         | –              | 90.687.160         | –              | 90.687.160         |
| Unternehmensanleihen                                    | –              | 789.167.617        | –              | 789.167.617        |
| Staatsanleihen  | –              | 75.386.047         | –              | 75.386.047         |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten   | –              | 235.719            | –              | 235.719            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten        | 509.420        | –                  | –              | 509.420            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten | –              | 531.378            | –              | 531.378            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                         | <b>509.420</b> | <b>964.968.885</b> | <b>–</b>       | <b>965.478.305</b> |

|   | Stufe 1<br>EUR     | Stufe 2<br>EUR     | Stufe 3<br>EUR | Insgesamt<br>EUR   |
|---|--------------------|--------------------|----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten    |                    |                    |                |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten    | –                  | (2.512.078)        | –              | (2.512.078)        |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten         | (2.783.686)        | –                  | –              | (2.783.686)        |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten | –                  | (2.179.454)        | –              | (2.179.454)        |
| Nicht realisierter Verlust aus Inflation-Swap-Kontrakten  | –                  | (293.227)          | –              | (293.227)          |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten         | –                  | (248.422)          | –              | (248.422)          |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                       | <b>(2.783.686)</b> | <b>(5.233.181)</b> | <b>–</b>       | <b>(8.016.867)</b> |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Short Duration High Yield Engagement

## Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$     | Stufe 3*<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$   |
|--|-----------------|---------------------|------------------|---------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte    |                 |                     |                  |                     |
| Unternehmensanleihen                                   | –               | 490.955.600         | –                | 490.955.600         |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen                   | –               | 42.586.493          | 397.730          | 42.984.223          |
| Pensionsgeschäfte                                      | –               | 16.000.000          | –                | 16.000.000          |
| Investmentfonds  | –               | 5.111.662           | –                | 5.111.662           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten  | –               | 5.924.937           | –                | 5.924.937           |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                        | <b>–</b>        | <b>560.578.692</b>  | <b>397.730</b>   | <b>560.976.422</b>  |
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                 |                     |                  |                     |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –               | (22.583.571)        | –                | (22.583.571)        |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>–</b>        | <b>(22.583.571)</b> | <b>–</b>         | <b>(22.583.571)</b> |

\* Eine mittelfristige Schuldverschreibung der Stufe 3 wurde basierend auf einer von einem Händler verfügbaren Einzelnotierung bewertet.

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|
| <b>Übertragungen von Stufe 1 in Stufe 2</b> |                 |                 |                 |
| Investmentfonds                             | (25.039)        | 25.039          | –               |

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024 wurde ein Investmentfonds von Stufe 1 in Stufe 2 übertragen, da die für die Bewertung verfügbaren Dealerquotierungen zurückgegangen sind.

## Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3*<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|-----------------|--------------------|------------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                 |                    |                  |                    |
| Unternehmensanleihen                                  | –               | 659.326.845        | 4.686.892        | 664.013.737        |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen                  | –               | 12.793.556         | 626.491          | 13.420.047         |
| Investmentfonds                                       | 241.028         | –                  | –                | 241.028            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –               | 15.254.920         | –                | 15.254.920         |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>241.028</b>  | <b>687.375.321</b> | <b>5.313.383</b> | <b>692.929.732</b> |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Short Duration High Yield Engagement (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3*<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|--|-----------------|--------------------|------------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                 |                    |                  |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –               | (3.114.085)        | –                | (3.114.085)        |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>–</b>        | <b>(3.114.085)</b> | <b>–</b>         | <b>(3.114.085)</b> |

\*Eine Unternehmensanleihe der Stufe 3 wurde in Übereinstimmung mit den von den Direktoren genehmigten Verfahren bewertet. Eine mittelfristige Schuldverschreibung der Stufe 3 wurde basierend auf einer von einem Händler verfügbaren Einzelnotierung bewertet. Das Portfolio hat keinen Zugang zu nicht beobachtbaren Parametern und kann daher derartige Parameter, die bei der Erstellung dieser Gleichung eingesetzt werden, nicht offenlegen.

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|
| <b>Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 3</b> |                 |                 |                 |
| Unternehmensanleihen                        | –               | (900.513)       | 900.513         |

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurde eine Unternehmensanleihe von Stufe 2 in Stufe 3 übertragen, da von den Direktoren genehmigten Preisfindungsverfahren verwendet werden.

Strategic Income

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|   | Stufe 1<br>US\$  | Stufe 2<br>US\$      | Stufe 3*<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$    |
|---|------------------|----------------------|------------------|----------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte       |                  |                      |                  |                      |
| Agency Bonds  | –                | 739.410              | –                | 739.410              |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)           | –                | 1.185.508.405        | –                | 1.185.508.405        |
| Unternehmensanleihen                                      | –                | 1.159.321.497        | –                | 1.159.321.497        |
| Staatsanleihen  | –                | 317.221.334          | –                | 317.221.334          |
| Mortgage-Backed Securities                                | –                | 1.530.842.706        | –                | 1.530.842.706        |
| Kommunalanleihen  | –                | 12.931.828           | –                | 12.931.828           |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen                      | –                | 248.195.876          | 5.538.924        | 253.734.800          |
| Pensionsgeschäfte   | –                | 82.500.000           | –                | 82.500.000           |
| Investmentfonds   | –                | 56.497.686           | –                | 56.497.686           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten     | –                | 39.661.388           | –                | 39.661.388           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten          | 7.236.409        | –                    | –                | 7.236.409            |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten | –                | 3.617.045            | –                | 3.617.045            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten   | –                | 6.683                | –                | 6.683                |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                           | <b>7.236.409</b> | <b>4.637.043.858</b> | <b>5.538.924</b> | <b>4.649.819.191</b> |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Strategic Income (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|  | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$     | Stufe 3*<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$   |
|--|--------------------|---------------------|------------------|---------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten   |                    |                     |                  |                     |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten   | –                  | (78.113.648)        | –                | (78.113.648)        |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten        | (4.577.032)        | –                   | –                | (4.577.032)         |
| Nicht realisierter Verlust aus Inflation-Swap-Kontrakten | –                  | (4.523)             | –                | (4.523)             |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten        | –                  | (764.076)           | –                | (764.076)           |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                      | <b>(4.577.032)</b> | <b>(78.882.247)</b> | <b>–</b>         | <b>(83.459.279)</b> |

\* Eine mittelfristige Schuldverschreibung der Stufe 3 wurde basierend auf einer von einem Händler verfügbaren Einzelnotierung bewertet.

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|
| <b>Übertragungen von Stufe 3 in Stufe 2</b> |                 |                 |                 |
| Unternehmensanleihen                        | –               | 642.487         | (642.487)       |
| <b>Übertragungen von Stufe 1 in Stufe 2</b> |                 |                 |                 |
| Investmentfonds                             | (15.148)        | 15.148          | –               |

Im am 31. Dezember 2024 beendeten Geschäftsjahr wurden bestimmte Unternehmensanleihen von Stufe 3 in Stufe 2 übertragen, da die für die Bewertung verfügbaren Dealerquotierungen gestiegen sind.

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024 wurde ein Investmentfonds von Stufe 1 in Stufe 2 übertragen, da die für die Bewertung verfügbaren Dealerquotierungen zurückgegangen sind.

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|  | Stufe 1<br>US\$  | Stufe 2<br>US\$      | Stufe 3*<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$    |
|--|------------------|----------------------|------------------|----------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte        |                  |                      |                  |                      |
| Aktien   | –                | 22.512               | –                | 22.512               |
| Schatzwechsel  | –                | 221.166.130          | –                | 221.166.130          |
| Agency Bonds   | –                | 781.434              | –                | 781.434              |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)            | –                | 211.031.917          | –                | 211.031.917          |
| Unternehmensanleihen                                       | –                | 534.569.806          | 1.274.504        | 535.844.310          |
| Staatsanleihen   | –                | 175.669.880          | –                | 175.669.880          |
| Mortgage-Backed Securities                                 | –                | 918.338.562          | –                | 918.338.562          |
| Kommunalanleihen   | –                | 12.918.823           | –                | 12.918.823           |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen                       | –                | 429.819              | –                | 429.819              |
| Investmentfonds  | 145.814          | 60.620.640           | –                | 60.766.454           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten      | –                | 20.251.351           | –                | 20.251.351           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten           | 3.637.375        | –                    | –                | 3.637.375            |
| Beizulegender Zeitwert aus gekauften Swaptions             | –                | 15.122               | –                | 15.122               |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten  | –                | 905.422              | –                | 905.422              |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten           | –                | 834.927              | –                | 834.927              |
| Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten | –                | 461.585              | –                | 461.585              |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                            | <b>3.783.189</b> | <b>2.158.017.930</b> | <b>1.274.504</b> | <b>2.163.075.623</b> |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Strategic Income (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|  | Stufe 1<br>US\$     | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3*<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$   |
|--|---------------------|--------------------|------------------|---------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                     |                    |                  |                     |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –                   | (5.513.615)        | –                | (5.513.615)         |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten      | (18.576.468)        | –                  | –                | (18.576.468)        |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten      | –                   | (1.085.681)        | –                | (1.085.681)         |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>(18.576.468)</b> | <b>(6.599.296)</b> | <b>–</b>         | <b>(25.175.764)</b> |

\* Unternehmensanleihen der Stufe 3 wurden in Übereinstimmung mit den von den Direktoren genehmigten Verfahren bewertet.

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|
| <b>Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 3</b> |                 |                 |                 |
| Unternehmensanleihen                        | –               | (1.274.504)     | 1.274.504       |

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurden bestimmte Unternehmensanleihen von Stufe 2 in Stufe 3 übertragen, da von den Direktoren genehmigten Preisfindungsverfahren verwendet werden.

Sustainable Asia High Yield

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$   | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-----------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte |                 |                   |                 |                   |
| Unternehmensanleihen                                | –               | 25.362.503        | –               | 25.362.503        |
| Staatsanleihen                                      | –               | 4.024.917         | –               | 4.024.917         |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                     | <b>–</b>        | <b>29.387.420</b> | <b>–</b>        | <b>29.387.420</b> |

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|--|-----------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                 |                 |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten      | (14.055)        | –               | –               | (14.055)          |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>(14.055)</b> | <b>–</b>        | <b>–</b>        | <b>(14.055)</b>   |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Sustainable Asia High Yield (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$   | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|--|-----------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte    |                 |                   |                 |                   |
| Unternehmensanleihen                                   | –               | 24.364.117        | –               | 24.364.117        |
| Staatsanleihen   | –               | 2.505.094         | –               | 2.505.094         |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten  | –               | 16.926            | –               | 16.926            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten       | 23.897          | –                 | –               | 23.897            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                        | <b>23.897</b>   | <b>26.886.137</b> | <b>–</b>        | <b>26.910.034</b> |
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                 |                   |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –               | (496)             | –               | (496)             |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten      | (58.271)        | –                 | –               | (58.271)          |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>(58.271)</b> | <b>(496)</b>      | <b>–</b>        | <b>(58.767)</b>   |

## Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|   | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$     | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$   |
|---|--------------------|---------------------|-----------------|---------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte       |                    |                     |                 |                     |
| Unternehmensanleihen                                      | –                  | 62.183.538          | –               | 62.183.538          |
| Staatsanleihen  | –                  | 506.955.192         | –               | 506.955.192         |
| Pensionsgeschäfte   | –                  | 13.000.000          | –               | 13.000.000          |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten     | –                  | 3.522.333           | –               | 3.522.333           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten          | 3.868.256          | –                   | –               | 3.868.256           |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten | –                  | 836.491             | –               | 836.491             |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                           | <b>3.868.256</b>   | <b>586.497.554</b>  | <b>–</b>        | <b>590.365.810</b>  |
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten    |                    |                     |                 |                     |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten    | –                  | (12.284.478)        | –               | (12.284.478)        |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten         | (2.827.620)        | –                   | –               | (2.827.620)         |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                       | <b>(2.827.620)</b> | <b>(12.284.478)</b> | <b>–</b>        | <b>(15.112.098)</b> |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|  | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|--|--------------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte    |                    |                    |                 |                    |
| Unternehmensanleihen                                   | –                  | 28.120.429         | –               | 28.120.429         |
| Staatsanleihen   | –                  | 387.681.779        | –               | 387.681.779        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten  | –                  | 8.781.301          | –               | 8.781.301          |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten       | 7.590.987          | –                  | –               | 7.590.987          |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                        | <b>7.590.987</b>   | <b>424.583.509</b> | <b>–</b>        | <b>432.174.496</b> |
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                    |                    |                 |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –                  | (2.051.066)        | –               | (2.051.066)        |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten      | (3.655.629)        | –                  | –               | (3.655.629)        |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>(3.655.629)</b> | <b>(2.051.066)</b> | <b>–</b>        | <b>(5.706.695)</b> |

Tactical Macro<sup>1</sup>

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$   | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-----------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte         |                 |                   |                 |                   |
| Schatzwechsel   | –               | 33.319.914        | –               | 33.319.914        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten       | –               | 67.183            | –               | 67.183            |
| Gekaufte Optionskontrakte                                   | –               | 294.752           | –               | 294.752           |
| Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten  | –               | 21.388            | –               | 21.388            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                             | <b>–</b>        | <b>33.703.237</b> | <b>–</b>        | <b>33.703.237</b> |
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten      |                 |                   |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten      | –               | (296.634)         | –               | (296.634)         |
| Verkaufte Optionskontrakte                                  | –               | (294.752)         | –               | (294.752)         |
| Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten | –               | (39.190)          | –               | (39.190)          |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                         | <b>–</b>        | <b>(630.576)</b>  | <b>–</b>        | <b>(630.576)</b>  |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Tactical Macro<sup>1</sup> (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$   | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-----------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                 |                   |                 |                   |
| Schatzwechsel   | –               | 22.994.103        | –               | 22.994.103        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –               | 67.331            | –               | 67.331            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten      | 8.973           | –                 | –               | 8.973             |
| Gekaufte Optionskontrakte                             | 267.084         | 92.215            | –               | 359.299           |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>276.057</b>  | <b>23.153.649</b> | <b>–</b>        | <b>23.429.706</b> |

|  | Stufe 1<br>US\$  | Stufe 2<br>US\$  | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|--|------------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                  |                  |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –                | (36.811)         | –               | (36.811)          |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten      | (28.337)         | –                | –               | (28.337)          |
| Verkaufte Optionskontrakte                             | (115.463)        | (81.790)         | –               | (197.253)         |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>(143.800)</b> | <b>(118.601)</b> | <b>–</b>        | <b>(262.401)</b>  |

## Uncorrelated Strategies

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|  | Stufe 1<br>US\$   | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3*<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|--|-------------------|--------------------|------------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte        |                   |                    |                  |                    |
| Aktien   | 16.585.832        | –                  | –                | 16.585.832         |
| Immobilienaktiengesellschaften                             | 498.501           | –                  | –                | 498.501            |
| Participatory Notes  | 161.034           | –                  | –                | 161.034            |
| Schatzwechsel  | –                 | 308.758.915        | –                | 308.758.915        |
| Unternehmensanleihen                                       | –                 | 63.149.917         | –                | 63.149.917         |
| Staatsanleihen   | –                 | 10.311.805         | –                | 10.311.805         |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten      | –                 | 25.462.747         | –                | 25.462.747         |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten           | 18.745.821        | 1.458              | –                | 18.747.279         |
| Gekaufte Optionskontrakte                                  | 31.634.411        | 65.414.008         | 333.442          | 97.381.861         |
| Nicht realisierter Gewinn aus Differenzkontrakten          | –                 | 19.758.825         | 250              | 19.759.075         |
| Beizulegender Zeitwert aus gekauften Swaptions             | –                 | 9.599              | –                | 9.599              |
| Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten | –                 | 2.665.711          | –                | 2.665.711          |
| Nicht realisierter Gewinn aus Variance-Swap-Kontrakten     | –                 | –                  | 1.981.004        | 1.981.004          |
| Nicht realisierter Gewinn aus Volatility-Swap-Kontrakten   | –                 | 6.836.761          | 537.450          | 7.374.211          |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                            | <b>67.625.599</b> | <b>502.369.746</b> | <b>2.852.146</b> | <b>572.847.491</b> |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|   | Stufe 1<br>US\$     | Stufe 2<br>US\$      | Stufe 3*<br>US\$   | Insgesamt<br>US\$    |
|---|---------------------|----------------------|--------------------|----------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten      |                     |                      |                    |                      |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten      | –                   | (45.926.653)         | –                  | (45.926.653)         |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten           | (11.482.072)        | –                    | –                  | (11.482.072)         |
| Verkaufte Optionskontrakte                                  | (6.585.399)         | (65.236.684)         | (460)              | (71.822.543)         |
| Nicht realisierter Verlust aus Differenzkontrakten          | –                   | (12.951.665)         | (451.005)          | (13.402.670)         |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten   | –                   | (96.227)             | –                  | (96.227)             |
| Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten | –                   | (1.197.807)          | –                  | (1.197.807)          |
| Nicht realisierter Verlust aus Variance-Swap-Kontrakten     | –                   | –                    | (560.959)          | (560.959)            |
| Nicht realisierter Verlust aus Volatility-Swap-Kontrakten   | –                   | (2.943.689)          | –                  | (2.943.689)          |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                         | <b>(18.067.471)</b> | <b>(128.352.725)</b> | <b>(1.012.424)</b> | <b>(147.432.620)</b> |

\* Optionskontrakte, Differenzkontrakte, Variance- und Volatility-Swaps der Stufe 3 wurden in Übereinstimmung mit den von den Direktoren genehmigten Verfahren und/oder auf der Basis der Notierung eines einzigen Händlers bewertet. Diese Anlagen hatten keinen wesentlichen Einfluss auf das Nettovermögen des Portfolios, weshalb bei der Bewertungsformel keine Angaben zu nicht beobachtbaren Parametern erfolgen.

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|
| <b>Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 3</b> |                 |                 |                 |
| Differenzkontrakte                          | –               | 140             | (140)           |
| Optionskontrakte                            | –               | (179.594)       | 179.594         |
| <b>Übertragungen von Stufe 1 in Stufe 3</b> |                 |                 |                 |
| Optionskontrakte                            | (3.196)         | –               | 3.196           |

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024 wurden Optionskontrakte von Stufe 1 in Stufe 3 übertragen, da von den Direktoren genehmigten Preisfindungsverfahren verwendet wurden. Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024 wurden Differenz- und Optionskontrakte von Stufe 2 in Stufe 3 übertragen, da von den Direktoren genehmigten Preisfindungsverfahren verwendet wurden.

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3*<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-----------------|-----------------|------------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                 |                 |                  |                   |
| Unternehmensanleihen                                  | –               | 120.618.827     | –                | 120.618.827       |
| Aktien  | 77.292.452      | –               | –                | 77.292.452        |
| Staatsanleihen  | –               | 38.964.571      | –                | 38.964.571        |
| Participatory Notes                                   | 16.551          | 20.494          | –                | 37.045            |
| Immobilienaktiengesellschaften                        | 1.217.656       | –               | –                | 1.217.656         |
| Schatzwechsel   | –               | 707.195.701     | –                | 707.195.701       |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –               | 91.871.867      | –                | 91.871.867        |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|   | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$      | Stufe 3*<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$    |
|---|--------------------|----------------------|------------------|----------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte (Fortsetzung) |                    |                      |                  |                      |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten                  | 18.420.818         | –                    | –                | 18.420.818           |
| Gekaufte Optionskontrakte   | 76.813.301         | 205.683.748          | 739.333          | 283.236.382          |
| Nicht realisierter Gewinn aus Differenzkontrakten                 | –                  | 106.922.939          | 622              | 106.923.561          |
| Gekaufte Swaptions  | –                  | 40.202               | –                | 40.202               |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten         | –                  | 686.246              | –                | 686.246              |
| Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten                  | –                  | 3.727.082            | –                | 3.727.082            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten        | –                  | 3.395.463            | –                | 3.395.463            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Correlation-Swap-Kontrakten         | –                  | 379.911              | –                | 379.911              |
| Nicht realisierter Gewinn aus Variance-Swap-Kontrakten            | –                  | 85.377               | 3.742.835        | 3.828.212            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Volatility-Swap-Kontrakten          | –                  | 15.951.941           | 2.474.234        | 18.426.175           |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                                   | <b>173.760.778</b> | <b>1.295.544.369</b> | <b>6.957.024</b> | <b>1.476.262.171</b> |

|   | Stufe 1<br>US\$     | Stufe 2<br>US\$      | Stufe 3*<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$    |
|---|---------------------|----------------------|------------------|----------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten      |                     |                      |                  |                      |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten      | –                   | (53.084.382)         | –                | (53.084.382)         |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten           | (24.576.840)        | (16.558)             | –                | (24.593.398)         |
| Verkaufte Optionskontrakte                                  | (24.217.092)        | (354.499.520)        | (612)            | (378.717.224)        |
| Nicht realisierter Verlust aus Differenzkontrakten          | –                   | (20.286.524)         | (404.714)        | (20.691.238)         |
| Verkaufte Swaptionen  | –                   | (29.043)             | –                | (29.043)             |
| Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten   | –                   | (1.305.860)          | –                | (1.305.860)          |
| Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten           | –                   | (9.089.737)          | –                | (9.089.737)          |
| Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten | –                   | (3.021.166)          | –                | (3.021.166)          |
| Nicht realisierter Verlust aus Variance-Swap-Kontrakten     | –                   | (418.672)            | (96.004)         | (514.676)            |
| Nicht realisierter Verlust aus Volatility-Swap-Kontrakten   | –                   | (8.805.597)          | (105.892)        | (8.911.489)          |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                         | <b>(48.793.932)</b> | <b>(450.557.059)</b> | <b>(607.222)</b> | <b>(499.958.213)</b> |

\* Optionskontrakte, Differenzkontrakte, Variance- und Volatility-Swaps der Stufe 3 wurden in Übereinstimmung mit den von den Direktoren genehmigten Verfahren und/oder auf der Basis der Notierung eines einzigen Händlers bewertet.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|
| <b>Übertragungen von Stufe 1 in Stufe 2</b> |                 |                 |                 |
| Optionskontrakte                            | (425.350)       | 425.350         | –               |
| <b>Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 3</b> |                 |                 |                 |
| Variance-Swap-Kontrakte                     | –               | (446.251)       | 446.251         |
| Volatility-Swap-Kontrakte                   | –               | (1.641.552)     | 1.641.552       |
| <b>Übertragungen von Stufe 1 in Stufe 3</b> |                 |                 |                 |
| Differenzkontrakte                          | (622)           | –               | 622             |
| Optionskontrakte                            | (55.703)        | –               | 55.703          |

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurden Optionskontrakte und Differenzkontrakte von Stufe 1 in Stufe 3 übertragen, da von den Direktoren genehmigten Preisfindungsverfahren verwendet werden. Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurden Optionskontrakte von Stufe 1 in Stufe 2 übertragen, da die für die Bewertung verfügbaren Dealerquotierungen zurückgegangen sind. Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurden Variance-Swap-Kontrakte und Volatility-Swap-Kontrakte von Stufe 2 in Stufe 3 übertragen, da von den Direktoren genehmigten Preisfindungsverfahren verwendet werden.

US Equity

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|  | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|--|--------------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte    |                    |                    |                 |                    |
| Aktien   | 106.233.762        | –                  | –               | 106.233.762        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten  | –                  | 490.960            | –               | 490.960            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                        | <b>106.233.762</b> | <b>490.960</b>     | <b>–</b>        | <b>106.724.722</b> |
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                    |                    |                 |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –                  | (1.588.964)        | –               | (1.588.964)        |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>–</b>           | <b>(1.588.964)</b> | <b>–</b>        | <b>(1.588.964)</b> |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|   | Stufe 1<br>US\$   | Stufe 2<br>US\$  | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-------------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                   |                  |                 |                   |
| Aktien  | 45.872.647        | –                | –               | 45.872.647        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –                 | 1.253.492        | –               | 1.253.492         |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>45.872.647</b> | <b>1.253.492</b> | <b>–</b>        | <b>47.126.139</b> |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## US Equity (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$  | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|--|-----------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                 |                  |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –               | (118.963)        | –               | (118.963)         |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>–</b>        | <b>(118.963)</b> | <b>–</b>        | <b>(118.963)</b>  |

## US Equity Premium

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                 |                    |                 |                    |
| Staatsanleihen  | –               | 634.072.321        | –               | 634.072.321        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –               | 541.191            | –               | 541.191            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>–</b>        | <b>634.613.512</b> | <b>–</b>        | <b>634.613.512</b> |

|  | Stufe 1<br>US\$     | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$   |
|--|---------------------|--------------------|-----------------|---------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                     |                    |                 |                     |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –                   | (8.824.034)        | –               | (8.824.034)         |
| Verkaufte Optionskontrakte                             | (13.165.220)        | –                  | –               | (13.165.220)        |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>(13.165.220)</b> | <b>(8.824.034)</b> | <b>–</b>        | <b>(21.989.254)</b> |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                 |                    |                 |                    |
| Staatsanleihen  | –               | 663.357.136        | –               | 663.357.136        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –               | 12.128.805         | –               | 12.128.805         |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>–</b>        | <b>675.485.941</b> | <b>–</b>        | <b>675.485.941</b> |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

US Equity Premium (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|  | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$  | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|--|--------------------|------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                    |                  |                 |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –                  | (538.104)        | –               | (538.104)          |
| Verkaufte Optionskontrakte                             | (5.184.365)        | (67.430)         | –               | (5.251.795)        |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>(5.184.365)</b> | <b>(605.534)</b> | <b>–</b>        | <b>(5.789.899)</b> |

US Large Cap Value

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|   | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|--------------------|-----------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                    |                 |                 |                    |
| Aktien  | 957.724.430        | –               | –               | 957.724.430        |
| Immobilienaktiengesellschaften                        | 39.459.548         | –               | –               | 39.459.548         |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –                  | 163.005         | –               | 163.005            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>997.183.978</b> | <b>163.005</b>  | <b>–</b>        | <b>997.346.983</b> |

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|--|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                 |                    |                 |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –               | (1.856.005)        | –               | (1.856.005)        |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>–</b>        | <b>(1.856.005)</b> | <b>–</b>        | <b>(1.856.005)</b> |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|   | Stufe 1<br>US\$      | Stufe 2<br>US\$  | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$    |
|---|----------------------|------------------|-----------------|----------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                      |                  |                 |                      |
| Aktien  | 1.847.675.317        | –                | –               | 1.847.675.317        |
| Immobilienaktiengesellschaften                        | 3.901.309            | –                | –               | 3.901.309            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –                    | 1.119.012        | –               | 1.119.012            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>1.851.576.626</b> | <b>1.119.012</b> | <b>–</b>        | <b>1.852.695.638</b> |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## US Large Cap Value (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$  | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|--|-----------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                 |                  |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –               | (115.827)        | –               | (115.827)         |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>–</b>        | <b>(115.827)</b> | <b>–</b>        | <b>(115.827)</b>  |

## US Long Short Equity

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|  | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$  | Stufe 3*<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|--|--------------------|------------------|------------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte        |                    |                  |                  |                    |
| Aktien   | 190.787.142        | –                | 1.538.670        | 192.325.812        |
| Immobilienaktiengesellschaften                             | 2.971.995          | –                | –                | 2.971.995          |
| Unternehmensanleihen                                       | –                  | –                | 0                | 0                  |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen                       | –                  | –                | 497.587          | 497.587            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten      | –                  | 460.982          | –                | 460.982            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten           | 2.592.720          | –                | –                | 2.592.720          |
| Gekaufte Optionskontrakte                                  | 23.868             | –                | –                | 23.868             |
| Nicht realisierter Gewinn aus Differenzkontrakten          | –                  | 961.594          | –                | 961.594            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten | –                  | 9.764            | –                | 9.764              |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                            | <b>196.375.725</b> | <b>1.432.340</b> | <b>2.036.257</b> | <b>199.844.322</b> |

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3*<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|-----------------|--------------------|------------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten      |                 |                    |                  |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten      | –               | (5.681.909)        | –                | (5.681.909)        |
| Verkaufte Optionskontrakte                                  | (18.180)        | –                  | –                | (18.180)           |
| Nicht realisierter Verlust aus Differenzkontrakten          | –               | (149.241)          | –                | (149.241)          |
| Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten | –               | (882.248)          | –                | (882.248)          |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                         | <b>(18.180)</b> | <b>(6.713.398)</b> | <b>–</b>         | <b>(6.731.578)</b> |

\* Mittelfristige Schuldverschreibungen der Stufe 3 wurden basierend auf von Händlern verfügbaren Einzelnotierungen bewertet. Alle anderen Anlagen der Stufe 3 wurden in Übereinstimmung mit den von den Direktoren genehmigten Verfahren bewertet. Diese Anlagen hatten keinen wesentlichen Einfluss auf das Nettovermögen des Portfolios, weshalb bei der Bewertungsformel keine Angaben zu nicht beobachtbaren Parametern erfolgen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

US Long Short Equity (Fortsetzung)

31. Dezember 2024

Quantitative Informationen zu Zeitwertbewertungen der Stufe 3:

| Anlagegattung | Beizulegender<br>Zeitwert zum 31.<br>Dezember 2024<br>US\$ | Bewertungsansatz<br>der Stufe | Maßgebliche(r) nicht<br>beobachtbare(r)<br>Parameter | Wert/Spanne<br>des/der<br>Parameter | Gewichteter<br>Durchschnitt <sup>(a)</sup> | Effekt steigender Parameter<br>auf die Bewertung <sup>(b)</sup> |
|---------------|--|-------------------------------|--|-------------------------------------|--|---|
| Stammaktien   | 1.538.670  | Marktansatz                   | Unternehmenswert/EBITDA<br>(EV/EBITDA)               | 9.7x                                | 9.7x                                       | Anstieg   |

<sup>(a)</sup> Der in vorstehender Tabelle angegebene gewichtete Durchschnitt wurde nach dem relativen beizulegenden Zeitwert gewichtet.

<sup>(b)</sup> Stellt die erwartete Richtungsänderung im beizulegenden Zeitwert der Anlagen der Stufe 3 dar, die sich aus einem Anstieg oder einem Rückgang des entsprechenden Parameters ergeben würde. Maßgebliche Veränderungen dieser Parameter könnten zu deutlich höheren oder deutlich niedrigeren Zeitwertbewertungen führen.

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|   | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$   | Stufe 3*<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|--------------------|-------------------|------------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                    |                   |                  |                    |
| Aktien  | 165.044.733        | –                 | 1.538.670        | 166.583.403        |
| Immobilienaktiengesellschaften                        | 3.534.047          | –                 | –                | 3.534.047          |
| Unternehmensanleihen                                  | –                  | 7.670.535         | –                | 7.670.535          |
| Mittelfristige Schuldverschreibungen                  | –                  | –                 | 487.831          | 487.831            |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –                  | 3.283.704         | –                | 3.283.704          |
| Nicht realisierter Gewinn aus Differenzkontrakten     | –                  | 624.429           | –                | 624.429            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>168.578.780</b> | <b>11.578.668</b> | <b>2.026.501</b> | <b>182.183.949</b> |

|  | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3*<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|--|--------------------|--------------------|------------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                    |                    |                  |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –                  | (342.870)          | –                | (342.870)          |
| Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten      | (1.003.428)        | –                  | –                | (1.003.428)        |
| Verkaufte Optionskontrakte                             | (15.714)           | –                  | –                | (15.714)           |
| Nicht realisierter Verlust aus Differenzkontrakten     | –                  | (2.740.096)        | –                | (2.740.096)        |
| Nicht realisierter Verlust aus Return--Swap-Kontrakten | –                  | (4.635.993)        | –                | (4.635.993)        |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>(1.019.142)</b> | <b>(7.718.959)</b> | <b>–</b>         | <b>(8.738.101)</b> |

\* Eine Aktie, eine Unternehmensanleihe und eine mittelfristige Schuldverschreibung der Stufe 3 wurden in Übereinstimmung mit den von den Direktoren genehmigten Verfahren bewertet.

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|
| <b>Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 1</b> |                 |                 |                 |
| Aktien                                      | 1.648.923       | (1.648.923)     | –               |

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurde eine Aktie von Stufe 2 in Stufe 1 übertragen, da die Preisfindung durch einen Pricing-Anbieter erfolgte.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## US Multi Cap Opportunities

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|   | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|--------------------|-----------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                    |                 |                 |                    |
| Aktien  | 387.941.733        | –               | –               | 387.941.733        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –                  | 500.460         | –               | 500.460            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>387.941.733</b> | <b>500.460</b>  | <b>–</b>        | <b>388.442.193</b> |

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|--|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                 |                    |                 |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –               | (3.544.061)        | –               | (3.544.061)        |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>–</b>        | <b>(3.544.061)</b> | <b>–</b>        | <b>(3.544.061)</b> |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|   | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$  | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|--------------------|------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                    |                  |                 |                    |
| Aktien  | 396.982.739        | –                | –               | 396.982.739        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –                  | 1.843.892        | –               | 1.843.892          |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>396.982.739</b> | <b>1.843.892</b> | <b>–</b>        | <b>398.826.631</b> |

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$  | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|--|-----------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                 |                  |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –               | (325.170)        | –               | (325.170)         |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>–</b>        | <b>(325.170)</b> | <b>–</b>        | <b>(325.170)</b>  |

## US Real Estate Securities

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte |                 |                 |                 |                   |
| Aktien  | 9.235.982       | –               | –               | 9.235.982         |
| Immobilienaktiengesellschaften                      | 423.305.104     | –               | –               | 423.305.104       |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|   | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$  | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|--------------------|------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte (Fortsetzung) |                    |                  |                 |                    |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten             | –                  | 1.269.806        | –               | 1.269.806          |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                                   | <b>432.541.086</b> | <b>1.269.806</b> | <b>–</b>        | <b>433.810.892</b> |

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|--|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                 |                    |                 |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –               | (4.322.763)        | –               | (4.322.763)        |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>–</b>        | <b>(4.322.763)</b> | <b>–</b>        | <b>(4.322.763)</b> |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|   | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$  | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|--------------------|------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                    |                  |                 |                    |
| Immobilienaktiengesellschaften                        | 519.992.632        | –                | –               | 519.992.632        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –                  | 2.358.847        | –               | 2.358.847          |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>519.992.632</b> | <b>2.358.847</b> | <b>–</b>        | <b>522.351.479</b> |

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$  | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|--|-----------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                 |                  |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –               | (441.683)        | –               | (441.683)         |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>–</b>        | <b>(441.683)</b> | <b>–</b>        | <b>(441.683)</b>  |

US Small Cap

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|   | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$  | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|--------------------|------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                    |                  |                 |                    |
| Aktien  | 872.041.712        | 2.869.910        | –               | 874.911.622        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –                  | 281.334          | –               | 281.334            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>872.041.712</b> | <b>3.151.244</b> | <b>–</b>        | <b>875.192.956</b> |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## US Small Cap (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$    | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|--|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                 |                    |                 |                    |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –               | (1.942.634)        | –               | (1.942.634)        |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>–</b>        | <b>(1.942.634)</b> | <b>–</b>        | <b>(1.942.634)</b> |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|   | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$  | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|--------------------|------------------|-----------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                    |                  |                 |                    |
| Aktien  | 618.452.600        | 3.839.310        | –               | 622.291.910        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –                  | 747.370          | –               | 747.370            |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>618.452.600</b> | <b>4.586.680</b> | <b>–</b>        | <b>623.039.280</b> |

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$  | Stufe 3<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|--|-----------------|------------------|-----------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                 |                  |                 |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –               | (137.144)        | –               | (137.144)         |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>–</b>        | <b>(137.144)</b> | <b>–</b>        | <b>(137.144)</b>  |

|   | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3<br>US\$ |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|
| <b>Übertragungen von Stufe 1 in Stufe 2</b> |                 |                 |                 |
| Aktien                                      | (3.839.310)     | 3.839.310       | –               |

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurde eine Aktie von Stufe 1 in Stufe 2 übertragen, da die für die Bewertung verfügbaren Dealerquotierungen zurückgegangen sind.

## US Small Cap Intrinsic Value

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|   | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3*<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|--------------------|-----------------|------------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte   |                    |                 |                  |                    |
| Aktien  | 395.261.275        | –               | 0                | 395.261.275        |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten | –                  | 42.287          | –                | 42.287             |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                       | <b>395.261.275</b> | <b>42.287</b>   | <b>0</b>         | <b>395.303.562</b> |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

US Small Cap Intrinsic Value (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2024

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$  | Stufe 3*<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|--|-----------------|------------------|------------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                 |                  |                  |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –               | (547.761)        | –                | (547.761)         |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>–</b>        | <b>(547.761)</b> | <b>–</b>         | <b>(547.761)</b>  |

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

|   | Stufe 1<br>US\$    | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3*<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$  |
|---|--------------------|-----------------|------------------|--------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte |                    |                 |                  |                    |
| Aktien  | 299.826.372        | –               | 0                | 299.826.372        |
| Immobilienaktiengesellschaften                      | 1.910.421          | –               | –                | 1.910.421          |
| <b>Vermögenswerte insgesamt</b>                     | <b>301.736.793</b> | <b>–</b>        | <b>0</b>         | <b>301.736.793</b> |

|  | Stufe 1<br>US\$ | Stufe 2<br>US\$ | Stufe 3*<br>US\$ | Insgesamt<br>US\$ |
|--|-----------------|-----------------|------------------|-------------------|
| Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten |                 |                 |                  |                   |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten | –               | (398)           | –                | (398)             |
| <b>Verbindlichkeiten, insgesamt</b>                    | <b>–</b>        | <b>(398)</b>    | <b>–</b>         | <b>(398)</b>      |

\* Aktien der Stufe 3 wurden in Übereinstimmung mit den von den Direktoren genehmigten Verfahren bewertet.

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

Die folgende Aufstellung enthält eine Überleitung der Anlagen, deren Wert per 31. Dezember 2024 unter Anwendung nicht beobachtbarer Parameter (Stufe 3) ermittelt wurde:

Absolute Return Multi Strategy\*

|   | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-------------------|
| Saldo per 1. Januar 2024                          | 6.311             |
| Verkäufe  | (12.622)          |
| Realisierter Nettogewinn                          | 12.622            |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Verlustes | (6.311)           |
| <b>Saldo per 31. Dezember 2024</b>                | <b>–</b>          |

\* Das Portfolio wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Global Flexible Credit Income

|  | Insgesamt<br>US\$ |
|--|-------------------|
| Saldo per 1. Januar 2024                         | 7.527.253         |
| Käufe  | 3.495.212         |
| Verkäufe   | (989.358)         |
| Realisierter Nettoverlust                        | (101.669)         |
| Übertragung aus Stufe 3                          | (1.247.160)       |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes | 801.308           |
| <b>Saldo per 31. Dezember 2024</b>               | <b>9.485.586</b>  |

## Global High Yield Engagement

|  | Insgesamt<br>US\$ |
|--|-------------------|
| Saldo per 1. Januar 2024                         | 2.034.310         |
| Käufe  | 426.261           |
| Verkäufe   | (2.324.338)       |
| Realisierter Nettogewinn                         | 49.350            |
| Übertragung aus Stufe 3                          | (908.020)         |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes | 722.437           |
| <b>Saldo per 31. Dezember 2024</b>               | <b>–</b>          |

## High Yield Bond

|  | Insgesamt<br>US\$ |
|--|-------------------|
| Saldo per 1. Januar 2024                         | 14.661.425        |
| Käufe  | 1.273.391         |
| Verkäufe   | (16.848.589)      |
| Realisierter Nettoverlust                        | (1.466.980)       |
| Übertragung aus Stufe 3                          | (4.882.361)       |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes | 7.263.114         |
| <b>Saldo per 31. Dezember 2024</b>               | <b>–</b>          |

## Short Duration Emerging Market Debt

|  | Insgesamt<br>US\$ |
|--|-------------------|
| Saldo per 1. Januar 2024                         | 500.000           |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes | –                 |
| <b>Saldo per 31. Dezember 2024</b>               | <b>500.000</b>    |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Short Duration High Yield Engagement

|   | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-------------------|
| Saldo per 1. Januar 2024                          | 5.313.383         |
| Käufe   | 495.669           |
| Verkäufe  | (5.985.571)       |
| Realisierter Nettoverlust                         | (47.325)          |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Verlustes | 621.574           |
| <b>Saldo per 31. Dezember 2024</b>                | <b>397.730</b>    |

Strategic Income

|  | Insgesamt<br>US\$ |
|--|-------------------|
| Saldo per 1. Januar 2024                         | 1.274.504         |
| Käufe  | 6.473.339         |
| Verkäufe   | (2.138.072)       |
| Realisierter Nettoverlust                        | (7.108)           |
| Übertragung aus Stufe 3                          | (642.487)         |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes | 578.748           |
| <b>Saldo per 31. Dezember 2024</b>               | <b>5.538.924</b>  |

Uncorrelated Strategies

|  | Insgesamt<br>US\$ |
|--|-------------------|
| Saldo per 1. Januar 2024                         | 6.349.802         |
| Käufe  | 2.998.170         |
| Verkäufe   | (136.922)         |
| Übertragung in Stufe 3                           | 182.650           |
| Realisierter Nettoverlust                        | (13.066.613)      |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes | 5.512.635         |
| <b>Saldo per 31. Dezember 2024</b>               | <b>1.839.722</b>  |

US Long Short Equity

|  | Insgesamt<br>US\$ |
|--|-------------------|
| Saldo per 1. Januar 2024                         | 2.026.501         |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes | 9.756             |
| <b>Saldo per 31. Dezember 2024</b>               | <b>2.036.257</b>  |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Die folgende Aufstellung enthält eine Überleitung der Anlagen, deren Wert per 31. Dezember 2023 unter Anwendung nicht beobachtbarer Parameter (Stufe 3) ermittelt wurde:

## Absolute Return Multi Strategy\*

|   | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-------------------|
| Saldo per 1. Januar 2023                          | 6.766             |
| Realisierter Nettoverlust                         | (4)               |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Verlustes | (451)             |
| <b>Saldo per 31. Dezember 2023</b>                | <b>6.311</b>      |

\* Das Portfolio wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

## Global Flexible Credit Income

|  | Insgesamt<br>US\$ |
|--|-------------------|
| Saldo per 1. Januar 2023                         | 5.247.334         |
| Käufe  | 1.293.983         |
| Übertragung in Stufe 3                           | 247.792           |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes | 738.144           |
| <b>Saldo per 31. Dezember 2023</b>               | <b>7.527.253</b>  |

## Global High Yield Engagement

|   | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-------------------|
| Saldo per 1. Januar 2023                          | 325.875           |
| Käufe   | 1.847.363         |
| Verkäufe  | (1.206.234)       |
| Realisierter Nettogewinn                          | 686               |
| Übertragung in Stufe 3                            | 1.136.259         |
| Übertragung aus Stufe 3                           | (4.933)           |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Verlustes | (64.706)          |
| <b>Saldo per 31. Dezember 2023</b>                | <b>2.034.310</b>  |

## High Yield Bond

|   | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-------------------|
| Saldo per 1. Januar 2023                          | 5.791.687         |
| Käufe   | 16.834.056        |
| Verkäufe  | (13.429.241)      |
| Realisierter Nettoverlust                         | (340.284)         |
| Übertragung in Stufe 3                            | 7.195.550         |
| Übertragung aus Stufe 3                           | (4.940)           |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Verlustes | (1.385.403)       |
| <b>Saldo per 31. Dezember 2023</b>                | <b>14.661.425</b> |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Short Duration Emerging Market Debt

|  | Insgesamt<br>US\$ |
|--|-------------------|
| Saldo per 1. Januar 2023                         | 500.000           |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes | –                 |
| <b>Saldo per 31. Dezember 2023</b>               | <b>500.000</b>    |

Short Duration High Yield Engagement

|   | Insgesamt<br>US\$ |
|---|-------------------|
| Saldo per 1. Januar 2023                          | –                 |
| Käufe   | 8.248.058         |
| Verkäufe  | (3.688.538)       |
| Realisierter Nettogewinn                          | 97.959            |
| Übertragung in Stufe 3                            | 900.513           |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Verlustes | (244.609)         |
| <b>Saldo per 31. Dezember 2023</b>                | <b>5.313.383</b>  |

Strategic Income

|  | Insgesamt<br>US\$ |
|--|-------------------|
| Saldo per 1. Januar 2023                         | 126.140           |
| Käufe  | 796.760           |
| Verkäufe   | (299.057)         |
| Realisierter Nettoverlust                        | (60.212)          |
| Übertragung in Stufe 3                           | 605.611           |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes | 105.262           |
| <b>Saldo per 31. Dezember 2023</b>               | <b>1.274.504</b>  |

Uncorrelated Trading\*

|  | Insgesamt<br>US\$ |
|--|-------------------|
| Saldo per 1. Januar 2023                         | 81.777            |
| Verkäufe   | (42.151)          |
| Realisierter Nettoverlust                        | (963.789)         |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes | 924.163           |
| <b>Saldo per 31. Dezember 2023</b>               | <b>–</b>          |

\* Das Portfolio wurde am 24. Mai 2024 aufgelöst.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## (f) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

## Uncorrelated Strategies

|  | Insgesamt<br>US\$ |
|--|-------------------|
| Saldo per 1. Januar 2023                         | 257.406           |
| Käufe  | 8.232.754         |
| Verkäufe   | (180.900)         |
| Übertragung in Stufe 3                           | 2.144.128         |
| Realisierter Nettoverlust                        | (11.232.258)      |
| Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes | 7.128.672         |
| <b>Saldo per 31. Dezember 2023</b>               | <b>6.349.802</b>  |

## US Long Short Equity

|                                    | Insgesamt<br>US\$ |
|------------------------------------|-------------------|
| Saldo per 1. Januar 2023           | –                 |
| Käufe                              | 2.026.501         |
| <b>Saldo per 31. Dezember 2023</b> | <b>2.026.501</b>  |

Laufzeitkredite der Stufe 3 sind in erster Linie auf die Preisfindungsmethode zurückzuführen, bei der eine einzelne Broker-Quotierungen (Stufe 3) oder ein einzelner beobachtbare Parameter (Stufe 3) durch den unabhängigen Pricing-Service-Anbieter verwendet wird. Alle anderen Wertpapiere der Stufe 3 werden in Übereinstimmung mit den von den Direktoren genehmigten Verfahren bewertet.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT

Asia Responsible Transition Bond

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse<br>USD A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse<br>USD A (Monatlich) | Thesaurierende Klasse<br>USD A | Thesaurierende Klasse<br>USD A | Thesaurierende Klasse<br>USD C1 | Thesaurierende Klasse<br>USD C1 |
|-------------------|---|---|--------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|
|                   | NIW                                       | NIW je Anteil                             | NIW                            | NIW je Anteil                  | NIW                             | NIW je Anteil                   |
| 31. Dezember 2024 | 75.646 \$                                 | 7,64 \$                                   | 834.367 \$                     | 12,19 \$                       | 45.283 \$                       | 9,43 \$                         |
| 31. Dezember 2023 | 259.271 \$                                | 7,78 \$                                   | 1.198.440 \$                   | 11,63 \$                       | 147.067 \$                      | 9,09 \$                         |
| 31. Dezember 2022 | 274.934 \$                                | 7,83 \$                                   | 1.309.918 \$                   | 10,99 \$                       | 168.834 \$                      | 8,68 \$                         |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>USD I | Thesaurierende Klasse<br>USD I | Ausschüttende Klasse<br>USD I | Ausschüttende Klasse<br>USD I | Ausschüttende Klasse<br>USD I4 (Monatlich) | Ausschüttende Klasse<br>USD I4 (Monatlich) |
|-------------------|--------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|--|--|
|                   | NIW                            | NIW je Anteil                  | NIW                           | NIW je Anteil                 | NIW  | NIW je Anteil                              |
| 31. Dezember 2024 | 370.173 \$                     | 12,88 \$                       | 77.225 \$                     | 9,36 \$                       | 10.034 \$                                  | 10,03 \$                                   |
| 31. Dezember 2023 | 354.813 \$                     | 12,21 \$                       | 75.939 \$                     | 9,21 \$                       | 10.140 \$                                  | 10,14 \$                                   |
| 31. Dezember 2022 | 344.730 \$                     | 11,47 \$                       | 10.492.727 \$                 | 8,96 \$                       | 10.118 \$                                  | 10,12 \$                                   |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>USD I4 | Thesaurierende Klasse<br>USD I4 | Thesaurierende Klasse<br>USD M | Thesaurierende Klasse<br>USD M | Ausschüttende Klasse<br>USD X (Monatlich) | Ausschüttende Klasse<br>USD X (Monatlich) |
|-------------------|---------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|---|---|
|                   | NIW                             | NIW je Anteil                   | NIW                            | NIW je Anteil                  | NIW                                       | NIW je Anteil                             |
| 31. Dezember 2024 | 32.322 \$                       | 11,54 \$                        | 172.525 \$                     | 9,71 \$                        | 9.867 \$                                  | 9,87 \$                                   |
| 31. Dezember 2023 | 10.918 \$                       | 10,92 \$                        | 311.342 \$                     | 9,32 \$                        | 10.045 \$                                 | 10,05 \$                                  |
| 31. Dezember 2022 | 10.229 \$                       | 10,23 \$                        | 490.875 \$                     | 8,86 \$                        | 10.098 \$                                 | 10,10 \$                                  |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Asia Responsible Transition Bond (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD X | Thesaurierende Klasse USD X | Thesaurierende Klasse USD Z | Thesaurierende Klasse USD Z |
|-------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
|                   | NIW                         | NIW je Anteil               | NIW                         | NIW je Anteil               |
| 31. Dezember 2024 | 20.824 \$                   | 9,49 \$                     | 26.882.896 \$               | 11,37 \$                    |
| 31. Dezember 2023 | 19.846 \$                   | 9,05 \$                     | 61.533.403 \$               | 10,72 \$                    |
| 31. Dezember 2022 | 18.734 \$                   | 8,54 \$                     | 8.490.714 \$                | 10,01 \$                    |

## China A-Share Equity

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse CNY I | Thesaurierende Klasse CNY I | Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) | Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) | Ausschüttende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) | Ausschüttende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) |
|-------------------|-----------------------------|-----------------------------|---|---|--|--|
|                   | NIW                         | NIW je Anteil               | NIW   | NIW je Anteil   | NIW  | NIW je Anteil  |
| 31. Dezember 2024 | 121.887 CNY                 | 83,40 CNY                   | 7.965 \$  | 7,96 \$   | 1.972.667 \$   | 7,89 \$  |
| 31. Dezember 2023 | 117.417 CNY                 | 80,34 CNY                   | 23.194 \$   | 7,90 \$   | 1.974.225 \$   | 7,89 \$  |
| 31. Dezember 2022 | 133.897 CNY                 | 91,62 CNY                   | 27.220 \$   | 9,28 \$   | 2.319.140 \$   | 9,27 \$  |

## China Bond

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse CNY I | Ausschüttende Klasse CNY I | Thesaurierende Klasse CNY Z | Thesaurierende Klasse CNY Z |
|-------------------|--|--|----------------------------|----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
|                   | NIW                                    | NIW je Anteil                          | NIW                        | NIW je Anteil              | NIW                         | NIW je Anteil               |
| 31. Dezember 2024 | 152.485 CNY                            | 76,52 CNY                              | 216.193 CNY                | 92,12 CNY                  | 151.819 CNY                 | 124,68 CNY                  |
| 31. Dezember 2023 | 152.534 CNY                            | 76,55 CNY                              | 212.640 CNY                | 90,61 CNY                  | 218.817 CNY                 | 119,47 CNY                  |
| 31. Dezember 2022 | 156.137 CNY                            | 78,36 CNY                              | 209.325 CNY                | 89,19 CNY                  | 210.297 CNY                 | 114,82 CNY                  |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

China Bond (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>GBP I2*<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP I2*<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>SGD A (Monatlich) (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>SGD A (Monatlich) (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD I (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD I (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---|---|---|---|--|--|
| 31. Dezember 2024 | –                                       | –   | 396.952 SGD   | 13,75 SGD   | 700.994 \$   | 10,32 \$   |
| 31. Dezember 2023 | 20.687 £                                | 9,51 £  | 704.160 SGD   | 13,71 SGD   | 3.072.338 \$   | 10,27 \$   |
| 31. Dezember 2022 | 19.572 £                                | 9,00 £  | 1.003.087 SGD   | 14,69 SGD   | 5.761.473 \$   | 10,22 \$   |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>USD Z<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD Z<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD Z (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD Z (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|--|--|
| 31. Dezember 2024 | 12.217.661 \$                         | 10,90 \$  | 3.844.970 \$   | 10,01 \$   |
| 31. Dezember 2023 | 48.865.775 \$                         | 10,14 \$  | 11.943.662 \$  | 9,88 \$  |
| 31. Dezember 2022 | 47.003.040 \$                         | 9,49 \$   | 11.882.617 \$  | 9,78 \$  |

China Equity

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>CHF I<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>CHF I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>EUR A<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>EUR A<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>EUR I<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>EUR I<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | 45.659 CHF                            | 10,38 CHF                                       | 935.685 €                             | 18,73 €   | 957.870 €                             | 20,63 €   |
| 31. Dezember 2023 | 164.919 CHF                           | 9,11 CHF  | 874.281 €                             | 16,18 €   | 886.658 €                             | 17,69 €   |
| 31. Dezember 2022 | 355.994 CHF                           | 12,23 CHF                                       | 1.489.033 €                           | 21,49 €   | 1.254.577 €                           | 23,33 €   |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## China Equity (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR Z<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR Z<br>NIW je Anteil | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP A*<br>NIW | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP A*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>SGD A<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>SGD A<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|--|--|--|--|
| 31. Dezember 2024 | 14.522 €                                 | 16,30 €  | –  | –  | 871.604 SGD                              | 26,49 SGD  |
| 31. Dezember 2023 | 12.316 €                                 | 13,82 €  | 10.372 £                                 | 8,15 £   | 1.478.317 SGD                            | 22,90 SGD  |
| 31. Dezember 2022 | 16.058 €                                 | 18,02 €  | 13.559 £                                 | 10,70 £  | 2.180.349 SGD                            | 30,18 SGD  |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A<br>NIW je Anteil | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD A<br>NIW | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD A<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---|---|--|--|
| 31. Dezember 2024 | 15.662.869 \$                            | 23,36 \$   | 695.008 \$                              | 14,31 \$  | 83.994.925 \$                            | 25,82 \$   |
| 31. Dezember 2023 | 16.602.580 \$                            | 19,81 \$   | 589.764 \$                              | 12,15 \$  | 120.715.813 \$                           | 21,74 \$   |
| 31. Dezember 2022 | 28.844.956 \$                            | 25,67 \$   | 786.778 \$                              | 15,80 \$  | 240.949.106 \$                           | 27,95 \$   |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I2<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I2<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD U<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD U<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---|---|--|--|--|--|
| 31. Dezember 2024 | 21.167.599 \$                             | 16,03 \$  | 17.210 \$                                | 13,28 \$   | 13.317.517 \$                            | 16,45 \$   |
| 31. Dezember 2023 | 21.040.703 \$                             | 13,47 \$  | 15.431 \$                                | 11,38 \$   | 15.726.473 \$                            | 13,90 \$   |
| 31. Dezember 2022 | 15.248.435 \$                             | 17,28 \$  | 20.188 \$                                | 14,88 \$   | 26.266.970 \$                            | 17,93 \$   |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

China Equity (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende         | Thesaurierende                   |
|-------------------|------------------------|----------------------------------|
|                   | Klasse<br>USD Z<br>NIW | Klasse<br>USD Z<br>NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2024 | 287.610 \$             | 17,78 \$                         |
| 31. Dezember 2023 | 239.524 \$             | 14,81 \$                         |
| 31. Dezember 2022 | 304.598 \$             | 18,83 \$                         |

Climate Innovation<sup>1</sup>

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende          | Thesaurierende                    | Thesaurierende          | Thesaurierende                    | Thesaurierende           | Thesaurierende                     |
|-------------------|-------------------------|-----------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|--------------------------|------------------------------------|
|                   | Klasse<br>USD A*<br>NIW | Klasse<br>USD A*<br>NIW je Anteil | Klasse<br>USD I*<br>NIW | Klasse<br>USD I*<br>NIW je Anteil | Klasse<br>USD I5*<br>NIW | Klasse<br>USD I5*<br>NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2024 | 9.983 \$                | 9,98 \$                           | 10.104 \$               | 10,10 \$                          | 10.166 \$                | 10,17 \$                           |
| 31. Dezember 2023 | 9.662 \$                | 9,66 \$                           | 9.696 \$                | 9,70 \$                           | 9.713 \$                 | 9,71 \$                            |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende          | Thesaurierende                    |
|-------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|                   | Klasse<br>USD Z*<br>NIW | Klasse<br>USD Z*<br>NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2024 | 3.067.788 \$            | 10,23 \$                          |
| 31. Dezember 2023 | 2.919.017 \$            | 9,73 \$                           |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## CLO Income

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende         | Thesaurierende                   | Thesaurierende         | Thesaurierende                   | Ausschüttende           | Ausschüttende                     |
|-------------------|------------------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|                   | Klasse<br>EUR A<br>NIW | Klasse<br>EUR A<br>NIW je Anteil | Klasse<br>EUR I<br>NIW | Klasse<br>EUR I<br>NIW je Anteil | Klasse<br>EUR I2<br>NIW | Klasse<br>EUR I2<br>NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2024 | 387.771 €              | 13,12 €                          | 48.695.592 €           | 14,09 €                          | 13.663.246 €            | 9,03 €                            |
| 31. Dezember 2023 | 32.309 €               | 11,44 €                          | 31.596.103 €           | 12,20 €                          | 10.206.824 €            | 8,52 €                            |
| 31. Dezember 2022 | 62.426 €               | 9,67 €                           | 11.405.488 €           | 10,23 €                          | 12.590.646 €            | 7,90 €                            |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende          | Thesaurierende                    | Ausschüttende           | Ausschüttende                     | Ausschüttende            | Ausschüttende                      |
|-------------------|-------------------------|-----------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|--------------------------|------------------------------------|
|                   | Klasse<br>EUR X*<br>NIW | Klasse<br>EUR X*<br>NIW je Anteil | Klasse<br>EUR X*<br>NIW | Klasse<br>EUR X*<br>NIW je Anteil | Klasse<br>GBP I2*<br>NIW | Klasse<br>GBP I2*<br>NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2024 | 32.529.228 €            | 11,01 €                           | 787.106 €               | 10,29 €                           | –                        | –                                  |
| 31. Dezember 2023 | –                       | –                                 | –                       | –                                 | –                        | –                                  |
| 31. Dezember 2022 | –                       | –                                 | –                       | –                                 | 22.140.124 £             | 8,17 £                             |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende         | Thesaurierende                   | Ausschüttende           | Ausschüttende                     | Ausschüttende  | Ausschüttende  |
|-------------------|------------------------|----------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|--|--|
|                   | Klasse<br>GBP Z<br>NIW | Klasse<br>GBP Z<br>NIW je Anteil | Klasse<br>JPY I*<br>NIW | Klasse<br>JPY I*<br>NIW je Anteil | Klasse<br>JPY I (nicht<br>währungsgesichert)*<br>NIW | Klasse<br>JPY I (nicht<br>währungsgesichert)*<br>NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2024 | 24.941 £               | 15,29 £                          | 1.174.074.751 ¥         | 1.011,10 ¥                        | 10.989.049.687 ¥                                     | 1.082,46 ¥   |
| 31. Dezember 2023 | 63.534 £               | 13,09 £                          | –                       | –                                 | –  | –  |
| 31. Dezember 2022 | 52.625 £               | 10,84 £                          | –                       | –                                 | –  | –  |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

CLO Income (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse SEK I<br>NIW | Thesaurierende Klasse SEK I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD A<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD A<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I<br>NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 16.871.644 SEK                     | 143,27 SEK                                   | 3.901.075 \$                       | 13,83 \$                                     | 504.553.725 \$                     | 15,99 \$                                     |
| 31. Dezember 2023 | 30.311.516 SEK                     | 124,19 SEK                                   | 42.064 \$                          | 11,87 \$                                     | 58.957.866 \$                      | 13,62 \$                                     |
| 31. Dezember 2022 | 29.102.703 SEK                     | 104,04 SEK                                   | 62.292 \$                          | 9,83 \$                                      | 14.305.878 \$                      | 11,19 \$                                     |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse USD I*<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD I*<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I2<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD I2<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I4*<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I4*<br>NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|------------------------------------|--|--------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 38.592.200 \$                      | 11,15 \$                                     | 169.464.257 \$                     | 10,70 \$                                     | 66.030.337 \$                        | 11,01 \$                                       |
| 31. Dezember 2023 | 2.616.887 \$                       | 10,42 \$                                     | 42.131.223 \$                      | 9,99 \$                                      | –                                    | –  |
| 31. Dezember 2022 | –                                  | –  | 30.076.757 \$                      | 9,09 \$                                      | –                                    | –  |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse USD I5<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD I5<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD U*<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD U*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD Z<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD Z<br>NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 102.396.246 \$                     | 10,19 \$                                     | 985.817 \$                          | 10,24 \$                                      | 6.537.975 \$                       | 16,74 \$                                     |
| 31. Dezember 2023 | 31.820.798 \$                      | 9,51 \$                                      | –                                   | –   | 723.771 \$                         | 14,15 \$                                     |
| 31. Dezember 2022 | 37.889.294 \$                      | 8,65 \$                                      | –                                   | –   | 491.530 \$                         | 11,53 \$                                     |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Commodities

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>GBP I (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP I (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>GBP I2*<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP I2*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>GBP I3 (nicht<br>währungsgesichert)*<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP I3 (nicht<br>währungsgesichert)*<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---|---|--|--|
| 31. Dezember 2024 | 49.278.081 £   | 9,96 £   | 23.816 £                                | 10,08 £   | 23.859.262 £   | 10,74 £  |
| 31. Dezember 2023 | 42.161.474 £   | 9,20 £   | –                                       | –   | –  | –  |
| 31. Dezember 2022 | 8.401 £  | 10,43 £  | –                                       | –   | –  | –  |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>GBP I5<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP I5<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>GBP P*<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP P*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD A<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD A<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|--|--|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | 22.072.937 £                           | 9,29 £   | 25.474 £                               | 10,69 £  | 1.491.064 \$                          | 9,50 \$   |
| 31. Dezember 2023 | 30.032.518 £                           | 8,74 £   | –                                      | –  | 1.138.135 \$                          | 9,00 \$   |
| 31. Dezember 2022 | 16.248.150 £                           | 9,42 £   | –                                      | –  | 2.916.591 \$                          | 9,71 \$   |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>USD I<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD I3*<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD I3*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD I5<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD I5<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|---|---|--|--|
| 31. Dezember 2024 | 1.749.047 \$                          | 11,13 \$  | 10.112 \$                               | 10,11 \$  | 28.750.029 \$                          | 9,78 \$  |
| 31. Dezember 2023 | 1.744.147 \$                          | 10,47 \$  | –                                       | –   | 55.640.585 \$                          | 9,17 \$  |
| 31. Dezember 2022 | 247.698 \$                            | 11,20 \$  | –                                       | –   | 59.937.610 \$                          | 9,78 \$  |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Commodities (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD M | Thesaurierende Klasse USD M | Thesaurierende Klasse USD Z | Thesaurierende Klasse USD Z |
|-------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
|                   | NIW                         | NIW je Anteil               | NIW                         | NIW je Anteil               |
| 31. Dezember 2024 | 600.530 \$                  | 8,62 \$                     | 3.116.812 \$                | 11,39 \$                    |
| 31. Dezember 2023 | 379.973 \$                  | 8,21 \$                     | 2.438.888 \$                | 10,65 \$                    |
| 31. Dezember 2022 | 432.835 \$                  | 8,91 \$                     | 2.656.009 \$                | 11,32 \$                    |

Corporate Hybrid Bond

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse CHF A* | Ausschüttende Klasse CHF A* | Thesaurierende Klasse CHF I3* | Thesaurierende Klasse CHF I3* |
|-------------------|--|--|-----------------------------|-----------------------------|-------------------------------|-------------------------------|
|                   | NIW                                    | NIW je Anteil                          | NIW                         | NIW je Anteil               | NIW                           | NIW je Anteil                 |
| 31. Dezember 2024 | 8.998.714 AUD                          | 8,19 AUD                               | 4.650.545 CHF               | 10,25 CHF                   | 16.209.652 CHF                | 10,37 CHF                     |
| 31. Dezember 2023 | 5.093.356 AUD                          | 8,02 AUD                               | –                           | –                           | –                             | –                             |
| 31. Dezember 2022 | 4.816.413 AUD                          | 7,88 AUD                               | –                           | –                           | –                             | –                             |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse CHF P | Thesaurierende Klasse CHF P | Ausschüttende Klasse CHF P | Ausschüttende Klasse CHF P | Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) |
|-------------------|-----------------------------|-----------------------------|----------------------------|----------------------------|--|--|
|                   | NIW                         | NIW je Anteil               | NIW                        | NIW je Anteil              | NIW                                    | NIW je Anteil                          |
| 31. Dezember 2024 | 4.081.180 CHF               | 10,89 CHF                   | 27.134.597 CHF             | 9,19 CHF                   | 72.055.508 €                           | 8,30 €                                 |
| 31. Dezember 2023 | 4.766.253 CHF               | 10,24 CHF                   | 1.630.621 CHF              | 9,00 CHF                   | 39.329.425 €                           | 8,09 €                                 |
| 31. Dezember 2022 | 22.917.824 CHF              | 9,64 CHF                    | 1.547.416 CHF              | 8,79 CHF                   | 38.403.169 €                           | 7,91 €                                 |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

|                          | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I<br>NIW je Anteil | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I<br>NIW | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I<br>NIW je Anteil |
|--------------------------|--|--|--|--|---|---|
| <b>Geschäftsjahr zum</b> |  |  |  |  |   |   |
| 31. Dezember 2024        | 224.182.524 €                            | 12,08 €  | 836.439.124 €                            | 13,04 €  | 236.772.780 €                           | 9,82 €  |
| 31. Dezember 2023        | 150.158.972 €                            | 11,14 €  | 861.799.950 €                            | 11,96 €  | 160.639.032 €                           | 9,38 €  |
| 31. Dezember 2022        | 124.371.360 €                            | 10,36 €  | 655.035.193 €                            | 11,06 €  | 92.907.803 €                            | 8,98 €  |

|                          | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I2<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I2<br>NIW je Anteil | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I2<br>NIW | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I2<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I3<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I3<br>NIW je Anteil |
|--------------------------|---|---|--|--|---|---|
| <b>Geschäftsjahr zum</b> |   |   |  |  |   |   |
| 31. Dezember 2024        | 246.290.930 €                             | 12,06 €   | 55.159.224 €                             | 8,95 €   | 102.596.611 €                             | 12,20 €   |
| 31. Dezember 2023        | 258.577.307 €                             | 11,04 €   | 54.536.069 €                             | 8,55 €   | 4.512.654 €                               | 11,16 €   |
| 31. Dezember 2022        | 191.477.785 €                             | 10,20 €   | 177.916.143 €                            | 8,19 €   | 7.208.715 €                               | 10,30 €   |

|                          | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I5<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I5<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M<br>NIW je Anteil | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR M<br>NIW | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR M<br>NIW je Anteil |
|--------------------------|---|---|--|--|---|---|
| <b>Geschäftsjahr zum</b> |   |   |  |  |   |   |
| 31. Dezember 2024        | 137.973.935 €                             | 13,41 €   | 15.377.716 €                             | 12,53 €  | 5.300.635 €                             | 8,01 €  |
| 31. Dezember 2023        | 112.450.285 €                             | 12,26 €   | 11.102.489 €                             | 11,62 €  | 3.338.833 €                             | 7,80 €  |
| 31. Dezember 2022        | 184.534.266 €                             | 11,30 €   | 11.578.693 €                             | 10,88 €  | 3.553.082 €                             | 7,61 €  |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR P<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR P<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse EUR P<br>NIW | Ausschüttende Klasse EUR P<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP I<br>NIW | Thesaurierende Klasse GBP I<br>NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|-----------------------------------|---|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 9.506.519 €                        | 11,62 €                                      | 14.766.411 €                      | 9,85 €                                      | 3.956.135 £                        | 12,81 £                                      |
| 31. Dezember 2023 | 8.972.769 €                        | 10,65 €                                      | 19.262.572 €                      | 9,41 €                                      | 2.291.998 £                        | 11,58 £                                      |
| 31. Dezember 2022 | 37.115.535 €                       | 9,84 €                                       | 4.537.698 €                       | 9,02 €                                      | 5.461.763 £                        | 10,54 £                                      |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse GBP I2<br>NIW | Thesaurierende Klasse GBP I2<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse GBP I2<br>NIW | Ausschüttende Klasse GBP I2<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP P<br>NIW | Thesaurierende Klasse GBP P<br>NIW je Anteil |
|-------------------|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 2.807.111 £                         | 12,65 £                                       | 224.421 £                          | 10,25 £                                      | 3.569.455 £                        | 11,53 £                                      |
| 31. Dezember 2023 | 1.749.168 £                         | 11,42 £                                       | 24.129 £                           | 9,64 £                                       | 1.523.093 £                        | 10,42 £                                      |
| 31. Dezember 2022 | 10.032.613 £                        | 10,38 £                                       | 406.601 £                          | 9,09 £                                       | 6.021.069 £                        | 9,48 £                                       |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse GBP P<br>NIW | Ausschüttende Klasse GBP P<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)<br>NIW je Anteil |
|-------------------|-----------------------------------|---|---|---|---|---|
| 31. Dezember 2024 | 3.826.165 £                       | 9,90 £                                      | 6.842.701 SGD                                 | 16,80 SGD   | 67.843.243 \$                                 | 8,71 \$   |
| 31. Dezember 2023 | 6.890.614 £                       | 9,32 £                                      | 1.755.818 SGD                                 | 16,40 SGD   | 49.232.073 \$                                 | 8,49 \$   |
| 31. Dezember 2022 | 7.470.246 £                       | 8,78 £                                      | 1.412.307 SGD                                 | 16,07 SGD   | 55.263.711 \$                                 | 8,26 \$   |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende         | Thesaurierende                   | Ausschüttende          | Ausschüttende                    | Thesaurierende          | Thesaurierende                    |
|-------------------|------------------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|                   | Klasse<br>USD A<br>NIW | Klasse<br>USD A<br>NIW je Anteil | Klasse<br>USD A<br>NIW | Klasse<br>USD A<br>NIW je Anteil | Klasse<br>USD C1<br>NIW | Klasse<br>USD C1<br>NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2024 | 65.774.875 \$          | 13,52 \$                         | 52.199 \$              | 9,57 \$                          | 2.306.792 \$            | 11,45 \$                          |
| 31. Dezember 2023 | 49.383.201 \$          | 12,27 \$                         | 71.151 \$              | 8,99 \$                          | 3.418.540 \$            | 10,50 \$                          |
| 31. Dezember 2022 | 49.003.214 \$          | 11,18 \$                         | 66.746 \$              | 8,44 \$                          | 5.909.890 \$            | 9,66 \$                           |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende                       | Ausschüttende                                 | Thesaurierende         | Thesaurierende                   | Ausschüttende          | Ausschüttende                    |
|-------------------|-------------------------------------|---|------------------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|
|                   | Klasse<br>USD I (Monatlich)*<br>NIW | Klasse<br>USD I (Monatlich)*<br>NIW je Anteil | Klasse<br>USD I<br>NIW | Klasse<br>USD I<br>NIW je Anteil | Klasse<br>USD I<br>NIW | Klasse<br>USD I<br>NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2024 | 1.060.682 \$                        | 10,09 \$                                      | 97.417.949 \$          | 15,12 \$                         | 11.727.786 \$          | 9,59 \$                          |
| 31. Dezember 2023 | –                                   | –   | 47.532.250 \$          | 13,63 \$                         | 980.224 \$             | 9,01 \$                          |
| 31. Dezember 2022 | –                                   | –   | 54.193.798 \$          | 12,35 \$                         | 1.406.325 \$           | 8,45 \$                          |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende          | Thesaurierende                    | Ausschüttende           | Ausschüttende                     | Thesaurierende         | Thesaurierende                   |
|-------------------|-------------------------|-----------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------|----------------------------------|
|                   | Klasse<br>USD I2<br>NIW | Klasse<br>USD I2<br>NIW je Anteil | Klasse<br>USD I2<br>NIW | Klasse<br>USD I2<br>NIW je Anteil | Klasse<br>USD M<br>NIW | Klasse<br>USD M<br>NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2024 | 15.077.092 \$           | 14,14 \$                          | 35.537.072 \$           | 10,97 \$                          | 10.601.949 \$          | 11,79 \$                         |
| 31. Dezember 2023 | 5.936.845 \$            | 12,74 \$                          | 5.151.520 \$            | 10,31 \$                          | 7.409.176 \$           | 10,76 \$                         |
| 31. Dezember 2022 | 6.709.367 \$            | 11,52 \$                          | 5.086.148 \$            | 9,68 \$                           | 8.149.257 \$           | 9,86 \$                          |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse<br>USD M | Ausschüttende Klasse<br>USD M | Thesaurierende Klasse<br>USD P | Thesaurierende Klasse<br>USD P | Thesaurierende Klasse<br>USD Z | Thesaurierende Klasse<br>USD Z |
|-------------------|-------------------------------|-------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
|                   | NIW                           | NIW je Anteil                 | NIW                            | NIW je Anteil                  | NIW                            | NIW je Anteil                  |
| 31. Dezember 2024 | 2.009.293 \$                  | 8,98 \$                       | 5.208.562 \$                   | 13,47 \$                       | 510.610 \$                     | 14,67 \$                       |
| 31. Dezember 2023 | 2.046.883 \$                  | 8,60 \$                       | 7.705.875 \$                   | 12,14 \$                       | 443.619 \$                     | 13,15 \$                       |
| 31. Dezember 2022 | 2.213.713 \$                  | 8,23 \$                       | 15.462.358 \$                  | 11,00 \$                       | 399.396 \$                     | 11,84 \$                       |

Developed Market FMP – 2027<sup>1</sup>

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>EUR A* | Thesaurierende Klasse<br>EUR A* | Ausschüttende Klasse<br>EUR I* | Ausschüttende Klasse<br>EUR I* | Thesaurierende Klasse<br>USD A* | Thesaurierende Klasse<br>USD A* |
|-------------------|---------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|
|                   | NIW                             | NIW je Anteil                   | NIW                            | NIW je Anteil                  | NIW                             | NIW je Anteil                   |
| 31. Dezember 2024 | 721.072 €                       | 10,62 €                         | 306.364 €                      | 10,32 €                        | 67.159.332 \$                   | 10,88 \$                        |
| 31. Dezember 2023 | 699.973 €                       | 10,31 €                         | 308.247 €                      | 10,38 €                        | 69.482.815 \$                   | 10,38 \$                        |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse<br>USD A* | Ausschüttende Klasse<br>USD A* | Thesaurierende Klasse<br>USD I* | Thesaurierende Klasse<br>USD I* | Ausschüttende Klasse<br>USD I* | Ausschüttende Klasse<br>USD I* |
|-------------------|--------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
|                   | NIW                            | NIW je Anteil                  | NIW                             | NIW je Anteil                   | NIW                            | NIW je Anteil                  |
| 31. Dezember 2024 | 22.250.930 \$                  | 10,46 \$                       | 1.027.880 \$                    | 10,93 \$                        | 2.200.741 \$                   | 10,57 \$                       |
| 31. Dezember 2023 | 27.217.946 \$                  | 10,38 \$                       | 977.254 \$                      | 10,40 \$                        | 2.182.151 \$                   | 10,48 \$                       |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Developed Market FMP – 2027<sup>1</sup> (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD X* | Thesaurierende Klasse USD X* | Ausschüttende Klasse USD X* | Ausschüttende Klasse USD X* |
|-------------------|------------------------------|------------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
|                   | NIW                          | NIW je Anteil                | NIW                         | NIW je Anteil               |
| 31. Dezember 2024 | 33.694.378 \$                | 10,92 \$                     | –                           | –                           |
| 31. Dezember 2023 | 35.874.119 \$                | 10,39 \$                     | 873.350 \$                  | 10,39 \$                    |

## EMD Corporate – Social and Environmental Transition

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse CHF I | Thesaurierende Klasse CHF I | Thesaurierende Klasse CHF I4* | Thesaurierende Klasse CHF I4* | Thesaurierende Klasse EUR A | Thesaurierende Klasse EUR A |
|-------------------|-----------------------------|-----------------------------|-------------------------------|-------------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
|                   | NIW                         | NIW je Anteil               | NIW                           | NIW je Anteil                 | NIW                         | NIW je Anteil               |
| 31. Dezember 2024 | 21.804.338 CHF              | 11,82 CHF                   | –                             | –                             | 58.381 €                    | 11,01 €                     |
| 31. Dezember 2023 | 14.179.749 CHF              | 11,37 CHF                   | –                             | –                             | 76.508 €                    | 10,41 €                     |
| 31. Dezember 2022 | 11.340.526 CHF              | 10,96 CHF                   | 4.061.234 CHF                 | 8,89 CHF                      | 630.955 €                   | 9,94 €                      |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR I | Thesaurierende Klasse EUR I | Thesaurierende Klasse EUR I3 | Thesaurierende Klasse EUR I3 | Thesaurierende Klasse EUR M | Thesaurierende Klasse EUR M |
|-------------------|-----------------------------|-----------------------------|------------------------------|------------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
|                   | NIW                         | NIW je Anteil               | NIW                          | NIW je Anteil                | NIW                         | NIW je Anteil               |
| 31. Dezember 2024 | 57.645 €                    | 12,87 €                     | 277.863 €                    | 11,06 €                      | 597.490 €                   | 10,38 €                     |
| 31. Dezember 2023 | 321.714 €                   | 12,07 €                     | 234.610 €                    | 10,33 €                      | 544.903 €                   | 9,88 €                      |
| 31. Dezember 2022 | 525.213 €                   | 11,42 €                     | 236.709 €                    | 9,75 €                       | 533.388 €                   | 9,51 €                      |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

EMD Corporate – Social and Environmental Transition (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse<br>EUR M<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>EUR M<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>EUR X<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>EUR X<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>GBP I<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP I<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--------------------------------------|--|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | 543.822 €                            | 6,52 €   | 57.603.259 €                          | 11,78 €   | 11.279 £                              | 14,34 £   |
| 31. Dezember 2023 | 447.000 €                            | 6,56 €   | 44.702.260 €                          | 10,99 €   | 10.422 £                              | 13,25 £   |
| 31. Dezember 2022 | 383.031 €                            | 6,66 €   | 42.148.804 €                          | 10,36 €   | 26.641 £                              | 12,35 £   |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>SEK A<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>SEK A<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>USD A (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>USD A (Monatlich)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD A<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD A<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|--|--|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | 1.968.913 SEK                         | 96,94 SEK                                       | 764.670 \$                                       | 7,37 \$  | 6.775.597 \$                          | 14,11 \$  |
| 31. Dezember 2023 | 2.108.721 SEK                         | 91,82 SEK                                       | 689.907 \$                                       | 7,40 \$  | 5.070.217 \$                          | 13,10 \$  |
| 31. Dezember 2022 | 2.904.877 SEK                         | 87,48 SEK                                       | 625.857 \$                                       | 7,32 \$  | 6.344.534 \$                          | 12,24 \$  |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>USD C1<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD C1<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD I<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD I<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>USD I<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>USD I<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---------------------------------------|---|--------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 611.414 \$                             | 10,53 \$   | 15.800.299 \$                         | 15,45 \$  | 2.397.737 \$                         | 9,42 \$  |
| 31. Dezember 2023 | 667.644 \$                             | 9,88 \$  | 18.637.882 \$                         | 14,24 \$  | 2.390.542 \$                         | 9,07 \$  |
| 31. Dezember 2022 | 648.535 \$                             | 9,32 \$  | 20.881.275 \$                         | 13,20 \$  | 2.641.379 \$                         | 8,77 \$  |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## EMD Corporate – Social and Environmental Transition (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende          | Thesaurierende                    | Thesaurierende           | Thesaurierende                     | Thesaurierende         | Thesaurierende                   |
|-------------------|-------------------------|-----------------------------------|--------------------------|------------------------------------|------------------------|----------------------------------|
|                   | Klasse<br>USD I2<br>NIW | Klasse<br>USD I2<br>NIW je Anteil | Klasse<br>USD I5*<br>NIW | Klasse<br>USD I5*<br>NIW je Anteil | Klasse<br>USD M<br>NIW | Klasse<br>USD M<br>NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2024 | 560.635 \$              | 14,02 \$                          | –                        | –                                  | 792.508 \$             | 10,63 \$                         |
| 31. Dezember 2023 | 515.679 \$              | 12,89 \$                          | –                        | –                                  | 863.972 \$             | 9,95 \$                          |
| 31. Dezember 2022 | 775.368 \$              | 11,93 \$                          | 338.193 \$               | 12,32 \$                           | 752.825 \$             | 9,38 \$                          |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende          | Ausschüttende                    |
|-------------------|------------------------|----------------------------------|
|                   | Klasse<br>USD M<br>NIW | Klasse<br>USD M<br>NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2024 | 524.489 \$             | 7,32 \$                          |
| 31. Dezember 2023 | 692.358 \$             | 7,24 \$                          |
| 31. Dezember 2022 | 657.453 \$             | 7,19 \$                          |

## Emerging Market Debt – Hard Currency

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende                      | Ausschüttende                                | Ausschüttende          | Ausschüttende                    | Thesaurierende                                       | Thesaurierende   |
|-------------------|------------------------------------|--|------------------------|----------------------------------|--|--|
|                   | Klasse<br>AUD A (Monatlich)<br>NIW | Klasse<br>AUD A (Monatlich)<br>NIW je Anteil | Klasse<br>AUD I<br>NIW | Klasse<br>AUD I<br>NIW je Anteil | Klasse<br>CAD I3 (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW | Klasse<br>CAD I3 (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2024 | 562.566 AUD                        | 7,24 AUD                                     | 19.959 AUD             | 8,87 AUD                         | 65.175.495 CAD                                       | 15,16 CAD  |
| 31. Dezember 2023 | 1.943.558 AUD                      | 7,08 AUD                                     | 23.198.262 AUD         | 8,31 AUD                         | 52.703.579 CAD                                       | 12,26 CAD  |
| 31. Dezember 2022 | 2.134.881 AUD                      | 6,88 AUD                                     | 21.672.088 AUD         | 7,81 AUD                         | 47.479.252 CAD                                       | 11,04 CAD  |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt – Hard Currency (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse CHF I2<br>NIW | Thesaurierende Klasse CHF I2<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse CHF P<br>NIW | Thesaurierende Klasse CHF P<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)<br>NIW je Anteil |
|-------------------|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|---|---|
| 31. Dezember 2024 | 89.113.910 CHF                      | 9,17 CHF                                      | 15.922.402 CHF                     | 9,22 CHF                                     | 6.372.120 €                                   | 6,45 €  |
| 31. Dezember 2023 | 134.304.949 CHF                     | 8,45 CHF                                      | 25.327.791 CHF                     | 8,51 CHF                                     | 7.633.978 €                                   | 6,33 €  |
| 31. Dezember 2022 | 161.496.077 CHF                     | 7,73 CHF                                      | 21.658.399 CHF                     | 7,79 CHF                                     | 7.363.041 €                                   | 6,20 €  |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR A<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR A<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)<br>NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|------------------------------------|--|--|--|
| 31. Dezember 2024 | 47.537.822 €                       | 11,62 €                                      | 125.166.767 €                      | 12,74 €                                      | 20.531.532 €   | 11,73 €  |
| 31. Dezember 2023 | 51.163.108 €                       | 10,53 €                                      | 89.529.420 €                       | 11,46 €                                      | 17.230.269 €   | 9,70 €   |
| 31. Dezember 2022 | 32.580.202 €                       | 9,53 €                                       | 118.505.956 €                      | 10,31 €                                      | 17.296.623 €   | 8,82 €   |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse EUR I<br>NIW | Ausschüttende Klasse EUR I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I2<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I2<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse EUR I2<br>NIW | Ausschüttende Klasse EUR I2<br>NIW je Anteil |
|-------------------|-----------------------------------|---|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 157.062.388 €                     | 7,27 €                                      | 22.672.676 €                        | 9,75 €  | 38.073.033 €                       | 7,80 €                                       |
| 31. Dezember 2023 | 175.147.404 €                     | 6,86 €                                      | 45.795.061 €                        | 8,77 €  | 36.308.806 €                       | 7,36 €                                       |
| 31. Dezember 2022 | 178.942.116 €                     | 6,49 €                                      | 61.386.430 €                        | 7,87 €  | 32.976.153 €                       | 6,96 €                                       |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt – Hard Currency (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR I3<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I3<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert)*<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert)*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I4<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I4<br>NIW je Anteil |
|-------------------|-------------------------------------|---|--|--|-------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | 73.839.281 €                        | 10,96 €                                       | –  | –  | 127.093.943 €                       | 12,40 €                                       |
| 31. Dezember 2023 | 68.995.700 €                        | 9,84 €  | –  | –  | 44.153.327 €                        | 11,13 €                                       |
| 31. Dezember 2022 | 101.186.993 €                       | 8,83 €  | 29.023.972 €   | 8,76 €   | 106.621.915 €                       | 9,97 €  |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR M<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR M<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse EUR M<br>NIW | Ausschüttende Klasse EUR M<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---|---|------------------------------------|--|-----------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | 74.439.838 €  | 13,38 €   | 523.414 €                          | 10,73 €                                      | 104.388 €                         | 6,58 €                                      |
| 31. Dezember 2023 | 89.770.039 €  | 11,04 €   | 525.911 €                          | 9,81 €                                       | 138.890 €                         | 6,36 €                                      |
| 31. Dezember 2022 | 68.627.475 €  | 10,00 €   | 625.349 €                          | 8,95 €                                       | 136.677 €                         | 6,16 €                                      |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR P<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR P<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR Z<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR Z<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP I<br>NIW | Thesaurierende Klasse GBP I<br>NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 11.970.004 €                       | 9,88 €                                       | 739.148 €                          | 10,37 €                                      | 5.881.900 £                        | 12,15 £                                      |
| 31. Dezember 2023 | 10.477.004 €                       | 8,88 €                                       | 551.473 €                          | 9,27 €                                       | 14.312.566 £                       | 10,78 £                                      |
| 31. Dezember 2022 | 9.665.588 €                        | 7,98 €                                       | 298.344 €                          | 8,27 €                                       | 16.360.366 £                       | 9,55 £                                       |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt – Hard Currency (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse<br>GBP I<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>GBP I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>GBP I2<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP I2<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>GBP I2<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>GBP I2<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--------------------------------------|--|--|--|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | 957.644 £                            | 7,97 £   | 7.422.512 £                            | 10,70 £  | 11.314.784 £                          | 8,29 £  |
| 31. Dezember 2023 | 1.045.922 £                          | 7,41 £   | 52.006.312 £                           | 9,48 £   | 14.500.268 £                          | 7,71 £  |
| 31. Dezember 2022 | 1.864.069 £                          | 6,91 £   | 31.637.924 £                           | 8,39 £   | 11.800.925 £                          | 7,18 £  |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>GBP P<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP P<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>HKD A (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>HKD A (Monatlich)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>JPY I<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>JPY I<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|--|--|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | 2.828.686 £                           | 10,90 £   | 3.938.784 HKD                                    | 7,84 HKD   | 1.661.927.078 ¥                       | 934,96 ¥  |
| 31. Dezember 2023 | 6.285.375 £                           | 9,67 £  | 1.470.947 HKD                                    | 7,64 HKD   | 1.753.662.260 ¥                       | 876,83 ¥  |
| 31. Dezember 2022 | 7.543.092 £                           | 8,56 £  | 1.259.413 HKD                                    | 7,38 HKD   | 1.632.621.347 ¥                       | 816,31 ¥  |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>SEK A<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>SEK A<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>SEK I2<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>SEK I2<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>SGD A (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>SGD A (Monatlich)<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|--|--|--|--|
| 31. Dezember 2024 | 120.426.982 SEK                       | 111,64 SEK                                      | 59.693.719 SEK                         | 95,92 SEK  | 49.334.689 SGD                                   | 14,58 SGD  |
| 31. Dezember 2023 | 650.472.349 SEK                       | 101,47 SEK                                      | 66.952.498 SEK                         | 86,45 SEK  | 19.324.573 SGD                                   | 14,34 SGD  |
| 31. Dezember 2022 | 1.276.699.611 SEK                     | 91,78 SEK                                       | 135.368.249 SEK                        | 77,53 SEK  | 16.860.018 SGD                                   | 13,92 SGD  |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt – Hard Currency (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse<br>USD A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse<br>USD A (Monatlich) | Thesaurierende Klasse<br>USD A | Thesaurierende Klasse<br>USD A | Ausschüttende Klasse<br>USD A | Ausschüttende Klasse<br>USD A |
|-------------------|---|---|--------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|
|                   | NIW                                       | NIW je Anteil                             | NIW                            | NIW je Anteil                  | NIW                           | NIW je Anteil                 |
| 31. Dezember 2024 | 137.447.461 \$                            | 7,48 \$                                   | 127.573.860 \$                 | 14,30 \$                       | 1.022.107 \$                  | 9,02 \$                       |
| 31. Dezember 2023 | 138.241.930 \$                            | 7,21 \$                                   | 120.778.298 \$                 | 12,73 \$                       | 377.098 \$                    | 8,36 \$                       |
| 31. Dezember 2022 | 144.691.919 \$                            | 6,89 \$                                   | 112.403.688 \$                 | 11,26 \$                       | 42.552 \$                     | 7,74 \$                       |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>USD C1 | Thesaurierende Klasse<br>USD C1 | Thesaurierende Klasse<br>USD I | Thesaurierende Klasse<br>USD I | Ausschüttende Klasse<br>USD I | Ausschüttende Klasse<br>USD I |
|-------------------|---------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|
|                   | NIW                             | NIW je Anteil                   | NIW                            | NIW je Anteil                  | NIW                           | NIW je Anteil                 |
| 31. Dezember 2024 | 9.257.977 \$                    | 10,52 \$                        | 710.084.406 \$                 | 15,51 \$                       | 83.660.544 \$                 | 8,98 \$                       |
| 31. Dezember 2023 | 9.941.291 \$                    | 9,46 \$                         | 571.487.781 \$                 | 13,71 \$                       | 73.431.118 \$                 | 8,32 \$                       |
| 31. Dezember 2022 | 10.176.824 \$                   | 8,45 \$                         | 583.066.950 \$                 | 12,04 \$                       | 80.694.053 \$                 | 7,70 \$                       |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>USD I2 | Thesaurierende Klasse<br>USD I2 | Ausschüttende Klasse<br>USD I2 | Ausschüttende Klasse<br>USD I2 | Ausschüttende Klasse<br>USD I3 | Ausschüttende Klasse<br>USD I3 |
|-------------------|---------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
|                   | NIW                             | NIW je Anteil                   | NIW                            | NIW je Anteil                  | NIW                            | NIW je Anteil                  |
| 31. Dezember 2024 | 261.135.147 \$                  | 13,49 \$                        | 27.440.927 \$                  | 8,70 \$                        | 95.204.876 \$                  | 8,86 \$                        |
| 31. Dezember 2023 | 273.160.580 \$                  | 11,91 \$                        | 19.503.916 \$                  | 8,07 \$                        | 88.359.188 \$                  | 8,22 \$                        |
| 31. Dezember 2022 | 33.738.168 \$                   | 10,45 \$                        | 13.108.552 \$                  | 7,47 \$                        | 81.371.873 \$                  | 7,60 \$                        |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt – Hard Currency (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD M<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD M<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD M<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD M<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD P<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD P<br>NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|-----------------------------------|---|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 23.705.906 \$                      | 10,65 \$                                     | 4.577.564 \$                      | 7,12 \$                                     | 67.615.653 \$                      | 11,53 \$                                     |
| 31. Dezember 2023 | 17.071.508 \$                      | 9,56 \$                                      | 3.623.006 \$                      | 6,75 \$                                     | 62.007.224 \$                      | 10,19 \$                                     |
| 31. Dezember 2022 | 16.134.339 \$                      | 8,52 \$                                      | 3.112.446 \$                      | 6,39 \$                                     | 17.590.354 \$                      | 8,95 \$                                      |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD X<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD X<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD Z<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD Z<br>NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 163.365.866 \$                     | 10,56 \$                                     | 69.609 \$                          | 13,09 \$                                     |
| 31. Dezember 2023 | 112.274.225 \$                     | 9,30 \$                                      | 112.030 \$                         | 11,49 \$                                     |
| 31. Dezember 2022 | 98.360.925 \$                      | 8,15 \$                                      | 97.737 \$                          | 10,02 \$                                     |

Emerging Market Debt – Local Currency

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse AUD B<br>NIW | Thesaurierende Klasse AUD B<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich)*<br>NIW | Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich)*<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---|---|------------------------------------|--|---|---|
| 31. Dezember 2024 | 854.701 AUD                                   | 2,99 AUD  | 181.139 AUD                        | 7,78 AUD                                     | –   | –   |
| 31. Dezember 2023 | 1.680.905 AUD                                 | 3,51 AUD  | 288.975 AUD                        | 8,34 AUD                                     | –   | –   |
| 31. Dezember 2022 | 3.579.112 AUD                                 | 3,54 AUD  | 279.747 AUD                        | 7,62 AUD                                     | 67.549 AUD                                      | 3,53 AUD  |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt – Local Currency (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse AUD C2* | Thesaurierende Klasse AUD C2* | Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich) | Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich) | Thesaurierende Klasse AUD E | Thesaurierende Klasse AUD E |
|-------------------|-------------------------------|-------------------------------|--|--|-----------------------------|-----------------------------|
|                   | NIW                           | NIW je Anteil                 | NIW                                    | NIW je Anteil                          | NIW                         | NIW je Anteil               |
| 31. Dezember 2024 | –                             | –                             | 175.275 AUD                            | 2,99 AUD                               | 11.617 AUD                  | 7,78 AUD                    |
| 31. Dezember 2023 | 7.713 AUD                     | 8,34 AUD                      | 508.897 AUD                            | 3,52 AUD                               | 68.860 AUD                  | 8,33 AUD                    |
| 31. Dezember 2022 | 7.870 AUD                     | 7,61 AUD                      | 399.839 AUD                            | 3,54 AUD                               | 43.406 AUD                  | 7,61 AUD                    |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) | Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) | Thesaurierende Klasse AUD T | Thesaurierende Klasse AUD T | Thesaurierende Klasse EUR A | Thesaurierende Klasse EUR A |
|-------------------|--|--|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
|                   | NIW                                    | NIW je Anteil                          | NIW                         | NIW je Anteil               | NIW                         | NIW je Anteil               |
| 31. Dezember 2024 | 20.069.696 AUD                         | 3,30 AUD                               | 1.932.214 AUD               | 8,55 AUD                    | 453.805 €                   | 6,76 €                      |
| 31. Dezember 2023 | 25.930.999 AUD                         | 3,82 AUD                               | 2.144.666 AUD               | 9,07 AUD                    | 1.976.819 €                 | 7,19 €                      |
| 31. Dezember 2022 | 27.559.985 AUD                         | 3,81 AUD                               | 2.188.886 AUD               | 8,21 AUD                    | 2.710.862 €                 | 6,52 €                      |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR I | Thesaurierende Klasse EUR I | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) | Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert) | Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert) |
|-------------------|-----------------------------|-----------------------------|---|---|--|--|
|                   | NIW                         | NIW je Anteil               | NIW   | NIW je Anteil   | NIW  | NIW je Anteil  |
| 31. Dezember 2024 | 15.726.678 €                | 7,35 €                      | 155.859.903 €   | 10,46 €   | 6.526.244 €  | 12,36 €  |
| 31. Dezember 2023 | 26.979.998 €                | 7,76 €                      | 160.972.265 €   | 10,15 €   | 15.466.180 €   | 11,97 €  |
| 31. Dezember 2022 | 12.677.170 €                | 6,99 €                      | 153.261.974 €   | 9,22 €  | 13.077.476 €   | 10,86 €  |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt – Local Currency (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse<br>EUR I4 (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>EUR I4 (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>EUR Y (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>EUR Y (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>GBP I<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP I<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|--|--|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | 19.130.526 €   | 7,42 €   | 87.330.814 €   | 10,54 €  | 419.035 £                             | 8,30 £  |
| 31. Dezember 2023 | 19.486.748 €   | 7,57 €   | 78.895.093 €   | 10,18 €  | 371.999 £                             | 8,63 £  |
| 31. Dezember 2022 | 18.536.988 €   | 7,20 €   | 79.014.824 €   | 9,22 €   | 71.487 £                              | 7,65 £  |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>GBP I4 (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP I4 (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>GBP I4 (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>GBP I4 (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>GBP Y (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP Y (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---|---|--|--|--|--|
| 31. Dezember 2024 | 87.779.237 £  | 10,28 £   | 202.000 £  | 6,93 £   | 26.877.584 £   | 9,82 £   |
| 31. Dezember 2023 | 80.057.410 £  | 10,42 £   | 40.220.459 £   | 7,40 £   | 37.033.049 £   | 9,95 £   |
| 31. Dezember 2022 | 55.720.554 £  | 9,67 £  | 34.761.741 £   | 7,20 £   | 51.131.054 £   | 9,22 £   |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>SEK A<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>SEK A<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>SGD A (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>SGD A (Monatlich)<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>USD A (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>USD A (Monatlich)<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|--|--|--|--|
| 31. Dezember 2024 | 4.682.602 SEK                         | 83,11 SEK                                       | 553.325 SGD                                      | 9,64 SGD   | 3.342.310 \$                                     | 4,44 \$  |
| 31. Dezember 2023 | 7.555.579 SEK                         | 88,68 SEK                                       | 715.536 SGD                                      | 11,03 SGD  | 3.826.624 \$                                     | 4,97 \$  |
| 31. Dezember 2022 | 8.262.545 SEK                         | 80,46 SEK                                       | 431.283 SGD                                      | 10,66 SGD  | 2.763.181 \$                                     | 4,73 \$  |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt – Local Currency (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD A | Thesaurierende Klasse USD A | Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich) | Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich) | Thesaurierende Klasse USD B | Thesaurierende Klasse USD B |
|-------------------|-----------------------------|-----------------------------|--|--|-----------------------------|-----------------------------|
|                   | NIW                         | NIW je Anteil               | NIW                                    | NIW je Anteil                          | NIW                         | NIW je Anteil               |
| 31. Dezember 2024 | 9.349.818 \$                | 8,43 \$                     | 5.933.285 \$                           | 3,47 \$                                | 398.599 \$                  | 8,43 \$                     |
| 31. Dezember 2023 | 13.576.056 \$               | 8,79 \$                     | 11.403.018 \$                          | 4,02 \$                                | 516.378 \$                  | 8,91 \$                     |
| 31. Dezember 2022 | 13.383.059 \$               | 7,78 \$                     | 11.674.878 \$                          | 3,97 \$                                | 507.723 \$                  | 7,99 \$                     |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich)* | Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich)* | Thesaurierende Klasse USD C2* | Thesaurierende Klasse USD C2* | Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich) | Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich) |
|-------------------|--|--|-------------------------------|-------------------------------|--|--|
|                   | NIW                                      | NIW je Anteil                            | NIW                           | NIW je Anteil                 | NIW                                    | NIW je Anteil                          |
| 31. Dezember 2024 | –  | –  | –                             | –                             | 1.252.826 \$                           | 3,47 \$                                |
| 31. Dezember 2023 | 3.620 \$                                 | 4,02 \$                                  | –                             | –                             | 1.731.121 \$                           | 4,02 \$                                |
| 31. Dezember 2022 | 523.171 \$                               | 3,97 \$                                  | 22.894 \$                     | 7,99 \$                       | 3.285.216 \$                           | 3,97 \$                                |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD E | Thesaurierende Klasse USD E | Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) | Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) | Thesaurierende Klasse USD I | Thesaurierende Klasse USD I |
|-------------------|-----------------------------|-----------------------------|--|--|-----------------------------|-----------------------------|
|                   | NIW                         | NIW je Anteil               | NIW                                    | NIW je Anteil                          | NIW                         | NIW je Anteil               |
| 31. Dezember 2024 | 21.222 \$                   | 8,44 \$                     | 9.750.921 \$                           | 7,16 \$                                | 150.964.126 \$              | 9,20 \$                     |
| 31. Dezember 2023 | 259.037 \$                  | 8,92 \$                     | 36.107.420 \$                          | 7,97 \$                                | 194.371.958 \$              | 9,52 \$                     |
| 31. Dezember 2022 | 313.230 \$                  | 7,99 \$                     | 39.776.506 \$                          | 7,52 \$                                | 373.741.103 \$              | 8,36 \$                     |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt – Local Currency (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse USD I<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I2<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I2<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I5<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I5<br>NIW je Anteil |
|-------------------|-----------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | 1.158.416 \$                      | 6,94 \$                                     | 69.799.631 \$                       | 8,96 \$                                       | 15.635 \$                           | 9,89 \$                                       |
| 31. Dezember 2023 | 1.184.970 \$                      | 7,55 \$                                     | 70.501.757 \$                       | 9,26 \$                                       | 16.123 \$                           | 10,20 \$                                      |
| 31. Dezember 2022 | 537.178 \$                        | 6,94 \$                                     | 54.407.790 \$                       | 8,12 \$                                       | 18 \$                               | 9,08 \$                                       |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD T<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD T<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD X<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD X<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---|---|------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 40.831.524 \$                                 | 3,89 \$   | 3.429.519 \$                       | 9,28 \$                                      | 130.172.826 \$                     | 9,18 \$                                      |
| 31. Dezember 2023 | 51.105.062 \$                                 | 4,45 \$   | 4.366.661 \$                       | 9,71 \$                                      | 142.192.091 \$                     | 9,46 \$                                      |
| 31. Dezember 2022 | 48.894.990 \$                                 | 4,35 \$   | 4.066.572 \$                       | 8,61 \$                                      | 141.579.673 \$                     | 8,27 \$                                      |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD Y<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD Y<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse ZAR B<br>NIW | Thesaurierende Klasse ZAR B<br>NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|---|---|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 167.681.645 \$                     | 8,91 \$                                      | 25.094.703 ZAR                                | 31,27 ZAR   | 5.996.987 ZAR                      | 119,58 ZAR                                   |
| 31. Dezember 2023 | 158.436.161 \$                     | 9,18 \$                                      | 46.066.036 ZAR                                | 36,52 ZAR   | 12.043.264 ZAR                     | 123,28 ZAR                                   |
| 31. Dezember 2022 | 154.229.779 \$                     | 8,03 \$                                      | 123.706.182 ZAR                               | 36,58 ZAR   | 6.630.951 ZAR                      | 107,97 ZAR                                   |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt – Local Currency (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse | Ausschüttende Klasse | Thesaurierende Klasse | Thesaurierende Klasse | Ausschüttende Klasse | Ausschüttende Klasse |
|-------------------|----------------------|----------------------|-----------------------|-----------------------|----------------------|----------------------|
|                   | ZAR C2 (Monatlich)*  | ZAR C2 (Monatlich)*  | ZAR C2*               | ZAR C2*               | ZAR E (Monatlich)    | ZAR E (Monatlich)    |
|                   | NIW                  | NIW je Anteil        | NIW                   | NIW je Anteil         | NIW                  | NIW je Anteil        |
| 31. Dezember 2024 | –                    | –                    | –                     | –                     | 13.606.898 ZAR       | 31,27 ZAR            |
| 31. Dezember 2023 | 68.175 ZAR           | 36,53 ZAR            | 193.673 ZAR           | 121,37 ZAR            | 14.044.410 ZAR       | 36,52 ZAR            |
| 31. Dezember 2022 | 2.919.213 ZAR        | 36,57 ZAR            | 99.096 ZAR            | 107,97 ZAR            | 20.692.248 ZAR       | 36,58 ZAR            |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse | Thesaurierende Klasse | Ausschüttende Klasse | Ausschüttende Klasse | Thesaurierende Klasse | Thesaurierende Klasse |
|-------------------|-----------------------|-----------------------|----------------------|----------------------|-----------------------|-----------------------|
|                   | ZAR E                 | ZAR E                 | ZAR T (Monatlich)    | ZAR T (Monatlich)    | ZAR T                 | ZAR T                 |
|                   | NIW                   | NIW je Anteil         | NIW                  | NIW je Anteil        | NIW                   | NIW je Anteil         |
| 31. Dezember 2024 | 121.590 ZAR           | 119,59 ZAR            | 440.484.307 ZAR      | 34,53 ZAR            | 32.234.335 ZAR        | 131,64 ZAR            |
| 31. Dezember 2023 | 223.552 ZAR           | 123,23 ZAR            | 562.071.052 ZAR      | 39,80 ZAR            | 48.967.524 ZAR        | 134,35 ZAR            |
| 31. Dezember 2022 | 790.752 ZAR           | 107,98 ZAR            | 549.054.261 ZAR      | 39,47 ZAR            | 40.857.889 ZAR        | 116,49 ZAR            |

## Emerging Market Debt Blend

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse | Ausschüttende Klasse | Thesaurierende Klasse | Thesaurierende Klasse | Thesaurierende Klasse | Thesaurierende Klasse |
|-------------------|----------------------|----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
|                   | AUD I3               | AUD I3               | EUR A                 | EUR A                 | EUR I                 | EUR I                 |
|                   | NIW                  | NIW je Anteil        | NIW                   | NIW je Anteil         | NIW                   | NIW je Anteil         |
| 31. Dezember 2024 | 8.858.031 AUD        | 8,15 AUD             | 9.148.199 €           | 10,95 €               | 273.071.973 €         | 11,40 €               |
| 31. Dezember 2023 | 8.072.686 AUD        | 7,96 AUD             | 10.852.194 €          | 10,46 €               | 239.809.262 €         | 10,81 €               |
| 31. Dezember 2022 | 8.275.300 AUD        | 7,49 AUD             | 10.503.424 €          | 9,66 €                | 206.919.548 €         | 9,92 €                |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse EUR I<br>NIW | Ausschüttende Klasse EUR I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I2<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I2<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse EUR I2<br>NIW | Ausschüttende Klasse EUR I2<br>NIW je Anteil |
|-------------------|-----------------------------------|---|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 19.324.446 €                      | 7,26 €                                      | 9.432.926 €                         | 11,74 €                                       | 8.402.410 €                        | 7,07 €                                       |
| 31. Dezember 2023 | 23.015.364 €                      | 7,22 €                                      | 13.866.675 €                        | 11,12 €                                       | 8.681.343 €                        | 7,03 €                                       |
| 31. Dezember 2022 | 24.719.131 €                      | 6,93 €                                      | 19.433.459 €                        | 10,19 €                                       | 9.667.380 €                        | 6,74 €                                       |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse EUR I3<br>NIW | Ausschüttende Klasse EUR I3<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I5<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I5<br>NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|---|---|-------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | 31.778.583 €                       | 7,86 €                                       | 2.228.501 €   | 11,75 €   | 21.714.379 €                        | 12,45 €                                       |
| 31. Dezember 2023 | 37.124.103 €                       | 7,83 €                                       | 1.921.897 €   | 10,67 €   | 20.761.167 €                        | 11,77 €                                       |
| 31. Dezember 2022 | 22.443 €                           | 7,48 €                                       | 579.587 €   | 9,81 €  | 21.116.810 €                        | 10,76 €                                       |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR M<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR M<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse EUR M<br>NIW | Ausschüttende Klasse EUR M<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR Z<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR Z<br>NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|-----------------------------------|---|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 863.870 €                          | 10,40 €                                      | 3.496.307 €                       | 5,77 €                                      | 230.254 €                          | 12,42 €                                      |
| 31. Dezember 2023 | 523.183 €                          | 10,02 €                                      | 1.045.469 €                       | 5,99 €                                      | 153.104 €                          | 11,70 €                                      |
| 31. Dezember 2022 | 497.438 €                          | 9,32 €                                       | 241.149 €                         | 6,05 €                                      | 101.072 €                          | 10,65 €                                      |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>GBP I<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>GBP I (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP I (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>GBP I<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>GBP I<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|--|--|--------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 326.242 £                             | 12,00 £   | 5.599 £  | 11,04 £  | 627.995 £                            | 7,96 £   |
| 31. Dezember 2023 | 447.473 £                             | 11,57 £   | 5.642 £  | 10,53 £  | 9.742.793 £                          | 8,05 £   |
| 31. Dezember 2022 | 350.186 £                             | 10,65 £   | 5.345 £  | 9,93 £   | 11.265.349 £                         | 7,75 £   |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse<br>GBP I (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>GBP I (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>GBP P<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP P<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>GBP P (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP P (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---|---|---------------------------------------|---|--|--|
| 31. Dezember 2024 | 2.022.211 £   | 8,48 £  | 658.167 £                             | 10,51 £   | 317.073 £  | 10,93 £  |
| 31. Dezember 2023 | 572.809 £   | 8,49 £  | 3.109.393 £                           | 10,14 £   | 925.166 £  | 10,44 £  |
| 31. Dezember 2022 | 560.698 £   | 8,39 £  | 6.745.122 £                           | 9,33 £  | 962.313 £  | 9,85 £   |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>GBP Z<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP Z<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>NOK U<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>NOK U<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>SEK A<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>SEK A<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | 24.728 £                              | 13,18 £   | 277.256 NOK                           | 121,30 NOK                                      | 24.002.087 SEK                        | 119,17 SEK                                      |
| 31. Dezember 2023 | 213.173 £                             | 12,62 £   | 256.896 NOK                           | 112,39 NOK                                      | 26.654.232 SEK                        | 112,47 SEK                                      |
| 31. Dezember 2022 | 194.796 £                             | 11,54 £   | 228.017 NOK                           | 99,75 NOK                                       | 27.339.928 SEK                        | 103,59 SEK                                      |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | Thesaurierende Klasse USD A | Thesaurierende Klasse USD A |
|-------------------|--|--|--|--|-----------------------------|-----------------------------|
|                   | NIW                                    | NIW je Anteil                          | NIW                                    | NIW je Anteil                          | NIW                         | NIW je Anteil               |
| 31. Dezember 2024 | 4.264.885 SGD                          | 12,16 SGD                              | 659.583 \$                             | 6,24 \$                                | 6.902.101 \$                | 11,94 \$                    |
| 31. Dezember 2023 | 4.180.476 SGD                          | 12,67 SGD                              | 329.767 \$                             | 6,55 \$                                | 6.722.677 \$                | 11,69 \$                    |
| 31. Dezember 2022 | 4.038.162 SGD                          | 12,31 SGD                              | 342.321 \$                             | 6,26 \$                                | 10.292.897 \$               | 10,49 \$                    |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD C1 | Thesaurierende Klasse USD C1 | Thesaurierende Klasse USD I | Thesaurierende Klasse USD I | Ausschüttende Klasse USD I | Ausschüttende Klasse USD I |
|-------------------|------------------------------|------------------------------|-----------------------------|-----------------------------|----------------------------|----------------------------|
|                   | NIW                          | NIW je Anteil                | NIW                         | NIW je Anteil               | NIW                        | NIW je Anteil              |
| 31. Dezember 2024 | 695.774 \$                   | 9,19 \$                      | 18.511.468 \$               | 11,38 \$                    | 332.937 \$                 | 8,09 \$                    |
| 31. Dezember 2023 | 826.659 \$                   | 9,08 \$                      | 16.801.138 \$               | 11,06 \$                    | 379.773 \$                 | 8,25 \$                    |
| 31. Dezember 2022 | 1.059.311 \$                 | 8,23 \$                      | 27.687.499 \$               | 9,85 \$                     | 417.314 \$                 | 7,69 \$                    |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse USD I2 | Ausschüttende Klasse USD I2 | Thesaurierende Klasse USD I3* | Thesaurierende Klasse USD I3* | Thesaurierende Klasse USD I5* | Thesaurierende Klasse USD I5* |
|-------------------|-----------------------------|-----------------------------|-------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|
|                   | NIW                         | NIW je Anteil               | NIW                           | NIW je Anteil                 | NIW                           | NIW je Anteil                 |
| 31. Dezember 2024 | 44.905.136 \$               | 7,42 \$                     | –                             | –                             | 35.040.341 \$                 | 10,74 \$                      |
| 31. Dezember 2023 | 40.972.944 \$               | 7,57 \$                     | –                             | –                             | 33.920.715 \$                 | 10,40 \$                      |
| 31. Dezember 2022 | 38.999.171 \$               | 7,05 \$                     | 41.113.489 \$                 | 8,98 \$                       | –                             | –                             |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende         | Thesaurierende                   | Ausschüttende          | Ausschüttende                    | Thesaurierende         | Thesaurierende                   |
|-------------------|------------------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|
|                   | Klasse<br>USD M<br>NIW | Klasse<br>USD M<br>NIW je Anteil | Klasse<br>USD M<br>NIW | Klasse<br>USD M<br>NIW je Anteil | Klasse<br>USD Z<br>NIW | Klasse<br>USD Z<br>NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2024 | 437.839 \$             | 9,29 \$                          | 276.908 \$             | 5,69 \$                          | 120.997 \$             | 13,71 \$                         |
| 31. Dezember 2023 | 731.356 \$             | 9,16 \$                          | 572.534 \$             | 6,06 \$                          | 125.103 \$             | 13,23 \$                         |
| 31. Dezember 2022 | 737.778 \$             | 8,29 \$                          | 486.413 \$             | 5,94 \$                          | 110.712 \$             | 11,70 \$                         |

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende          | Thesaurierende                    | Thesaurierende         | Thesaurierende                   | Thesaurierende           | Thesaurierende                     |
|-------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------------------|------------------------------------|
|                   | Klasse<br>AUD I2<br>NIW | Klasse<br>AUD I2<br>NIW je Anteil | Klasse<br>NOK I<br>NIW | Klasse<br>NOK I<br>NIW je Anteil | Klasse<br>NOK I3*<br>NIW | Klasse<br>NOK I3*<br>NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2024 | 24.078.308 AUD          | 9,50 AUD                          | 1.916.697 NOK          | 114,77 NOK                       | 437.316.116 NOK          | 106,15 NOK                         |
| 31. Dezember 2023 | 23.549.524 AUD          | 9,29 AUD                          | 3.209.047 NOK          | 111,71 NOK                       | 379.560.196 NOK          | 103,13 NOK                         |
| 31. Dezember 2022 | 21.961.420 AUD          | 8,67 AUD                          | 297.517.124 NOK        | 103,11 NOK                       | –                        | –                                  |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende         | Thesaurierende                   | Thesaurierende           | Thesaurierende                     | Thesaurierende         | Thesaurierende                   |
|-------------------|------------------------|----------------------------------|--------------------------|------------------------------------|------------------------|----------------------------------|
|                   | Klasse<br>USD I<br>NIW | Klasse<br>USD I<br>NIW je Anteil | Klasse<br>USD I2*<br>NIW | Klasse<br>USD I2*<br>NIW je Anteil | Klasse<br>USD Z<br>NIW | Klasse<br>USD Z<br>NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2024 | 29.544 \$              | 11,16 \$                         | –                        | –                                  | 3.875.282 \$           | 11,28 \$                         |
| 31. Dezember 2023 | 41.218 \$              | 11,20 \$                         | 4.388.707 \$             | 9,34 \$                            | 6.869.103 \$           | 11,26 \$                         |
| 31. Dezember 2022 | 38.055 \$              | 10,34 \$                         | 4.047.197 \$             | 8,61 \$                            | 5.087.444 \$           | 10,33 \$                         |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Markets Equity

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse AUD B<br>NIW | Thesaurierende Klasse AUD B<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse AUD C2*<br>NIW | Thesaurierende Klasse AUD C2*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse AUD E<br>NIW | Thesaurierende Klasse AUD E<br>NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|--------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 258.191 AUD                        | 10,85 AUD                                    | –                                    | –  | 39.640 AUD                         | 10,85 AUD                                    |
| 31. Dezember 2023 | 275.609 AUD                        | 9,42 AUD                                     | 14.841 AUD                           | 9,43 AUD                                       | 42.510 AUD                         | 9,41 AUD                                     |
| 31. Dezember 2022 | 389.876 AUD                        | 9,13 AUD                                     | 11.442 AUD                           | 9,13 AUD                                       | 125.310 AUD                        | 9,12 AUD                                     |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse AUD T<br>NIW | Thesaurierende Klasse AUD T<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse CAD I (nicht währungsgesichert)<br>NIW | Ausschüttende Klasse CAD I (nicht währungsgesichert)<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse CAD I2<br>NIW | Ausschüttende Klasse CAD I2<br>NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|---|---|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 2.062.188 AUD                      | 11,76 AUD                                    | 86.581 CAD  | 10,45 CAD   | 13.996.735 CAD                     | 9,38 CAD                                     |
| 31. Dezember 2023 | 1.771.385 AUD                      | 10,11 AUD                                    | 66.826 CAD  | 8,07 CAD  | 11.897.241 CAD                     | 7,97 CAD                                     |
| 31. Dezember 2022 | 1.741.416 AUD                      | 9,69 AUD                                     | 65.215 CAD  | 7,87 CAD  | 11.406.458 CAD                     | 7,64 CAD                                     |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR I<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR M<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR M<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR Z<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR Z<br>NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 2.928.183 €                        | 10,61 €                                      | 402.963 €                          | 11,70 €                                      | 205.446 €                          | 9,22 €                                       |
| 31. Dezember 2023 | 709.680 €                          | 9,04 €                                       | 408.164 €                          | 10,17 €                                      | 173.388 €                          | 7,78 €                                       |
| 31. Dezember 2022 | 1.362.334 €                        | 8,60 €                                       | 429.393 €                          | 9,87 €                                       | 163.271 €                          | 7,33 €                                       |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Emerging Markets Equity (Fortsetzung)

|                   | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP Z | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP Z | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A |
|-------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| Geschäftsjahr zum | NIW                               | NIW je Anteil                     | NIW                               | NIW je Anteil                     | NIW                               | NIW je Anteil                     |
| 31. Dezember 2024 | 18.971 £                          | 12,39 £                           | 91.664 £                          | 15,17 £                           | 2.434.389 \$                      | 11,92 \$                          |
| 31. Dezember 2023 | 406.653 £                         | 10,43 £                           | 86.537 £                          | 12,65 £                           | 5.239.268 \$                      | 10,08 \$                          |
| 31. Dezember 2022 | 381.404 £                         | 9,77 £                            | 80.198 £                          | 11,72 £                           | 4.825.592 \$                      | 9,44 \$                           |

|                   | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD B | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD B | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD C2* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD C2* | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD E | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD E |
|-------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| Geschäftsjahr zum | NIW                               | NIW je Anteil                     | NIW                                 | NIW je Anteil                       | NIW                               | NIW je Anteil                     |
| 31. Dezember 2024 | 1.015.174 \$                      | 12,32 \$                          | –                                   | –                                   | 126.038 \$                        | 12,30 \$                          |
| 31. Dezember 2023 | 856.399 \$                        | 10,52 \$                          | 10.153 \$                           | 10,50 \$                            | 138.219 \$                        | 10,50 \$                          |
| 31. Dezember 2022 | 1.423.437 \$                      | 9,96 \$                           | 119.565 \$                          | 9,95 \$                             | 265.455 \$                        | 9,94 \$                           |

|                   | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD T | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD T |
|-------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| Geschäftsjahr zum | NIW                               | NIW je Anteil                     | NIW                               | NIW je Anteil                     | NIW                               | NIW je Anteil                     |
| 31. Dezember 2024 | 40.651.015 \$                     | 13,72 \$                          | 3.816.540 \$                      | 13,12 \$                          | 2.899.519 \$                      | 13,36 \$                          |
| 31. Dezember 2023 | 41.804.429 \$                     | 11,48 \$                          | 439.380 \$                        | 11,20 \$                          | 4.026.797 \$                      | 11,29 \$                          |
| 31. Dezember 2022 | 155.175.902 \$                    | 10,66 \$                          | 398.316 \$                        | 10,60 \$                          | 6.120.100 \$                      | 10,57 \$                          |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Markets Equity (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD Z<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD Z<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse ZAR B<br>NIW | Thesaurierende Klasse ZAR B<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse ZAR C2*<br>NIW | Thesaurierende Klasse ZAR C2*<br>NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|------------------------------------|--|--------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 36.262.004 \$                      | 14,38 \$                                     | 5.589.912 ZAR                      | 156,75 ZAR                                   | –                                    | –  |
| 31. Dezember 2023 | 23.862.482 \$                      | 11,91 \$                                     | 4.948.769 ZAR                      | 131,03 ZAR                                   | 47.220 ZAR                           | 131,00 ZAR                                     |
| 31. Dezember 2022 | 11.172.939 \$                      | 10,94 \$                                     | 6.247.098 ZAR                      | 121,51 ZAR                                   | 1.133.518 ZAR                        | 121,50 ZAR                                     |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse ZAR E<br>NIW | Thesaurierende Klasse ZAR E<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse ZAR T<br>NIW | Thesaurierende Klasse ZAR T<br>NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 1.936.947 ZAR                      | 156,74 ZAR                                   | 23.304.215 ZAR                     | 170,22 ZAR                                   |
| 31. Dezember 2023 | 3.798.941 ZAR                      | 131,02 ZAR                                   | 23.945.169 ZAR                     | 140,86 ZAR                                   |
| 31. Dezember 2022 | 3.953.205 ZAR                      | 121,51 ZAR                                   | 24.141.495 ZAR                     | 129,33 ZAR                                   |

Emerging Markets Select Equity\*\*

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)*<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert)*<br>NIW | Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert)*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I*<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I*<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---|---|---|---|-------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | –   | –   | –   | –   | –                                   | –   |
| 31. Dezember 2023 | –   | –   | –   | –   | –                                   | –   |
| 31. Dezember 2022 | 2.008.452 €   | 8,70 €  | 1.269.919.529 ¥   | 1.112,95 ¥  | 81.907.316 \$                       | 8,84 \$                                       |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Emerging Markets Select Equity\*\* (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I5*<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I5*<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|
| 31. Dezember 2024 | –  | –  |
| 31. Dezember 2023 | –  | –  |
| 31. Dezember 2022 | 68.263 \$                                  | 8,53 \$  |

\*\* Das Portfolio wurde am 7. September 2023 aufgelöst.

## Euro Bond

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A*<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I<br>NIW je Anteil | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I<br>NIW | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---|---|--|--|---|---|
| 31. Dezember 2024 | 243.689 €                                 | 10,09 €   | 44.208.057 €                             | 11,58 €  | 10.366.894 €                            | 10,46 €   |
| 31. Dezember 2023 | –   | –   | 653.118 €                                | 10,95 €  | 9.919.526 €                             | 10,13 €   |
| 31. Dezember 2022 | –   | –   | 78.692 €                                 | 9,96 €   | 9.215.906 €                             | 9,41 €  |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M*<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR Z*<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR Z*<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---|---|---|---|
| 31. Dezember 2024 | 9.614 €                                   | 9,99 €  | 15.589.128 €                              | 10,50 €   |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Euro Bond Absolute Return

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR A*<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR A*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse EUR I<br>NIW | Ausschüttende Klasse EUR I<br>NIW je Anteil |
|-------------------|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|-----------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | 9.621 €                             | 10,00 €                                       | 18.465.468 €                       | 12,31 €                                      | 10.475 €                          | 11,27 €                                     |
| 31. Dezember 2023 | –                                   | –   | 1.020.367 €                        | 11,38 €                                      | 9.922 €                           | 10,67 €                                     |
| 31. Dezember 2022 | –                                   | –   | 2.262.829 €                        | 10,52 €                                      | 13.827.199 €                      | 10,04 €                                     |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR I2*<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I2*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I5<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I5<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR Z*<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR Z*<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--------------------------------------|--|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | 3.998.535 €                          | 10,00 €  | 12.880.385 €                        | 12,39 €                                       | 20.770.578 €                        | 10,58 €                                       |
| 31. Dezember 2023 | –                                    | –  | 5.531.035 €                         | 11,43 €                                       | –                                   | –   |
| 31. Dezember 2022 | –                                    | –  | 18.661.626 €                        | 10,55 €                                       | –                                   | –   |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD Z<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD Z<br>NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 33.535.335 \$                      | 13,29 \$                                     |
| 31. Dezember 2023 | 30.372.279 \$                      | 12,04 \$                                     |
| 31. Dezember 2022 | 14.615.873 \$                      | 10,86 \$                                     |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## European High Yield Bond

|                   | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF I* | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF I* | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I2* | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I2* |
|-------------------|------------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| Geschäftsjahr zum | NIW                                | NIW je Anteil                      | NIW                               | NIW je Anteil                     | NIW                                 | NIW je Anteil                       |
| 31. Dezember 2024 | 3.093.996 CHF                      | 11,47 CHF                          | 98.468.439 €                      | 15,32 €                           | 5.409.574 €                         | 11,55 €                             |
| 31. Dezember 2023 | 1.796.679 CHF                      | 10,75 CHF                          | 47.206.772 €                      | 14,01 €                           | 208.432 €                           | 10,54 €                             |
| 31. Dezember 2022 | –                                  | –                                  | 875.869 €                         | 12,34 €                           | –                                   | –                                   |

|                   | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I5* | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I5* | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I5* | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I5* | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M |
|-------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|------------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| Geschäftsjahr zum | NIW                                 | NIW je Anteil                       | NIW                                | NIW je Anteil                      | NIW                               | NIW je Anteil                     |
| 31. Dezember 2024 | –                                   | –                                   | 2.807.282 €                        | 10,40 €                            | 1.289.531 €                       | 13,71 €                           |
| 31. Dezember 2023 | 6.258.149 €                         | 10,44 €                             | –                                  | –                                  | 787.345 €                         | 12,68 €                           |
| 31. Dezember 2022 | –                                   | –                                   | –                                  | –                                  | 524.711 €                         | 11,31 €                           |

|                   | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR X | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR X | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR Y* | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR Y* | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR Y* | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR Y* |
|-------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| Geschäftsjahr zum | NIW                               | NIW je Anteil                     | NIW                                | NIW je Anteil                      | NIW                               | NIW je Anteil                     |
| 31. Dezember 2024 | 61.020.458 €                      | 13,54 €                           | 348.465.960 €                      | 12,42 €                            | 8.176.657 €                       | 11,23 €                           |
| 31. Dezember 2023 | 48.934.376 €                      | 12,33 €                           | 281.409.669 €                      | 11,30 €                            | 2.941.098 €                       | 10,74 €                           |
| 31. Dezember 2022 | 5.239.330 €                       | 10,82 €                           | –                                  | –                                  | –                                 | –                                 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

European High Yield Bond (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse<br>USD A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse<br>USD A (Monatlich) | Thesaurierende Klasse<br>USD I | Thesaurierende Klasse<br>USD I | Thesaurierende Klasse<br>USD X | Thesaurierende Klasse<br>USD X |
|-------------------|---|---|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
|                   | NIW                                       | NIW je Anteil                             | NIW                            | NIW je Anteil                  | NIW                            | NIW je Anteil                  |
| 31. Dezember 2024 | 1.339.512 \$                              | 9,40 \$                                   | 6.599.952 \$                   | 18,33 \$                       | 650.740 \$                     | 15,52 \$                       |
| 31. Dezember 2023 | 320.629 \$                                | 9,25 \$                                   | 228.440 \$                     | 16,49 \$                       | 585.996 \$                     | 13,90 \$                       |
| 31. Dezember 2022 | 343.199 \$                                | 8,63 \$                                   | 14.858.536 \$                  | 14,23 \$                       | 2.659.377 \$                   | 11,95 \$                       |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>USD Z | Thesaurierende Klasse<br>USD Z |
|-------------------|--------------------------------|--------------------------------|
|                   | NIW                            | NIW je Anteil                  |
| 31. Dezember 2024 | 24.332.117 \$                  | 14,66 \$                       |
| 31. Dezember 2023 | 19.509.577 \$                  | 13,11 \$                       |
| 31. Dezember 2022 | 9.687.331 \$                   | 11,25 \$                       |

European Sustainable Equity

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse<br>EUR A | Ausschüttende Klasse<br>EUR A | Thesaurierende Klasse<br>EUR I | Thesaurierende Klasse<br>EUR I | Ausschüttende Klasse<br>EUR I | Ausschüttende Klasse<br>EUR I |
|-------------------|-------------------------------|-------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|
|                   | NIW                           | NIW je Anteil                 | NIW                            | NIW je Anteil                  | NIW                           | NIW je Anteil                 |
| 31. Dezember 2024 | 25.611 €                      | 9,75 €                        | 22.138 €                       | 11,41 €                        | 11.566 €                      | 11,26 €                       |
| 31. Dezember 2023 | 24.542 €                      | 9,34 €                        | 34.572 €                       | 10,84 €                        | 11.039 €                      | 10,75 €                       |
| 31. Dezember 2022 | 20.816 €                      | 7,93 €                        | 29.063 €                       | 9,11 €                         | 3.727.608 €                   | 9,09 €                        |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## European Sustainable Equity (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende           | Ausschüttende                     | Thesaurierende          | Thesaurierende                    | Thesaurierende         | Thesaurierende                   |
|-------------------|-------------------------|-----------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------|----------------------------------|
|                   | Klasse<br>EUR I3<br>NIW | Klasse<br>EUR I3<br>NIW je Anteil | Klasse<br>EUR I5<br>NIW | Klasse<br>EUR I5<br>NIW je Anteil | Klasse<br>EUR M<br>NIW | Klasse<br>EUR M<br>NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2024 | 86.455.698 €            | 9,65 €                            | 1.646.966 €             | 10,03 €                           | 53.665 €               | 10,69 €                          |
| 31. Dezember 2023 | 112.925.635 €           | 9,21 €                            | 2.081.086 €             | 9,49 €                            | 39.633 €               | 10,33 €                          |
| 31. Dezember 2022 | 126.435.303 €           | 7,79 €                            | 1.690.128 €             | 7,96 €                            | 21.161 €               | 8,83 €                           |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende         | Thesaurierende                   | Thesaurierende                                      | Thesaurierende  | Thesaurierende                                      | Thesaurierende  |
|-------------------|------------------------|----------------------------------|---|---|---|---|
|                   | Klasse<br>EUR Z<br>NIW | Klasse<br>EUR Z<br>NIW je Anteil | Klasse<br>USD A (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW | Klasse<br>USD A (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW je Anteil | Klasse<br>USD I (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW | Klasse<br>USD I (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2024 | 60.253.837 €           | 11,57 €                          | 9.588 \$  | 9,59 \$   | 9.915 \$  | 9,91 \$   |
| 31. Dezember 2023 | 56.967.179 €           | 10,92 €                          | 9.798 \$  | 9,80 \$   | 10.041 \$   | 10,04 \$  |
| 31. Dezember 2022 | 28.841.630 €           | 9,12 €                           | 8.028 \$  | 8,03 \$   | 16.077.887 \$                                       | 8,15 \$   |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende                                      | Thesaurierende  |
|-------------------|---|---|
|                   | Klasse<br>USD M (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW | Klasse<br>USD M (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2024 | 9.301 \$  | 9,30 \$   |
| 31. Dezember 2023 | 9.581 \$  | 9,58 \$   |
| 31. Dezember 2022 | 7.914 \$  | 7,91 \$   |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Event Driven

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR I* | Thesaurierende Klasse EUR I* | Ausschüttende Klasse EUR I5* | Ausschüttende Klasse EUR I5* | Thesaurierende Klasse GBP I5 | Thesaurierende Klasse GBP I5 |
|-------------------|------------------------------|------------------------------|------------------------------|------------------------------|------------------------------|------------------------------|
|                   | NIW                          | NIW je Anteil                | NIW                          | NIW je Anteil                | NIW                          | NIW je Anteil                |
| 31. Dezember 2024 | 507.097 €                    | 10,81 €                      | 1.196.449 €                  | 10,52 €                      | 127.441.032 £                | 11,42 £                      |
| 31. Dezember 2023 | 9.507 €                      | 10,31 €                      | –                            | –                            | 75.985.117 £                 | 10,54 £                      |
| 31. Dezember 2022 | –                            | –                            | –                            | –                            | 23.956.881 £                 | 10,11 £                      |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse GBP I5 | Ausschüttende Klasse GBP I5 | Thesaurierende Klasse GBP P | Thesaurierende Klasse GBP P | Thesaurierende Klasse JPY I* | Thesaurierende Klasse JPY I* |
|-------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|------------------------------|------------------------------|
|                   | NIW                         | NIW je Anteil               | NIW                         | NIW je Anteil               | NIW                          | NIW je Anteil                |
| 31. Dezember 2024 | 49.516.696 £                | 11,29 £                     | 64.318 £                    | 11,22 £                     | 3.565.576.504 ¥              | 996,38 ¥                     |
| 31. Dezember 2023 | 12.132.056 £                | 10,55 £                     | 27.125 £                    | 10,50 £                     | –                            | –                            |
| 31. Dezember 2022 | 26.138 £                    | 10,11 £                     | 26.104 £                    | 10,10 £                     | –                            | –                            |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD I | Thesaurierende Klasse USD I | Thesaurierende Klasse USD I5 | Thesaurierende Klasse USD I5 |
|-------------------|-----------------------------|-----------------------------|------------------------------|------------------------------|
|                   | NIW                         | NIW je Anteil               | NIW                          | NIW je Anteil                |
| 31. Dezember 2024 | 11.408 \$                   | 11,41 \$                    | 37.738.901 \$                | 11,47 \$                     |
| 31. Dezember 2023 | 10.548 \$                   | 10,55 \$                    | 13.846.477 \$                | 10,61 \$                     |
| 31. Dezember 2022 | 10.126.565 \$               | 10,12 \$                    | 2.455.025 \$                 | 10,13 \$                     |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Global Bond

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse<br>AUD T (Monatlich)*<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>AUD T (Monatlich)*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>EUR I Benchmark<br>Währungsgesicherte*<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>EUR I Benchmark<br>Währungsgesicherte*<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>GBP P*<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>GBP P*<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---|---|--|--|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | –   | –   | 7.971.257 €  | 10,59 €  | 22.530 £                              | 9,66 £  |
| 31. Dezember 2023 | 29.629 AUD  | 7,53 AUD  | 28.777 €   | 10,40 €  | –                                     | –   |
| 31. Dezember 2022 | 29.300 AUD  | 7,44 AUD  | –  | –  | –                                     | –   |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>USD C1<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD C1<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD I Benchmark<br>Währungsgesicherte<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD I Benchmark<br>Währungsgesicherte<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD I<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD I<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---|---|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | 248.323 \$                             | 8,79 \$  | 61.187 \$   | 11,32 \$  | 2.503.485 \$                          | 10,12 \$  |
| 31. Dezember 2023 | 340.537 \$                             | 9,02 \$  | 32.939 \$   | 10,98 \$  | 3.215.877 \$                          | 10,26 \$  |
| 31. Dezember 2022 | 414.949 \$                             | 8,57 \$  | 30.527 \$   | 10,18 \$  | 1.427.481 \$                          | 9,63 \$   |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>USD M<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD M<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>USD T (Monatlich)*<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>USD T (Monatlich)*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD Z<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD Z<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|---|---|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | 1.202.079 \$                          | 9,35 \$   | –   | –   | 89.427.684 \$                         | 10,66 \$  |
| 31. Dezember 2023 | 420.409 \$                            | 9,54 \$   | 23.698 \$   | 7,90 \$   | 104.673.682 \$                        | 10,79 \$  |
| 31. Dezember 2022 | 255.883 \$                            | 9,00 \$   | 23.014 \$   | 7,67 \$   | 132.650.317 \$                        | 10,10 \$  |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Global Bond (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse<br>ZAR T (Monatlich)*<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>ZAR T (Monatlich)*<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---|---|
| 31. Dezember 2024 | –   | –   |
| 31. Dezember 2023 | 345.130 ZAR                                       | 77,03 ZAR   |
| 31. Dezember 2022 | 338.271 ZAR                                       | 75,50 ZAR   |

Global Diversified Income FMP – 2024\*\*

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>EUR A*<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>EUR A*<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>EUR A*<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>EUR A*<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>EUR I*<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>EUR I*<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | –                                      | –  | –                                     | –   | –                                     | –   |
| 31. Dezember 2023 | 1.220.917 €                            | 9,99 €   | 223.121 €                             | 8,92 €  | 881.687 €                             | 8,82 €  |
| 31. Dezember 2022 | 1.182.222 €                            | 9,67 €   | 223.454 €                             | 8,94 €  | 882.969 €                             | 8,83 €  |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse<br>GBP I*<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>GBP I*<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>HKD A*<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>HKD A*<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>SGD A*<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>SGD A*<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | –                                     | –   | –                                     | –   | –                                     | –   |
| 31. Dezember 2023 | 1.906.267 £                           | 9,30 £  | 6.877.059 HKD                         | 9,17 HKD  | 4.402.150 SGD                         | 18,52 SGD                                       |
| 31. Dezember 2022 | 1.968.485 £                           | 9,16 £  | 6.811.671 HKD                         | 9,08 HKD  | 4.834.873 SGD                         | 18,40 SGD                                       |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Global Diversified Income FMP – 2024\*\* (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD A* | Thesaurierende Klasse USD A* | Ausschüttende Klasse USD A* | Ausschüttende Klasse USD A* | Thesaurierende Klasse USD I* | Thesaurierende Klasse USD I* |
|-------------------|------------------------------|------------------------------|-----------------------------|-----------------------------|------------------------------|------------------------------|
|                   | NIW                          | NIW je Anteil                | NIW                         | NIW je Anteil               | NIW                          | NIW je Anteil                |
| 31. Dezember 2024 | –                            | –                            | –                           | –                           | –                            | –                            |
| 31. Dezember 2023 | 27.345.677 \$                | 10,56 \$                     | 37.856.568 \$               | 9,40 \$                     | 2.714.197 \$                 | 10,70 \$                     |
| 31. Dezember 2022 | 29.538.472 \$                | 10,01 \$                     | 42.245.620 \$               | 9,23 \$                     | 2.564.036 \$                 | 10,11 \$                     |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse USD I* | Ausschüttende Klasse USD I* | Thesaurierende Klasse USD X* | Thesaurierende Klasse USD X* | Ausschüttende Klasse USD X* | Ausschüttende Klasse USD X* |
|-------------------|-----------------------------|-----------------------------|------------------------------|------------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
|                   | NIW                         | NIW je Anteil               | NIW                          | NIW je Anteil                | NIW                         | NIW je Anteil               |
| 31. Dezember 2024 | –                           | –                           | –                            | –                            | –                           | –                           |
| 31. Dezember 2023 | 2.108.874 \$                | 9,41 \$                     | 22.493.910 \$                | 10,69 \$                     | 54.424.599 \$               | 9,41 \$                     |
| 31. Dezember 2022 | 2.069.152 \$                | 9,23 \$                     | 21.260.082 \$                | 10,10 \$                     | 53.399.383 \$               | 9,24 \$                     |

\*\* Das Portfolio wurde am 28. Juni 2024 aufgelöst.

## Global Equity Megatrends

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)* | Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)* | Thesaurierende Klasse EUR I* | Thesaurierende Klasse EUR I* | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) |
|-------------------|--|--|------------------------------|------------------------------|---|---|
|                   | NIW  | NIW je Anteil  | NIW                          | NIW je Anteil                | NIW   | NIW je Anteil   |
| 31. Dezember 2024 | 74.295 €   | 11,36 €  | 22.742.464 €                 | 13,10 €                      | 29.930.964 €  | 20,72 €   |
| 31. Dezember 2023 | –  | –  | 7.537.600 €                  | 9,95 €                       | 7.793.561 €   | 15,99 €   |
| 31. Dezember 2022 | –  | –  | –                            | –                            | 5.374.723 €   | 13,68 €   |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Global Equity Megatrends (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>GBP I4 (nicht<br>währungsgesichert)*<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP I4 (nicht<br>währungsgesichert)*<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>GBP I4 (nicht<br>währungsgesichert)*<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>GBP I4 (nicht<br>währungsgesichert)*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>GBP P (nicht<br>währungsgesichert)*<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP P (nicht<br>währungsgesichert)*<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---|---|---|---|
| 31. Dezember 2024 | 45.281.845 £   | 10,90 £  | 3.480.776 £   | 11,13 £   | 426.098 £   | 13,37 £   |
| 31. Dezember 2023 | –  | –  | –   | –   | 8.355 £   | 10,63 £   |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>HKD A*<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>HKD A*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>SGD A*<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>SGD A*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD A<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD A<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|--|--|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | 233.915 HKD                            | 10,03 HKD  | 12.931.349 SGD                         | 25,10 SGD  | 161.400.127 \$                        | 18,56 \$  |
| 31. Dezember 2023 | –                                      | –  | 41.911 SGD                             | 20,85 SGD  | 43.806.365 \$                         | 15,15 \$  |
| 31. Dezember 2022 | –                                      | –  | –                                      | –  | 33.770.046 \$                         | 12,43 \$  |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>USD C1<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD C1<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD I<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD I4*<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD I4*<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---------------------------------------|---|---|---|
| 31. Dezember 2024 | 3.447.110 \$                           | 17,37 \$   | 103.695.583 \$                        | 19,75 \$  | 4.484.515 \$                            | 11,49 \$  |
| 31. Dezember 2023 | 3.687.503 \$                           | 14,33 \$   | 35.156.723 \$                         | 15,99 \$  | –                                       | –   |
| 31. Dezember 2022 | 3.586.666 \$                           | 11,87 \$   | 9.729.597 \$                          | 13,01 \$  | –                                       | –   |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Global Equity Megatrends (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD M<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD M<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD U*<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD U*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD Z<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD Z<br>NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 66.241.347 \$                      | 17,49 \$                                     | 177.658 \$                          | 9,84 \$                                       | 52.598.967 \$                      | 13,53 \$                                     |
| 31. Dezember 2023 | 21.892.795 \$                      | 14,39 \$                                     | –                                   | –   | 22.954.011 \$                      | 10,87 \$                                     |
| 31. Dezember 2022 | 17.646.556 \$                      | 11,90 \$                                     | –                                   | –   | 8.879.110 \$                       | 8,77 \$                                      |

## Global Flexible Credit Income

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse CAD I5<br>NIW | Thesaurierende Klasse CAD I5<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR M<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR M<br>NIW je Anteil |
|-------------------|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 13.726.156 CAD                      | 11,30 CAD                                     | 3.104.397 €                        | 11,36 €                                      | 1.653.669 €                        | 10,56 €                                      |
| 31. Dezember 2023 | 14.626.794 CAD                      | 10,47 CAD                                     | 5.816.508 €                        | 10,66 €                                      | 445.491 €                          | 10,05 €                                      |
| 31. Dezember 2022 | 14.013.104 CAD                      | 9,34 CAD                                      | 3.643.959 €                        | 9,69 €                                       | 390.568 €                          | 9,25 €                                       |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse GBP I5<br>NIW | Thesaurierende Klasse GBP I5<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse GBP P*<br>NIW | Ausschüttende Klasse GBP P*<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)*<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)*<br>NIW je Anteil |
|-------------------|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|--|--|
| 31. Dezember 2024 | 157.284.765 £                       | 12,75 £                                       | 23.623 £                           | 10,13 £                                      | 4.395.475 \$                                   | 10,07 \$   |
| 31. Dezember 2023 | 151.941.174 £                       | 11,76 £                                       | –                                  | –  | –  | –  |
| 31. Dezember 2022 | 196.137.415 £                       | 10,49 £                                       | –                                  | –  | –  | –  |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Global Flexible Credit Income (Fortsetzung)

|                   | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>NIW je Anteil | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I<br>NIW | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|--|--|---|---|
| Geschäftsjahr zum |  |  |  |  |   |   |
| 31. Dezember 2024 | 27.516.599 \$                            | 11,74 \$   | 179.905.195 \$                           | 12,86 \$   | 808.154 \$                              | 10,43 \$  |
| 31. Dezember 2023 | 9.962.495 \$                             | 10,89 \$   | 157.808.987 \$                           | 11,86 \$   | 355.209 \$                              | 10,15 \$  |
| 31. Dezember 2022 | 9.127.970 \$                             | 9,74 \$  | 123.697.450 \$                           | 10,54 \$   | 333.308 \$                              | 9,53 \$   |

|                   | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD U*<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD U*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---|---|--|--|
| Geschäftsjahr zum |  |  |   |   |  |  |
| 31. Dezember 2024 | 13.766.147 \$                            | 11,34 \$   | 201.235 \$                                | 10,06 \$  | 6.712.539 \$                             | 13,21 \$   |
| 31. Dezember 2023 | 6.408.215 \$                             | 10,60 \$   | –   | –   | 6.004.606 \$                             | 12,11 \$   |
| 31. Dezember 2022 | 5.552.804 \$                             | 9,56 \$  | –   | –   | 5.191.915 \$                             | 10,70 \$   |

Global High Yield Engagement

|                   | Ausschüttende<br>Klasse<br>AUD I<br>NIW | Ausschüttende<br>Klasse<br>AUD I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>AUD I4*<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>AUD I4*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF I4<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF I4<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---|---|--|--|---|---|
| Geschäftsjahr zum |   |   |  |  |   |   |
| 31. Dezember 2024 | 41.528 AUD                              | 9,83 AUD  | 4.738.939 AUD                              | 10,71 AUD  | 75.860.265 CHF                            | 10,56 CHF   |
| 31. Dezember 2023 | 40.737 AUD                              | 9,65 AUD  | –  | –  | 74.837.938 CHF                            | 10,11 CHF   |
| 31. Dezember 2022 | 39.517 AUD                              | 9,36 AUD  | –  | –  | 34.903.208 CHF                            | 9,53 CHF  |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Global High Yield Engagement (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse CHF I4<br>NIW | Ausschüttende Klasse CHF I4<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse CHF X<br>NIW | Thesaurierende Klasse CHF X<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I4<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I4<br>NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|------------------------------------|--|-------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | 4.506.911 CHF                      | 9,22 CHF                                     | 30.367 CHF                         | 10,36 CHF                                    | 58.258.041 €                        | 11,01 €                                       |
| 31. Dezember 2023 | 4.796.137 CHF                      | 9,36 CHF                                     | 29.298 CHF                         | 10,00 CHF                                    | 64.352.654 €                        | 10,29 €                                       |
| 31. Dezember 2022 | 2.109.781 CHF                      | 9,32 CHF                                     | 27.818 CHF                         | 9,49 CHF                                     | 34.350.965 €                        | 9,51 €  |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse EUR I4<br>NIW | Ausschüttende Klasse EUR I4<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR X<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR X<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR Z (PF)<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR Z (PF)<br>NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|------------------------------------|--|---|---|
| 31. Dezember 2024 | 1.035.964 €                        | 9,62 €                                       | 84.671 €                           | 10,79 €                                      | 32.614.115 €                            | 12,43 €   |
| 31. Dezember 2023 | 1.101.288 €                        | 9,52 €                                       | 28.912 €                           | 10,16 €                                      | 23.929.260 €                            | 11,58 €   |
| 31. Dezember 2022 | 894.723 €                          | 9,30 €                                       | 26.930 €                           | 9,46 €                                       | 21.835.394 €                            | 10,68 €   |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse GBP I4<br>NIW | Thesaurierende Klasse GBP I4<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP X<br>NIW | Thesaurierende Klasse GBP X<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD A<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD A<br>NIW je Anteil |
|-------------------|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 18.008.322 £                        | 11,49 £                                       | 27.037 £                           | 11,27 £                                      | 1.648.365 \$                       | 13,36 \$                                     |
| 31. Dezember 2023 | 18.172.947 £                        | 10,59 £                                       | 25.092 £                           | 10,46 £                                      | 621.460 \$                         | 12,38 \$                                     |
| 31. Dezember 2022 | 8.029.261 £                         | 9,63 £  | 23.001 £                           | 9,59 £                                       | 600.599 \$                         | 11,29 \$                                     |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Global High Yield Engagement (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD I<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I4<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I4<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD M<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD M<br>NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|-------------------------------------|---|-----------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | 13.849 \$                          | 14,20 \$                                     | 391.328.463 \$                      | 11,67 \$                                      | 1.267.599 \$                      | 7,99 \$                                     |
| 31. Dezember 2023 | 5.429.150 \$                       | 13,08 \$                                     | 325.223.085 \$                      | 10,73 \$                                      | 1.251.730 \$                      | 7,92 \$                                     |
| 31. Dezember 2022 | 82.906 \$                          | 11,86 \$                                     | 93.240.963 \$                       | 9,70 \$                                       | 1.212.483 \$                      | 7,72 \$                                     |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD X<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD X<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD Z<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD Z<br>NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 22.748 \$                          | 11,30 \$                                     | 9.787.846 \$                       | 14,94 \$                                     |
| 31. Dezember 2023 | 21.053 \$                          | 10,46 \$                                     | 8.991.111 \$                       | 13,68 \$                                     |
| 31. Dezember 2022 | 19.180 \$                          | 9,53 \$                                      | 8.101.529 \$                       | 12,32 \$                                     |

Global High Yield Sustainable Action\*\*

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD I*<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I*<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I*<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD I*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD X*<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD X*<br>NIW je Anteil |
|-------------------|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|-------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | –                                   | –   | –                                  | –  | –                                   | –   |
| 31. Dezember 2023 | –                                   | –   | –                                  | –  | –                                   | –   |
| 31. Dezember 2022 | 9.396 \$                            | 9,40 \$                                       | 12.286.350 \$                      | 8,43 \$                                      | 9.281 \$                            | 9,28 \$                                       |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Global High Yield Sustainable Action\*\* (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD Y*<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD Y*<br>NIW je Anteil |
|-------------------|-------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | –                                   | –   |
| 31. Dezember 2023 | –                                   | –   |
| 31. Dezember 2022 | 2.739.164 \$                        | 9,13 \$                                       |

\*\* Das Portfolio wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.

## Global Investment Grade Credit

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR I*<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I*<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse GBP P*<br>NIW | Ausschüttende Klasse GBP P*<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse GBP X*<br>NIW | Ausschüttende Klasse GBP X*<br>NIW je Anteil |
|-------------------|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 29.495 €                            | 10,80 €                                       | 23.686 £                           | 10,17 £                                      | 73.880.615 £                       | 9,89 £                                       |
| 31. Dezember 2023 | 28.687 €                            | 10,51 €                                       | –                                  | –  | –                                  | –  |
| 31. Dezember 2022 | –                                   | –   | –                                  | –  | –                                  | –  |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD I<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD X<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD X<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD Z<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD Z<br>NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 11.206.199 \$                      | 9,67 \$                                      | 43.817.889 \$                      | 9,74 \$                                      | 32.240.566 \$                      | 9,77 \$                                      |
| 31. Dezember 2023 | 1.777.609 \$                       | 9,25 \$                                      | 40.267.522 \$                      | 9,29 \$                                      | 44.688.102 \$                      | 9,31 \$                                      |
| 31. Dezember 2022 | 1.224.588 \$                       | 8,44 \$                                      | 42.337.788 \$                      | 8,46 \$                                      | 42.354.407 \$                      | 8,47 \$                                      |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Global Opportunistic Bond

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR I<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP P<br>NIW | Thesaurierende Klasse GBP P<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD A<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD A<br>NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 14.938 €                           | 9,76 €                                       | 23.103 £                           | 10,07 £                                      | 17.222 \$                          | 11,09 \$                                     |
| 31. Dezember 2023 | 14.805 €                           | 9,68 €                                       | 22.561 £                           | 9,83 £                                       | 20.869 \$                          | 10,83 \$                                     |
| 31. Dezember 2022 | 8.432.665 €                        | 8,72 €                                       | 21.356 £                           | 9,31 £                                       | 481.764 \$                         | 10,22 \$                                     |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD I<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I2<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I2<br>NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|-----------------------------------|---|-------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | 8.603.292 \$                       | 11,89 \$                                     | 12.216.806 \$                     | 9,76 \$                                     | 5.589.530 \$                        | 11,26 \$                                      |
| 31. Dezember 2023 | 4.553.699 \$                       | 11,59 \$                                     | 12.262.296 \$                     | 9,80 \$                                     | 23.293.272 \$                       | 10,97 \$                                      |
| 31. Dezember 2022 | 4.135.327 \$                       | 10,91 \$                                     | 8.952.587 \$                      | 9,50 \$                                     | 24.678.158 \$                       | 10,32 \$                                      |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse USD I2*<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD I2*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD Z<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD Z<br>NIW je Anteil |
|-------------------|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 18.930.963 \$                       | 10,01 \$                                      | 22.476.075 \$                      | 11,02 \$                                     |
| 31. Dezember 2023 | –                                   | –   | 25.233.838 \$                      | 10,70 \$                                     |
| 31. Dezember 2022 | –                                   | –   | 28.817.657 \$                      | 10,04 \$                                     |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Global Real Estate Securities\*\*

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse<br>EUR I5*<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>EUR I5*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>EUR M<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>EUR M<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>EUR Z (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>EUR Z (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---------------------------------------|---|--|--|
| 31. Dezember 2024 | –                                      | –  | 782.324 €                             | 9,49 €  | 19.652 €   | 12,28 €  |
| 31. Dezember 2023 | –                                      | –  | 877.918 €                             | 10,17 €   | 213.904 €  | 11,79 €  |
| 31. Dezember 2022 | 9.028.171 €                            | 7,69 €   | 1.021.424 €                           | 9,87 €  | 103.583 €  | 11,25 €  |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>GBP Z*<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP Z*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD A<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD A<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD CI<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD CI<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---------------------------------------|---|--|--|
| 31. Dezember 2024 | –                                      | –  | 2.365.095 \$                          | 10,10 \$  | 97.097 \$                              | 8,83 \$  |
| 31. Dezember 2023 | 89.203 £                               | 12,21 £  | 3.456.439 \$                          | 10,51 \$  | 135.797 \$                             | 9,28 \$  |
| 31. Dezember 2022 | 83.075 £                               | 11,37 £  | 4.298.698 \$                          | 9,83 \$   | 128.352 \$                             | 8,77 \$  |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>USD I<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD I<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>USD I5*<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>USD I5*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD M<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD M<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|--|--|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | 10.716.894 \$                         | 13,09 \$  | –                                      | –  | 352.693 \$                            | 9,05 \$   |
| 31. Dezember 2023 | 12.394.725 \$                         | 13,51 \$  | 30.861 \$                              | 9,31 \$  | 718.797 \$                            | 9,51 \$   |
| 31. Dezember 2022 | 16.657.145 \$                         | 12,55 \$  | 2.824.490 \$                           | 8,82 \$  | 672.248 \$                            | 8,99 \$   |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Global Real Estate Securities\*\* (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|
| 31. Dezember 2024 | 62.701 \$                                | 13,57 \$   |
| 31. Dezember 2023 | 2.419.204 \$                             | 13,89 \$   |
| 31. Dezember 2022 | 3.549.409 \$                             | 12,81 \$   |

\*\* Das Portfolio wurde am 31. Dezember 2024 aufgelöst.

Global Sustainable Equity

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I5 (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I5 (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR Z (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR Z (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---|---|---|---|
| 31. Dezember 2024 | 86.901.524 €   | 13,94 €  | 115.115 €   | 12,90 €   | 1.629.597 €   | 13,53 €   |
| 31. Dezember 2023 | 86.892.096 €   | 12,11 €  | 78.678 €  | 11,43 €   | 1.439.413 €   | 11,72 €   |
| 31. Dezember 2022 | 79.067.463 €   | 10,10 €  | 59.173 €  | 9,73 €  | 1.214.656 €   | 9,75 €  |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I5 (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I5 (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---|---|--|--|--|--|
| 31. Dezember 2024 | 3.463.932 £   | 12,59 £   | 5.211.893 £  | 12,73 £  | 31.704 \$                                | 9,50 \$  |
| 31. Dezember 2023 | 981.020 £   | 11,49 £   | 4.420.169 £  | 11,59 £  | 471.447 \$                               | 8,92 \$  |
| 31. Dezember 2022 | 526.524 £   | 9,85 £  | 4.009.524 £  | 9,90 £   | 523.329 \$                               | 7,28 \$  |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Global Sustainable Equity (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende         | Thesaurierende                   | Ausschüttende          | Ausschüttende                    | Thesaurierende         | Thesaurierende                   |
|-------------------|------------------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|
|                   | Klasse<br>USD I<br>NIW | Klasse<br>USD I<br>NIW je Anteil | Klasse<br>USD I<br>NIW | Klasse<br>USD I<br>NIW je Anteil | Klasse<br>USD M<br>NIW | Klasse<br>USD M<br>NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2024 | 637.624 \$             | 11,77 \$                         | 13.313 \$              | 11,77 \$                         | 29.892 \$              | 10,98 \$                         |
| 31. Dezember 2023 | 11.121.650 \$          | 10,93 \$                         | 12.373 \$              | 10,94 \$                         | 417.625 \$             | 10,38 \$                         |
| 31. Dezember 2022 | 10.623.061 \$          | 8,83 \$                          | 4.393.504 \$           | 8,84 \$                          | 361.394 \$             | 8,54 \$                          |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende         | Thesaurierende                   |
|-------------------|------------------------|----------------------------------|
|                   | Klasse<br>USD Z<br>NIW | Klasse<br>USD Z<br>NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2024 | 37.043.410 \$          | 11,21 \$                         |
| 31. Dezember 2023 | 37.957.449 \$          | 10,35 \$                         |
| 31. Dezember 2022 | 24.466.171 \$          | 8,32 \$                          |

## Global Value

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende         | Thesaurierende                   | Thesaurierende                                       | Thesaurierende   | Thesaurierende                                       | Thesaurierende   |
|-------------------|------------------------|----------------------------------|--|--|--|--|
|                   | Klasse<br>EUR M<br>NIW | Klasse<br>EUR M<br>NIW je Anteil | Klasse<br>GBP I5 (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW | Klasse<br>GBP I5 (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW je Anteil | Klasse<br>GBP P (nicht<br>währungsgesichert)*<br>NIW | Klasse<br>GBP P (nicht<br>währungsgesichert)*<br>NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2024 | 401.846 €              | 16,81 €                          | 14.256.815 £   | 12,48 £  | 329.367 £  | 11,99 £  |
| 31. Dezember 2023 | 520.510 €              | 15,76 €                          | 10.307 £   | 11,12 £  | 8.811 £  | 10,70 £  |
| 31. Dezember 2022 | 483.610 €              | 14,02 €                          | 9.338 £  | 10,08 £  | –  | –  |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Global Value (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD A | Thesaurierende Klasse USD A | Thesaurierende Klasse USD I | Thesaurierende Klasse USD I | Thesaurierende Klasse USD I3* | Thesaurierende Klasse USD I3* |
|-------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-------------------------------|-------------------------------|
|                   | NIW                         | NIW je Anteil               | NIW                         | NIW je Anteil               | NIW                           | NIW je Anteil                 |
| 31. Dezember 2024 | 2.220.288 \$                | 20,13 \$                    | 9.972.467 \$                | 21,44 \$                    | –                             | –                             |
| 31. Dezember 2023 | 1.388.066 \$                | 18,39 \$                    | 10.479.115 \$               | 19,50 \$                    | 31.008.928 \$                 | 11,06 \$                      |
| 31. Dezember 2022 | 2.093.493 \$                | 15,83 \$                    | 2.989.730 \$                | 16,71 \$                    | 23.813.624 \$                 | 9,47 \$                       |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD Z | Thesaurierende Klasse USD Z |
|-------------------|-----------------------------|-----------------------------|
|                   | NIW                         | NIW je Anteil               |
| 31. Dezember 2024 | 15.795.662 \$               | 23,50 \$                    |
| 31. Dezember 2023 | 11.985.820 \$               | 21,28 \$                    |
| 31. Dezember 2022 | 19.288.532 \$               | 18,15 \$                    |

High Yield Bond

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | Thesaurierende Klasse AUD A | Thesaurierende Klasse AUD A | Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich) | Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich) |
|-------------------|--|--|-----------------------------|-----------------------------|--|--|
|                   | NIW                                    | NIW je Anteil                          | NIW                         | NIW je Anteil               | NIW                                    | NIW je Anteil                          |
| 31. Dezember 2024 | 15.035.483 AUD                         | 6,33 AUD                               | 1.541.896 AUD               | 15,92 AUD                   | 10.796.752 AUD                         | 4,70 AUD                               |
| 31. Dezember 2023 | 15.862.650 AUD                         | 6,50 AUD                               | 2.858.210 AUD               | 15,00 AUD                   | 10.373.440 AUD                         | 4,93 AUD                               |
| 31. Dezember 2022 | 18.826.339 AUD                         | 6,43 AUD                               | 3.345.436 AUD               | 13,78 AUD                   | 14.918.035 AUD                         | 4,95 AUD                               |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## High Yield Bond (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse AUD B | Thesaurierende Klasse AUD B | Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich)* | Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich)* | Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich) | Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich) |
|-------------------|-----------------------------|-----------------------------|--|--|--|--|
|                   | NIW                         | NIW je Anteil               | NIW                                      | NIW je Anteil                            | NIW                                    | NIW je Anteil                          |
| 31. Dezember 2024 | 968.222 AUD                 | 9,75 AUD                    | –  | –  | 3.521.651 AUD                          | 4,75 AUD                               |
| 31. Dezember 2023 | 1.011.221 AUD               | 9,33 AUD                    | 3.241 AUD                                | 4,94 AUD                                 | 1.845.729 AUD                          | 4,97 AUD                               |
| 31. Dezember 2022 | 907.067 AUD                 | 8,71 AUD                    | 422.009 AUD                              | 4,96 AUD                                 | 961.233 AUD                            | 5,00 AUD                               |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse AUD E | Thesaurierende Klasse AUD E | Ausschüttende Klasse AUD I | Ausschüttende Klasse AUD I | Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) | Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) |
|-------------------|-----------------------------|-----------------------------|----------------------------|----------------------------|--|--|
|                   | NIW                         | NIW je Anteil               | NIW                        | NIW je Anteil              | NIW                                    | NIW je Anteil                          |
| 31. Dezember 2024 | 493.366 AUD                 | 10,99 AUD                   | 8.739.805 AUD              | 9,51 AUD                   | 62.949.157 AUD                         | 5,55 AUD                               |
| 31. Dezember 2023 | 413.416 AUD                 | 10,52 AUD                   | 17.014.854 AUD             | 9,44 AUD                   | 73.324.379 AUD                         | 5,74 AUD                               |
| 31. Dezember 2022 | 394.034 AUD                 | 9,82 AUD                    | 24.632.173 AUD             | 9,15 AUD                   | 77.779.276 AUD                         | 5,71 AUD                               |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse AUD T (Wöchentlich) | Ausschüttende Klasse AUD T (Wöchentlich) | Thesaurierende Klasse AUD T | Thesaurierende Klasse AUD T | Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich) |
|-------------------|--|--|-----------------------------|-----------------------------|--|--|
|                   | NIW                                      | NIW je Anteil                            | NIW                         | NIW je Anteil               | NIW                                    | NIW je Anteil                          |
| 31. Dezember 2024 | 608.346 AUD                              | 5,35 AUD                                 | 1.505.592 AUD               | 13,51 AUD                   | 6.513.070 CAD                          | 6,59 CAD                               |
| 31. Dezember 2023 | 754.803 AUD                              | 5,55 AUD                                 | 1.527.094 AUD               | 12,80 AUD                   | 5.981.498 CAD                          | 6,74 CAD                               |
| 31. Dezember 2022 | 790.496 AUD                              | 5,52 AUD                                 | 2.009.139 AUD               | 11,83 AUD                   | 6.486.618 CAD                          | 6,61 CAD                               |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse CHF A<br>NIW | Thesaurierende Klasse CHF A<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse CHF I<br>NIW | Thesaurierende Klasse CHF I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse CHF I2<br>NIW | Thesaurierende Klasse CHF I2<br>NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|------------------------------------|--|-------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | 2.600.856 CHF                      | 12,54 CHF                                    | 350.361 CHF                        | 13,52 CHF                                    | 2.242.091 CHF                       | 11,61 CHF                                     |
| 31. Dezember 2023 | 2.903.144 CHF                      | 12,18 CHF                                    | 220.795 CHF                        | 13,06 CHF                                    | 2.436.116 CHF                       | 11,20 CHF                                     |
| 31. Dezember 2022 | 3.669.718 CHF                      | 11,47 CHF                                    | 5.277.144 CHF                      | 12,22 CHF                                    | 1.843.440 CHF                       | 10,47 CHF                                     |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse CNY I (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse CNY I (Monatlich)<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---|---|---|---|---|---|
| 31. Dezember 2024 | 10.776.662 CNY                                | 70,32 CNY   | 201.759 CNY                                   | 75,20 CNY   | 6.100.807 €                                   | 5,87 €  |
| 31. Dezember 2023 | 11.540.823 CNY                                | 73,18 CNY   | 208.678 CNY                                   | 77,78 CNY   | 5.784.669 €                                   | 6,06 €  |
| 31. Dezember 2022 | 14.058.980 CNY                                | 73,25 CNY   | 207.631 CNY                                   | 77,39 CNY   | 6.420.394 €                                   | 6,03 €  |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR A<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR A<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse EUR A<br>NIW | Ausschüttende Klasse EUR A<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I<br>NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|-----------------------------------|---|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 4.599.292 €                        | 21,05 €                                      | 2.258.790 €                       | 7,19 €                                      | 19.249.224 €                       | 18,86 €                                      |
| 31. Dezember 2023 | 5.575.031 €                        | 19,94 €                                      | 2.533.501 €                       | 7,19 €                                      | 18.413.969 €                       | 17,76 €                                      |
| 31. Dezember 2022 | 20.497.963 €                       | 18,42 €                                      | 2.934.472 €                       | 7,01 €                                      | 21.263.684 €                       | 16,30 €                                      |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## High Yield Bond (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse EUR I | Ausschüttende Klasse EUR I | Thesaurierende Klasse EUR I2 | Thesaurierende Klasse EUR I2 | Ausschüttende Klasse EUR I2 | Ausschüttende Klasse EUR I2 |
|-------------------|----------------------------|----------------------------|------------------------------|------------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
|                   | NIW                        | NIW je Anteil              | NIW                          | NIW je Anteil                | NIW                         | NIW je Anteil               |
| 31. Dezember 2024 | 4.475.169 €                | 6,92 €                     | 76.936.476 €                 | 13,26 €                      | 52.630.139 €                | 6,83 €                      |
| 31. Dezember 2023 | 4.310.197 €                | 6,92 €                     | 51.114.447 €                 | 12,47 €                      | 56.865.932 €                | 6,82 €                      |
| 31. Dezember 2022 | 5.068.640 €                | 6,74 €                     | 21.766.293 €                 | 11,44 €                      | 37.930.088 €                | 6,65 €                      |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR M | Thesaurierende Klasse EUR M | Thesaurierende Klasse EUR Z | Thesaurierende Klasse EUR Z | Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich) |
|-------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|--|--|
|                   | NIW                         | NIW je Anteil               | NIW                         | NIW je Anteil               | NIW                                    | NIW je Anteil                          |
| 31. Dezember 2024 | 25.747 €                    | 11,70 €                     | 209.975 €                   | 12,72 €                     | 1.783.593 £                            | 6,22 £                                 |
| 31. Dezember 2023 | 34.119 €                    | 11,15 €                     | 181.078 €                   | 11,90 €                     | 2.684.037 £                            | 6,34 £                                 |
| 31. Dezember 2022 | 40.548 €                    | 10,36 €                     | 165.274 €                   | 10,87 €                     | 2.614.675 £                            | 6,20 £                                 |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse GBP A | Thesaurierende Klasse GBP A | Ausschüttende Klasse GBP A | Ausschüttende Klasse GBP A | Thesaurierende Klasse GBP I | Thesaurierende Klasse GBP I |
|-------------------|-----------------------------|-----------------------------|----------------------------|----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
|                   | NIW                         | NIW je Anteil               | NIW                        | NIW je Anteil              | NIW                         | NIW je Anteil               |
| 31. Dezember 2024 | 1.272.022 £                 | 15,21 £                     | 969.092 £                  | 8,03 £                     | 6.696.598 £                 | 18,62 £                     |
| 31. Dezember 2023 | 1.411.301 £                 | 14,20 £                     | 954.452 £                  | 7,91 £                     | 5.789.389 £                 | 17,29 £                     |
| 31. Dezember 2022 | 1.624.325 £                 | 12,91 £                     | 1.085.076 £                | 7,59 £                     | 5.660.368 £                 | 15,62 £                     |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse<br>GBP I<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>GBP I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>GBP I2<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP I2<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>GBP I2<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>GBP I2<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--------------------------------------|--|--|--|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | 862.158 £                            | 8,68 £   | 1.593.772 £                            | 14,92 £  | 138.452.960 £                         | 7,69 £  |
| 31. Dezember 2023 | 3.395.941 £                          | 8,55 £   | 1.512.133 £                            | 13,84 £  | 168.547.845 £                         | 7,57 £  |
| 31. Dezember 2022 | 7.234.066 £                          | 8,21 £   | 581.131 £                              | 12,49 £  | 123.006.920 £                         | 7,27 £  |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>GBP Z<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP Z<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>HKD A (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>HKD A (Monatlich)<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>JPY A (Monatlich) (nicht<br>währungsgesichert)*<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>JPY A (Monatlich) (nicht<br>währungsgesichert)*<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|--|--|--|--|
| 31. Dezember 2024 | 39.667 £                              | 14,53 £   | 28.738.006 HKD                                   | 6,49 HKD   | 1.569.178 ¥  | 1.076,31 ¥   |
| 31. Dezember 2023 | 124.386 £                             | 13,42 £   | 36.563.065 HKD                                   | 6,65 HKD   | –  | –  |
| 31. Dezember 2022 | 153.131 £                             | 12,06 £   | 38.478.810 HKD                                   | 6,53 HKD   | –  | –  |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>SEK A<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>SEK A<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>SGD A (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>SGD A (Monatlich)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>SGD A<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>SGD A<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|--|--|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | 281.787.894 SEK                       | 143,33 SEK                                      | 22.096.680 SGD                                   | 13,39 SGD  | 3.117.895 SGD                         | 30,61 SGD                                       |
| 31. Dezember 2023 | 723.938.325 SEK                       | 136,03 SEK                                      | 19.027.580 SGD                                   | 13,83 SGD  | 4.897.409 SGD                         | 29,01 SGD                                       |
| 31. Dezember 2022 | 78.792.625 SEK                        | 125,59 SEK                                      | 22.367.741 SGD                                   | 13,65 SGD  | 2.875.654 SGD                         | 26,58 SGD                                       |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## High Yield Bond (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse<br>USD A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse<br>USD A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse<br>USD A (Wöchentlich) | Ausschüttende Klasse<br>USD A (Wöchentlich) | Thesaurierende Klasse<br>USD A | Thesaurierende Klasse<br>USD A |
|-------------------|---|---|---|---|--------------------------------|--------------------------------|
|                   | NIW                                       | NIW je Anteil                             | NIW   | NIW je Anteil                               | NIW                            | NIW je Anteil                  |
| 31. Dezember 2024 | 78.012.461 \$                             | 7,03 \$                                   | 3.523.203 \$                                | 6,74 \$                                     | 133.950.981 \$                 | 19,41 \$                       |
| 31. Dezember 2023 | 77.008.320 \$                             | 7,13 \$                                   | 2.412.509 \$                                | 6,84 \$                                     | 131.648.685 \$                 | 18,07 \$                       |
| 31. Dezember 2022 | 93.381.210 \$                             | 6,93 \$                                   | 2.844.055 \$                                | 6,65 \$                                     | 137.066.692 \$                 | 16,32 \$                       |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse<br>USD A | Ausschüttende Klasse<br>USD A | Ausschüttende Klasse<br>USD B (Monatlich) | Ausschüttende Klasse<br>USD B (Monatlich) | Thesaurierende Klasse<br>USD B | Thesaurierende Klasse<br>USD B |
|-------------------|-------------------------------|-------------------------------|---|---|--------------------------------|--------------------------------|
|                   | NIW                           | NIW je Anteil                 | NIW                                       | NIW je Anteil                             | NIW                            | NIW je Anteil                  |
| 31. Dezember 2024 | 17.489.594 \$                 | 8,75 \$                       | 93.647.866 \$                             | 5,26 \$                                   | 10.793.439 \$                  | 12,52 \$                       |
| 31. Dezember 2023 | 19.236.817 \$                 | 8,60 \$                       | 98.121.371 \$                             | 5,45 \$                                   | 9.209.516 \$                   | 11,85 \$                       |
| 31. Dezember 2022 | 20.742.314 \$                 | 8,20 \$                       | 111.013.457 \$                            | 5,38 \$                                   | 12.754.653 \$                  | 10,88 \$                       |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>USD C | Thesaurierende Klasse<br>USD C | Thesaurierende Klasse<br>USD C1 | Thesaurierende Klasse<br>USD C1 | Ausschüttende Klasse<br>USD C1 | Ausschüttende Klasse<br>USD C1 |
|-------------------|--------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
|                   | NIW                            | NIW je Anteil                  | NIW                             | NIW je Anteil                   | NIW                            | NIW je Anteil                  |
| 31. Dezember 2024 | 958.820 \$                     | 14,18 \$                       | 1.910.842 \$                    | 11,48 \$                        | 575.932 \$                     | 8,84 \$                        |
| 31. Dezember 2023 | 920.256 \$                     | 13,28 \$                       | 2.325.248 \$                    | 10,80 \$                        | 595.052 \$                     | 8,69 \$                        |
| 31. Dezember 2022 | 894.416 \$                     | 12,07 \$                       | 2.598.086 \$                    | 9,85 \$                         | 612.205 \$                     | 8,29 \$                        |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse<br>USD C2 (Monatlich)*<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>USD C2 (Monatlich)*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD C2*<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD C2*<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>USD E (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>USD E (Monatlich)<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---|---|--|--|
| 31. Dezember 2024 | –  | –  | –                                       | –   | 19.126.124 \$                                    | 5,33 \$  |
| 31. Dezember 2023 | 12.549 \$  | 5,44 \$  | 6.358 \$                                | 11,86 \$  | 10.460.452 \$                                    | 5,53 \$  |
| 31. Dezember 2022 | 3.605.063 \$                                       | 5,38 \$  | 2.346.023 \$                            | 10,89 \$  | 11.744.149 \$                                    | 5,46 \$  |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>USD E<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD E<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>USD I (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>USD I (Monatlich)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD I<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD I<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|--|--|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | 2.778.133 \$                          | 11,29 \$  | 30.150.109 \$                                    | 7,39 \$  | 149.382.233 \$                        | 29,75 \$  |
| 31. Dezember 2023 | 1.547.421 \$                          | 10,69 \$  | 39.896.230 \$                                    | 7,45 \$  | 301.321.511 \$                        | 27,54 \$  |
| 31. Dezember 2022 | 2.696.286 \$                          | 9,81 \$   | 56.976.570 \$                                    | 7,20 \$  | 420.046.688 \$                        | 24,73 \$  |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse<br>USD I<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>USD I<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>USD I2 (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>USD I2 (Monatlich)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD I2<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD I2<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--------------------------------------|--|---|---|--|--|
| 31. Dezember 2024 | 38.779.354 \$                        | 10,11 \$                                       | 55.545.279 \$                                     | 8,31 \$   | 214.438.717 \$                         | 16,30 \$   |
| 31. Dezember 2023 | 16.191.311 \$                        | 9,94 \$  | 55.183.017 \$                                     | 8,38 \$   | 224.394.250 \$                         | 15,08 \$   |
| 31. Dezember 2022 | 19.820.534 \$                        | 9,48 \$  | 53.570.112 \$                                     | 8,09 \$   | 265.106.976 \$                         | 13,53 \$   |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## High Yield Bond (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse USD I2 | Ausschüttende Klasse USD I2 | Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich) | Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich) | Thesaurierende Klasse USD M | Thesaurierende Klasse USD M |
|-------------------|-----------------------------|-----------------------------|---|---|-----------------------------|-----------------------------|
|                   | NIW                         | NIW je Anteil               | NIW                                     | NIW je Anteil                           | NIW                         | NIW je Anteil               |
| 31. Dezember 2024 | 193.533.736 \$              | 8,44 \$                     | 103.065.493 \$                          | 9,56 \$                                 | 509.673 \$                  | 14,24 \$                    |
| 31. Dezember 2023 | 220.847.493 \$              | 8,30 \$                     | 140.373.282 \$                          | 9,42 \$                                 | 460.538 \$                  | 13,34 \$                    |
| 31. Dezember 2022 | 156.239.569 \$              | 7,91 \$                     | 124.143.845 \$                          | 8,88 \$                                 | 553.297 \$                  | 12,12 \$                    |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse USD M | Ausschüttende Klasse USD M | Thesaurierende Klasse USD P | Thesaurierende Klasse USD P | Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) | Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) |
|-------------------|----------------------------|----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|--|--|
|                   | NIW                        | NIW je Anteil              | NIW                         | NIW je Anteil               | NIW                                    | NIW je Anteil                          |
| 31. Dezember 2024 | 235.015 \$                 | 7,99 \$                    | 756.512 \$                  | 12,86 \$                    | 130.568.412 \$                         | 5,94 \$                                |
| 31. Dezember 2023 | 347.894 \$                 | 8,01 \$                    | 1.839.803 \$                | 11,89 \$                    | 133.819.218 \$                         | 6,08 \$                                |
| 31. Dezember 2022 | 164.387 \$                 | 7,79 \$                    | 4.400.603 \$                | 10,67 \$                    | 138.874.267 \$                         | 5,95 \$                                |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse USD T (Wöchentlich) | Ausschüttende Klasse USD T (Wöchentlich) | Thesaurierende Klasse USD T | Thesaurierende Klasse USD T | Ausschüttende Klasse USD U (Monatlich) | Ausschüttende Klasse USD U (Monatlich) |
|-------------------|--|--|-----------------------------|-----------------------------|--|--|
|                   | NIW                                      | NIW je Anteil                            | NIW                         | NIW je Anteil               | NIW                                    | NIW je Anteil                          |
| 31. Dezember 2024 | 1.265.130 \$                             | 5,97 \$                                  | 7.915.261 \$                | 14,12 \$                    | 744.567 \$                             | 6,90 \$                                |
| 31. Dezember 2023 | 1.777.914 \$                             | 6,12 \$                                  | 10.920.480 \$               | 13,23 \$                    | 753.439 \$                             | 6,98 \$                                |
| 31. Dezember 2022 | 1.835.534 \$                             | 5,99 \$                                  | 7.598.079 \$                | 12,02 \$                    | 742.761 \$                             | 6,77 \$                                |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD U | Thesaurierende Klasse USD U | Thesaurierende Klasse USD Z | Thesaurierende Klasse USD Z | Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich) | Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich) |
|-------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|--|--|
|                   | NIW                         | NIW je Anteil               | NIW                         | NIW je Anteil               | NIW                                    | NIW je Anteil                          |
| 31. Dezember 2024 | 7.833.933 \$                | 15,81 \$                    | 19.213.744 \$               | 15,40 \$                    | 240.816.592 ZAR                        | 51,81 ZAR                              |
| 31. Dezember 2023 | 7.443.249 \$                | 14,68 \$                    | 44.696.204 \$               | 14,17 \$                    | 299.231.482 ZAR                        | 53,93 ZAR                              |
| 31. Dezember 2022 | 11.371.297 \$               | 13,22 \$                    | 64.829.210 \$               | 12,65 \$                    | 372.548.933 ZAR                        | 53,76 ZAR                              |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich)* | Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich)* | Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich) | Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich) | Thesaurierende Klasse ZAR E | Thesaurierende Klasse ZAR E |
|-------------------|--|--|--|--|-----------------------------|-----------------------------|
|                   | NIW                                      | NIW je Anteil                            | NIW                                    | NIW je Anteil                          | NIW                         | NIW je Anteil               |
| 31. Dezember 2024 | –  | –  | 86.543.337 ZAR                         | 51,23 ZAR                              | 11.365.385 ZAR              | 181,19 ZAR                  |
| 31. Dezember 2023 | 444.980 ZAR                              | 53,88 ZAR                                | 77.989.696 ZAR                         | 53,32 ZAR                              | 5.270.093 ZAR               | 166,67 ZAR                  |
| 31. Dezember 2022 | 7.199.304 ZAR                            | 53,71 ZAR                                | 71.672.740 ZAR                         | 53,15 ZAR                              | 9.921.353 ZAR               | 148,94 ZAR                  |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) | Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) | Thesaurierende Klasse ZAR T | Thesaurierende Klasse ZAR T |
|-------------------|--|--|-----------------------------|-----------------------------|
|                   | NIW                                    | NIW je Anteil                          | NIW                         | NIW je Anteil               |
| 31. Dezember 2024 | 1.401.363.006 ZAR                      | 58,61 ZAR                              | 21.090.534 ZAR              | 170,68 ZAR                  |
| 31. Dezember 2023 | 1.559.123.624 ZAR                      | 60,27 ZAR                              | 18.144.180 ZAR              | 155,44 ZAR                  |
| 31. Dezember 2022 | 1.678.189.332 ZAR                      | 59,48 ZAR                              | 15.485.308 ZAR              | 137,52 ZAR                  |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

| InnovAsia         |                                    |                                    |                                   |                                   |                                    |                                    |
|-------------------|------------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------|
|                   | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF I4 | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF I4 | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I4 | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I4 |
| Geschäftsjahr zum | NIW                                | NIW je Anteil                      | NIW                               | NIW je Anteil                     | NIW                                | NIW je Anteil                      |
| 31. Dezember 2024 | 478.769 CHF                        | 8,60 CHF                           | 21.970 €                          | 8,65 €                            | 419.613 €                          | 9,01 €                             |
| 31. Dezember 2023 | 522.675 CHF                        | 8,10 CHF                           | 20.478 €                          | 8,07 €                            | 738.351 €                          | 8,30 €                             |
| 31. Dezember 2022 | 469.743 CHF                        | 6,39 CHF                           | 282.274 €                         | 6,32 €                            | 810.342 €                          | 6,42 €                             |

|                   | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M (nicht<br>währungsgesichert) | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M (nicht<br>währungsgesichert) | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR X | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR X | Thesaurierende<br>Klasse<br>SGD A | Thesaurierende<br>Klasse<br>SGD A |
|-------------------|--|--|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| Geschäftsjahr zum | NIW  | NIW je Anteil  | NIW                               | NIW je Anteil                     | NIW                               | NIW je Anteil                     |
| 31. Dezember 2024 | 28.376 €   | 10,98 €  | 4.325.329 €                       | 8,72 €                            | 36.296 SGD                        | 17,87 SGD                         |
| 31. Dezember 2023 | 36.614 €   | 9,50 €   | 4.020.738 €                       | 8,11 €                            | 33.870 SGD                        | 16,68 SGD                         |
| 31. Dezember 2022 | 29.209 €   | 7,58 €   | 3.134.258 €                       | 6,33 €                            | 26.331 SGD                        | 12,97 SGD                         |

|                   | Thesaurierende<br>Klasse<br>SGD I4 | Thesaurierende<br>Klasse<br>SGD I4 | Thesaurierende<br>Klasse<br>SGD X | Thesaurierende<br>Klasse<br>SGD X | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A |
|-------------------|------------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| Geschäftsjahr zum | NIW                                | NIW je Anteil                      | NIW                               | NIW je Anteil                     | NIW                               | NIW je Anteil                     |
| 31. Dezember 2024 | 736.947 SGD                        | 18,63 SGD                          | 331.388 SGD                       | 18,03 SGD                         | 3.430.475 \$                      | 9,35 \$                           |
| 31. Dezember 2023 | 1.025.335 SGD                      | 17,18 SGD                          | 314.342 SGD                       | 16,78 SGD                         | 4.546.493 \$                      | 8,57 \$                           |
| 31. Dezember 2022 | 696.450 SGD                        | 13,20 SGD                          | 343.196 SGD                       | 13,02 SGD                         | 125.519 \$                        | 6,55 \$                           |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

InnovAsia (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I4<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I4<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---|---|--|--|
| 31. Dezember 2024 | 41.157 \$                                | 9,63 \$  | 3.085.758 \$                              | 9,75 \$   | 33.786 \$                                | 8,81 \$  |
| 31. Dezember 2023 | 6.636.583 \$                             | 8,76 \$  | 3.983.343 \$                              | 8,83 \$   | 8.129 \$                                 | 8,13 \$  |
| 31. Dezember 2022 | 3.159.260 \$                             | 6,64 \$  | 3.888.909 \$                              | 6,67 \$   | 6.265 \$                                 | 6,26 \$  |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD X<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD X<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|
| 31. Dezember 2024 | 1.257.008 \$                             | 9,45 \$  |
| 31. Dezember 2023 | 1.609.703 \$                             | 8,63 \$  |
| 31. Dezember 2022 | 1.765.309 \$                             | 6,58 \$  |

Japan Equity Engagement

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I5<br>NIW | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I5<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I5*<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I5*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I5 (nicht<br>währungsgesichert)*<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I5(nicht<br>währungsgesichert)*<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|--|--|---|--|
| 31. Dezember 2024 | 37.621 €                                 | 14,13 €  | –  | –  | 21.570.601 £  | 11,37 £  |
| 31. Dezember 2023 | 31.902 €                                 | 11,98 €  | 344.829 £                                  | 10,32 £  | 11.862.066 £  | 10,78 £  |
| 31. Dezember 2022 | 60.111.478 €                             | 9,46 €   | 321.237 £                                  | 8,13 £   | –   | –  |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Japan Equity Engagement (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse                  | Thesaurierende Klasse                            | Thesaurierende Klasse | Thesaurierende Klasse   | Thesaurierende Klasse | Thesaurierende Klasse  |
|-------------------|--|--|-----------------------|-------------------------|-----------------------|------------------------|
|                   | GBP P (nicht währungsgesichert)<br>NIW | GBP P (nicht währungsgesichert)<br>NIW je Anteil | JPY A*<br>NIW         | JPY A*<br>NIW je Anteil | JPY I<br>NIW          | JPY I<br>NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2024 | 10.915.427 £                           | 8,81 £   | 5.028.725 ¥           | 1.074,89 ¥              | 967.449.951 ¥         | 2.002,74 ¥             |
| 31. Dezember 2023 | 11.065.396 £                           | 8,39 £   | –                     | –                       | 154.103.501 ¥         | 1.742,53 ¥             |
| 31. Dezember 2022 | 17.700 £                               | 7,89 £   | –                     | –                       | 503.411.392 ¥         | 1.450,08 ¥             |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse | Ausschüttende Klasse   | Thesaurierende Klasse | Thesaurierende Klasse   | Thesaurierende Klasse | Thesaurierende Klasse  |
|-------------------|----------------------|------------------------|-----------------------|-------------------------|-----------------------|------------------------|
|                   | JPY I<br>NIW         | JPY I<br>NIW je Anteil | JPY I5<br>NIW         | JPY I5<br>NIW je Anteil | JPY Z<br>NIW          | JPY Z<br>NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2024 | 26.863.993 ¥         | 1.971,95 ¥             | 8.261.354.452 ¥       | 13.066,49 ¥             | 222.871.146 ¥         | 1.295,81 ¥             |
| 31. Dezember 2023 | 23.557.609 ¥         | 1.729,24 ¥             | 8.526.499.141 ¥       | 11.320,64 ¥             | 3.284.885.177 ¥       | 1.117,91 ¥             |
| 31. Dezember 2022 | 735.824.128 ¥        | 1.450,06 ¥             | 6.320.326.223 ¥       | 9.380,86 ¥              | 4.464.613.674 ¥       | 922,43 ¥               |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse | Thesaurierende Klasse   | Thesaurierende Klasse | Thesaurierende Klasse   | Thesaurierende Klasse                    | Thesaurierende Klasse                              |
|-------------------|-----------------------|-------------------------|-----------------------|-------------------------|--|--|
|                   | USD A*<br>NIW         | USD A*<br>NIW je Anteil | USD I*<br>NIW         | USD I*<br>NIW je Anteil | USD I5 (nicht währungsgesichert)*<br>NIW | USD I5 (nicht währungsgesichert)*<br>NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2024 | 33.075 \$             | 11,03 \$                | 34.191 \$             | 11,40 \$                | 9.897.435 \$                             | 9,72 \$  |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Japan Equity Engagement (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD X (nicht währungsgesichert)* NIW | Thesaurierende Klasse USD X (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|
| 31. Dezember 2024 | 43.179.558 \$  | 9,49 \$  |

Macro Opportunities FX\*\*

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR I* NIW | Thesaurierende Klasse EUR I* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP Z* NIW | Thesaurierende Klasse GBP Z* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse SEK I* NIW | Thesaurierende Klasse SEK I* NIW je Anteil |
|-------------------|----------------------------------|--|----------------------------------|--|----------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | –                                | –  | –                                | –  | –                                | –  |
| 31. Dezember 2023 | 1.264.954 €                      | 9,53 €                                     | 20.546 £                         | 10,25 £                                    | 16.510.843 SEK                   | 96,92 SEK                                  |
| 31. Dezember 2022 | 1.066.163 €                      | 9,23 €                                     | 162.743 £                        | 9,71 £                                     | 263.295.231 SEK                  | 93,64 SEK                                  |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse SEK I* NIW | Ausschüttende Klasse SEK I* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I* NIW | Thesaurierende Klasse USD I* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD Z* NIW | Thesaurierende Klasse USD Z* NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------|---|----------------------------------|--|----------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | –                               | –   | –                                | –  | –                                | –  |
| 31. Dezember 2023 | 37.342 SEK                      | 100,20 SEK                                | 11.032 \$                        | 10,21 \$                                   | 83.264 \$                        | 10,46 \$                                   |
| 31. Dezember 2022 | 72.218 SEK                      | 96,89 SEK                                 | 10.440 \$                        | 9,66 \$                                    | 6.993.860 \$                     | 9,84 \$                                    |

\*\* Das Portfolio wurde am 8. Februar 2024 aufgelöst.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Multi-Asset Income\*\*

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse GBP P* | Ausschüttende Klasse GBP P* | Thesaurierende Klasse USD A* | Thesaurierende Klasse USD A* | Thesaurierende Klasse USD C1* | Thesaurierende Klasse USD C1* |
|-------------------|-----------------------------|-----------------------------|------------------------------|------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|
|                   | NIW                         | NIW je Anteil               | NIW                          | NIW je Anteil                | NIW                           | NIW je Anteil                 |
| 31. Dezember 2024 | –                           | –                           | –                            | –                            | –                             | –                             |
| 31. Dezember 2023 | –                           | –                           | –                            | –                            | –                             | –                             |
| 31. Dezember 2022 | 19.140 £                    | 8,21 £                      | 6.738.767 \$                 | 10,32 \$                     | 2.328.953 \$                  | 9,89 \$                       |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD I* | Thesaurierende Klasse USD I* | Ausschüttende Klasse USD I* | Ausschüttende Klasse USD I* | Thesaurierende Klasse USD M* | Thesaurierende Klasse USD M* |
|-------------------|------------------------------|------------------------------|-----------------------------|-----------------------------|------------------------------|------------------------------|
|                   | NIW                          | NIW je Anteil                | NIW                         | NIW je Anteil               | NIW                          | NIW je Anteil                |
| 31. Dezember 2024 | –                            | –                            | –                           | –                           | –                            | –                            |
| 31. Dezember 2023 | –                            | –                            | –                           | –                           | –                            | –                            |
| 31. Dezember 2022 | 685.261 \$                   | 11,59 \$                     | 107.660 \$                  | 8,72 \$                     | 1.477.940 \$                 | 10,04 \$                     |

\*\* Das Portfolio wurde am 6. Juli 2023 aufgelöst.

## Next Generation Connectivity

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse AUD A | Thesaurierende Klasse AUD A | Thesaurierende Klasse AUD E* | Thesaurierende Klasse AUD E* | Thesaurierende Klasse AUD I2* | Thesaurierende Klasse AUD I2* |
|-------------------|-----------------------------|-----------------------------|------------------------------|------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|
|                   | NIW                         | NIW je Anteil               | NIW                          | NIW je Anteil                | NIW                           | NIW je Anteil                 |
| 31. Dezember 2024 | 24.588.263 AUD              | 14,15 AUD                   | 1.464.287 AUD                | 11,65 AUD                    | 70.127 AUD                    | 15,03 AUD                     |
| 31. Dezember 2023 | 20.787.257 AUD              | 10,77 AUD                   | –                            | –                            | 52.808 AUD                    | 11,32 AUD                     |
| 31. Dezember 2022 | 17.057.259 AUD              | 7,98 AUD                    | –                            | –                            | –                             | –                             |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Next Generation Connectivity (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse CHF A* | Thesaurierende Klasse CHF A* | Thesaurierende Klasse CHF I* | Thesaurierende Klasse CHF I* | Thesaurierende Klasse CHF I2* | Thesaurierende Klasse CHF I2* |
|-------------------|------------------------------|------------------------------|------------------------------|------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|
|                   | NIW                          | NIW je Anteil                | NIW                          | NIW je Anteil                | NIW                           | NIW je Anteil                 |
| 31. Dezember 2024 | 35.887 CHF                   | 13,66 CHF                    | 36.321 CHF                   | 13,83 CHF                    | 39.550 CHF                    | 14,79 CHF                     |
| 31. Dezember 2023 | 27.888 CHF                   | 10,62 CHF                    | 27.986 CHF                   | 10,65 CHF                    | 30.421 CHF                    | 11,37 CHF                     |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse CNY A | Thesaurierende Klasse CNY A | Thesaurierende Klasse CNY I2* | Thesaurierende Klasse CNY I2* | Thesaurierende Klasse EUR A | Thesaurierende Klasse EUR A |
|-------------------|-----------------------------|-----------------------------|-------------------------------|-------------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
|                   | NIW                         | NIW je Anteil               | NIW                           | NIW je Anteil                 | NIW                         | NIW je Anteil               |
| 31. Dezember 2024 | 2.957.000 CNY               | 99,91 CNY                   | 326.333 CNY                   | 149,63 CNY                    | 43.096.570 €                | 14,74 €                     |
| 31. Dezember 2023 | 2.264.556 CNY               | 76,51 CNY                   | 247.376 CNY                   | 113,42 CNY                    | 44.215.951 €                | 11,22 €                     |
| 31. Dezember 2022 | 2.370.930 CNY               | 57,01 CNY                   | –                             | –                             | 43.082.992 €                | 8,32 €                      |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert) | Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert) | Thesaurierende Klasse EUR I | Thesaurierende Klasse EUR I | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) |
|-------------------|---|---|-----------------------------|-----------------------------|---|---|
|                   | NIW   | NIW je Anteil   | NIW                         | NIW je Anteil               | NIW   | NIW je Anteil   |
| 31. Dezember 2024 | 86.668.190 €  | 17,79 €   | 51.120.479 €                | 13,91 €                     | 48.333.322 €  | 17,46 €   |
| 31. Dezember 2023 | 54.229.594 €  | 12,48 €   | 40.203.669 €                | 10,50 €                     | 44.112.500 €  | 12,14 €   |
| 31. Dezember 2022 | 54.125.094 €  | 9,34 €  | 39.268.790 €                | 7,73 €                      | 43.589.698 €  | 9,01 €  |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Next Generation Connectivity (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR I2* NIW | Thesaurierende Klasse EUR I2* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I5 NIW | Thesaurierende Klasse EUR I5 NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil |
|-------------------|-----------------------------------|---|----------------------------------|--|---|---|
| 31. Dezember 2024 | 41.946 €                          | 15,03 €                                     | 24.874 €                         | 12,66 €                                    | 57.764.844 €  | 17,13 €   |
| 31. Dezember 2023 | 31.606 €                          | 11,32 €                                     | 18.694 €                         | 9,51 €                                     | 58.300.824 €  | 12,11 €   |
| 31. Dezember 2022 | –                                 | –   | 1.352.834 €                      | 6,97 €                                     | 44.772.549 €  | 9,14 €  |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse GBP A NIW | Thesaurierende Klasse GBP A NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP I2* NIW | Thesaurierende Klasse GBP I2* NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------|---|---|---|-----------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | 8.652.932 £                     | 15,37 £                                   | 394.453 £   | 14,11 £   | 36.628 £                          | 15,26 £                                     |
| 31. Dezember 2023 | 9.193.764 £                     | 11,57 £                                   | 295.419 £   | 10,28 £   | 27.290 £                          | 11,37 £                                     |
| 31. Dezember 2022 | 10.322.335 £                    | 8,45 £                                    | 535.353 £   | 7,81 £  | –                                 | –   |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse HKD A NIW | Thesaurierende Klasse HKD A NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse HKD I2* NIW | Thesaurierende Klasse HKD I2* NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse SGD A NIW | Thesaurierende Klasse SGD A NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------|---|-----------------------------------|---|---------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | 104.305.762 HKD                 | 15,95 HKD                                 | 672.177 HKD                       | 15,24 HKD                                   | 37.025.070 SGD                  | 30,80 SGD                                 |
| 31. Dezember 2023 | 49.137.389 HKD                  | 12,04 HKD                                 | 267.255 HKD                       | 11,39 HKD                                   | 41.638.661 SGD                  | 23,47 SGD                                 |
| 31. Dezember 2022 | 47.629.183 HKD                  | 8,80 HKD                                  | –                                 | –   | 39.375.609 SGD                  | 17,27 SGD                                 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Next Generation Connectivity (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse SGD I2*<br>NIW | Thesaurierende Klasse SGD I2*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD A<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD A<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD E*<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD E*<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--------------------------------------|--|------------------------------------|--|-------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | 61.279 SGD                           | 30,05 SGD                                      | 380.713.098 \$                     | 16,85 \$                                     | 12.360.332 \$                       | 15,77 \$                                      |
| 31. Dezember 2023 | 46.226 SGD                           | 22,67 SGD                                      | 439.282.138 \$                     | 12,60 \$                                     | 708.213 \$                          | 11,92 \$                                      |
| 31. Dezember 2022 | –                                    | –  | 421.532.776 \$                     | 9,12 \$                                      | –                                   | –   |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD I<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I2<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I2<br>NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|-----------------------------------|---|-------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | 105.879.265 \$                     | 18,40 \$                                     | 18.074.687 \$                     | 18,40 \$                                    | 1.420.488 \$                        | 11,80 \$                                      |
| 31. Dezember 2023 | 126.685.506 \$                     | 13,65 \$                                     | 21.016.657 \$                     | 13,65 \$                                    | 852.918 \$                          | 8,74 \$                                       |
| 31. Dezember 2022 | 144.216.650 \$                     | 9,79 \$                                      | 18.941.211 \$                     | 9,79 \$                                     | 6.231.632 \$                        | 6,26 \$                                       |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD I3<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I3<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I5<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I5<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD M<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD M<br>NIW je Anteil |
|-------------------|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 137.252.997 \$                      | 12,57 \$                                      | 20.739.855 \$                       | 17,20 \$                                      | 16.421.866 \$                      | 14,62 \$                                     |
| 31. Dezember 2023 | 83.057.543 \$                       | 9,30 \$                                       | 15.006.722 \$                       | 12,70 \$                                      | 25.425.604 \$                      | 11,02 \$                                     |
| 31. Dezember 2022 | 64.460.647 \$                       | 6,65 \$                                       | 11.306.667 \$                       | 9,07 \$                                       | 23.507.641 \$                      | 8,04 \$                                      |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Next Generation Connectivity (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD Z<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD Z<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse ZAR A*<br>NIW | Thesaurierende Klasse ZAR A*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse ZAR E*<br>NIW | Thesaurierende Klasse ZAR E*<br>NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | 384.575 \$                         | 11,94 \$                                     | 27.899.681 ZAR                      | 171,86 ZAR                                    | 30.711.281 ZAR                      | 170,82 ZAR                                    |
| 31. Dezember 2023 | 951.757 \$                         | 8,78 \$                                      | 3.680.438 ZAR                       | 125,63 ZAR                                    | 2.072.410 ZAR                       | 126,25 ZAR                                    |
| 31. Dezember 2022 | 700.508 \$                         | 6,24 \$                                      | –                                   | –   | –                                   | –   |

## Next Generation Mobility

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR A<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR A<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)<br>NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|------------------------------------|--|--|--|
| 31. Dezember 2024 | 109.883 €                          | 13,92 €                                      | 39.629 €                           | 10,01 €                                      | 32.082.498 €   | 17,63 €  |
| 31. Dezember 2023 | 159.766 €                          | 14,54 €                                      | 41.022 €                           | 10,36 €                                      | 39.387.728 €   | 16,80 €  |
| 31. Dezember 2022 | 132.041 €                          | 11,62 €                                      | 269.618 €                          | 8,21 €                                       | 36.872.226 €   | 13,43 €  |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD A<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD A<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD C1<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD C1<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|------------------------------------|--|-------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | 25.808.131 €   | 19,97 €  | 25.301.573 \$                      | 16,41 \$                                     | 650.441 \$                          | 17,38 \$                                      |
| 31. Dezember 2023 | 34.429.616 €   | 19,34 €  | 32.890.078 \$                      | 16,82 \$                                     | 1.572.905 \$                        | 17,99 \$                                      |
| 31. Dezember 2022 | 30.152.894 €   | 15,72 €  | 26.824.764 \$                      | 13,10 \$                                     | 1.947.673 \$                        | 14,16 \$                                      |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Next Generation Mobility (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>NIW je Anteil | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I<br>NIW | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---|---|--|--|
| 31. Dezember 2024 | 16.314.690 \$                            | 16,87 \$   | 3.206.359 \$                            | 16,86 \$  | 3.650.214 \$                             | 17,57 \$   |
| 31. Dezember 2023 | 8.977.632 \$                             | 17,15 \$   | 6.463.904 \$                            | 17,14 \$  | 7.433.399 \$                             | 18,16 \$   |
| 31. Dezember 2022 | 4.906.268 \$                             | 13,25 \$   | 5.581.715 \$                            | 13,24 \$  | 7.055.187 \$                             | 14,25 \$   |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD X<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD X<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|
| 31. Dezember 2024 | 13.562.036 \$                            | 19,44 \$   |
| 31. Dezember 2023 | 25.442.335 \$                            | 19,90 \$   |
| 31. Dezember 2022 | 29.578.839 \$                            | 15,48 \$   |

Next Generation Space Economy

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A (nicht<br>währungsgesichert)*<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A (nicht<br>währungsgesichert)*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I3 (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I3 (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|--|--|---|---|
| 31. Dezember 2024 | 10.078 €   | 10,94 €  | 25.264.748 €   | 15,77 €  | 23.625.549 €  | 14,99 €   |
| 31. Dezember 2023 | –  | –  | 10.045.792 €   | 11,72 €  | 4.431.301 €   | 11,36 €   |
| 31. Dezember 2022 | –  | –  | 4.206.616 €  | 9,51 €   | 1.061.485 €   | 9,39 €  |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Next Generation Space Economy (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD A*<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD A*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I<br>NIW je Anteil |
|-------------------|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 10.431 \$                           | 10,43 \$                                      | 8.022.485 \$                       | 15,38 \$                                     |
| 31. Dezember 2023 | –                                   | –   | 3.668.583 \$                       | 12,23 \$                                     |
| 31. Dezember 2022 | –                                   | –   | 2.882.343 \$                       | 9,61 \$                                      |

## Short Duration Emerging Market Debt

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse CHF A<br>NIW | Thesaurierende Klasse CHF A<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---|---|---|---|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 1.844.381 AUD                                 | 7,83 AUD  | 417.353 CAD                                   | 8,20 CAD  | 3.683.491 CHF                      | 9,92 CHF                                     |
| 31. Dezember 2023 | 1.587.360 AUD                                 | 7,87 AUD  | 418.704 CAD                                   | 8,23 CAD  | 3.242.251 CHF                      | 9,54 CHF                                     |
| 31. Dezember 2022 | 2.610.697 AUD                                 | 7,91 AUD  | 4.375.456 CAD                                 | 8,21 CAD  | 4.483.337 CHF                      | 9,23 CHF                                     |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse CHF A<br>NIW | Ausschüttende Klasse CHF A<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse CHF I<br>NIW | Thesaurierende Klasse CHF I<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse CHF I<br>NIW | Ausschüttende Klasse CHF I<br>NIW je Anteil |
|-------------------|-----------------------------------|---|------------------------------------|--|-----------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | 491.649 CHF                       | 6,83 CHF                                    | 5.351.236 CHF                      | 10,46 CHF                                    | 21.944 CHF                        | 6,86 CHF                                    |
| 31. Dezember 2023 | 566.322 CHF                       | 6,80 CHF                                    | 6.601.108 CHF                      | 10,01 CHF                                    | 725.354 CHF                       | 6,82 CHF                                    |
| 31. Dezember 2022 | 824.695 CHF                       | 6,80 CHF                                    | 12.634.709 CHF                     | 9,64 CHF                                     | 1.149.563 CHF                     | 6,82 CHF                                    |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF I2<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF I2<br>NIW je Anteil | Ausschüttende<br>Klasse<br>CHF I2<br>NIW | Ausschüttende<br>Klasse<br>CHF I2<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF I5<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF I5<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---|---|--|--|---|---|
| 31. Dezember 2024 | 5.150.426 CHF                             | 10,69 CHF   | 60.962 CHF                               | 7,52 CHF   | 592.261 CHF                               | 10,93 CHF   |
| 31. Dezember 2023 | 10.145.427 CHF                            | 10,23 CHF   | 60.679 CHF                               | 7,49 CHF   | 1.561.093 CHF                             | 10,44 CHF   |
| 31. Dezember 2022 | 19.647.200 CHF                            | 9,84 CHF  | 12.395.410 CHF                           | 7,49 CHF   | 1.515.754 CHF                             | 10,02 CHF   |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF P<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF P<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A<br>NIW je Anteil | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR A<br>NIW | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR A<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|--|--|---|---|
| 31. Dezember 2024 | 38.060.962 CHF                           | 10,11 CHF  | 101.462.687 €                            | 10,72 €  | 12.836.792 €                            | 7,39 €  |
| 31. Dezember 2023 | 29.312.877 CHF                           | 9,68 CHF   | 104.971.926 €                            | 10,06 €  | 15.305.883 €                            | 7,18 €  |
| 31. Dezember 2022 | 27.905.942 CHF                           | 9,32 CHF   | 117.630.713 €                            | 9,55 €   | 16.574.105 €                            | 7,04 €  |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I<br>NIW je Anteil | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I<br>NIW | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I2<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I2<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---|---|---|---|
| 31. Dezember 2024 | 796.333.586 €                            | 11,31 €  | 143.152.342 €                           | 7,40 €  | 245.004.089 €                             | 11,42 €   |
| 31. Dezember 2023 | 685.080.531 €                            | 10,56 €  | 154.181.903 €                           | 7,18 €  | 181.322.110 €                             | 10,65 €   |
| 31. Dezember 2022 | 712.003.973 €                            | 9,98 €   | 163.594.524 €                           | 7,05 €  | 214.675.538 €                             | 10,06 €   |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse<br>EUR I2<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>EUR I2<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>EUR I5<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>EUR I5<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>EUR M<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>EUR M<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|--|--|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | 46.048.583 €                          | 8,01 €  | 6.546.674 €                            | 11,88 €  | 4.127.601 €                           | 10,34 €   |
| 31. Dezember 2023 | 52.300.087 €                          | 7,77 €  | 6.260.518 €                            | 11,07 €  | 2.460.584 €                           | 9,76 €  |
| 31. Dezember 2022 | 59.488.811 €                          | 7,63 €  | 6.256.930 €                            | 10,43 €  | 2.699.887 €                           | 9,33 €  |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse<br>EUR M<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>EUR M<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>EUR P<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>EUR P<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>EUR U<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>EUR U<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--------------------------------------|--|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | 3.996.251 €                          | 6,89 €   | 25.176.093 €                          | 10,85 €   | 2.089.583 €                           | 10,70 €   |
| 31. Dezember 2023 | 1.819.533 €                          | 6,80 €   | 51.801.428 €                          | 10,12 €   | 2.806.177 €                           | 10,01 €   |
| 31. Dezember 2022 | 1.109.542 €                          | 6,79 €   | 108.476.284 €                         | 9,56 €  | 3.889.492 €                           | 9,49 €  |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse<br>EUR X*<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>EUR X*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>GBP A<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP A<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>GBP I<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP I<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | –                                     | –   | 1.648.145 £                           | 11,56 £   | 1.336.124 £                           | 12,02 £   |
| 31. Dezember 2023 | 50.236.839 €                          | 8,97 €  | 1.023.476 £                           | 10,69 £   | 2.374.631 £                           | 11,06 £   |
| 31. Dezember 2022 | 49.291.318 €                          | 8,80 €  | 1.784.594 £                           | 10,00 £   | 4.696.255 £                           | 10,30 £   |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse<br>GBP I<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>GBP I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>GBP I2<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP I2<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>GBP I2<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>GBP I2<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--------------------------------------|--|--|--|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | 1.079.907 £                          | 8,98 £   | 479.273 £                              | 12,04 £  | 8.150.421 £                           | 8,82 £  |
| 31. Dezember 2023 | 1.563.847 £                          | 8,59 £   | 470.199 £                              | 11,06 £  | 11.769.917 £                          | 8,43 £  |
| 31. Dezember 2022 | 3.745.024 £                          | 8,30 £   | 2.008.405 £                            | 10,29 £  | 504.532.899 £                         | 8,15 £  |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse<br>GBP I5<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>GBP I5<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>GBP P<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP P<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>JPY I<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>JPY I<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | 138.965.365 £                         | 8,29 £  | 3.800.244 £                           | 11,29 £   | 73.997.937.525 ¥                      | 1.075,61 ¥                                      |
| 31. Dezember 2023 | 143.767.963 £                         | 7,92 £  | 1.773.074 £                           | 10,39 £   | 78.935.623.550 ¥                      | 1.045,62 ¥                                      |
| 31. Dezember 2022 | 130.424.601 £                         | 7,66 £  | 1.656.455 £                           | 9,67 £  | 90.490.215.829 ¥                      | 1.024,16 ¥                                      |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse<br>JPY I<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>JPY I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>SEK A<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>SEK A<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>SGD A (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>SGD A (Monatlich)<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--------------------------------------|--|---------------------------------------|---|--|--|
| 31. Dezember 2024 | 5.218.755.105 ¥                      | 700,01 ¥                                       | 8.491.474 SEK                         | 104,55 SEK                                      | 71.092.425 SGD                                   | 15,83 SGD  |
| 31. Dezember 2023 | 3.877.798.381 ¥                      | 707,66 ¥                                       | 10.553.645 SEK                        | 98,35 SEK                                       | 60.789.842 SGD                                   | 16,04 SGD  |
| 31. Dezember 2022 | 3.875.746.192 ¥                      | 719,95 ¥                                       | 15.573.259 SEK                        | 93,27 SEK                                       | 40.192.701 SGD                                   | 16,13 SGD  |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | Thesaurierende Klasse USD A | Thesaurierende Klasse USD A | Ausschüttende Klasse USD A | Ausschüttende Klasse USD A |
|-------------------|--|--|-----------------------------|-----------------------------|----------------------------|----------------------------|
|                   | NIW                                    | NIW je Anteil                          | NIW                         | NIW je Anteil               | NIW                        | NIW je Anteil              |
| 31. Dezember 2024 | 33.990.925 \$                          | 8,31 \$                                | 399.826.172 \$              | 13,16 \$                    | 69.245.219 \$              | 8,85 \$                    |
| 31. Dezember 2023 | 28.236.679 \$                          | 8,26 \$                                | 359.043.792 \$              | 12,14 \$                    | 89.729.509 \$              | 8,44 \$                    |
| 31. Dezember 2022 | 23.230.997 \$                          | 8,19 \$                                | 412.842.165 \$              | 11,29 \$                    | 119.519.572 \$             | 8,11 \$                    |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD C1 | Thesaurierende Klasse USD C1 | Ausschüttende Klasse USD C1 | Ausschüttende Klasse USD C1 | Thesaurierende Klasse USD I | Thesaurierende Klasse USD I |
|-------------------|------------------------------|------------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
|                   | NIW                          | NIW je Anteil                | NIW                         | NIW je Anteil               | NIW                         | NIW je Anteil               |
| 31. Dezember 2024 | 17.937.235 \$                | 11,11 \$                     | 2.674.554 \$                | 9,34 \$                     | 740.813.044 \$              | 13,88 \$                    |
| 31. Dezember 2023 | 32.808.938 \$                | 10,35 \$                     | 2.808.791 \$                | 8,92 \$                     | 678.406.064 \$              | 12,74 \$                    |
| 31. Dezember 2022 | 37.919.286 \$                | 9,72 \$                      | 3.929.202 \$                | 8,57 \$                     | 741.407.065 \$              | 11,79 \$                    |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse USD I | Ausschüttende Klasse USD I | Thesaurierende Klasse USD I2 | Thesaurierende Klasse USD I2 | Ausschüttende Klasse USD I2 | Ausschüttende Klasse USD I2 |
|-------------------|----------------------------|----------------------------|------------------------------|------------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
|                   | NIW                        | NIW je Anteil              | NIW                          | NIW je Anteil                | NIW                         | NIW je Anteil               |
| 31. Dezember 2024 | 59.712.431 \$              | 9,40 \$                    | 30.647.372 \$                | 13,66 \$                     | 15.606.357 \$               | 9,39 \$                     |
| 31. Dezember 2023 | 81.258.937 \$              | 8,97 \$                    | 36.449.926 \$                | 12,52 \$                     | 11.897.708 \$               | 8,96 \$                     |
| 31. Dezember 2022 | 81.356.489 \$              | 8,62 \$                    | 159.773.031 \$               | 11,58 \$                     | 88.468.242 \$               | 8,61 \$                     |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD I5<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I5<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I5<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD I5<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD M<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD M<br>NIW je Anteil |
|-------------------|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 5.318.579 \$                        | 14,18 \$                                      | 12.103.996 \$                      | 9,00 \$                                      | 46.387.154 \$                      | 11,45 \$                                     |
| 31. Dezember 2023 | 5.068.035 \$                        | 12,98 \$                                      | 15.103.012 \$                      | 8,58 \$                                      | 44.715.996 \$                      | 10,62 \$                                     |
| 31. Dezember 2022 | 5.538.850 \$                        | 11,98 \$                                      | 21.165.474 \$                      | 8,25 \$                                      | 42.163.321 \$                      | 9,94 \$                                      |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse USD M<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD M<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD P<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD P<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD Z<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD Z<br>NIW je Anteil |
|-------------------|-----------------------------------|---|------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 6.734.452 \$                      | 8,26 \$                                     | 61.454.396 \$                      | 13,45 \$                                     | 25.001.306 \$                      | 14,48 \$                                     |
| 31. Dezember 2023 | 8.351.328 \$                      | 8,02 \$                                     | 184.482.252 \$                     | 12,34 \$                                     | 24.595.101 \$                      | 13,22 \$                                     |
| 31. Dezember 2022 | 9.583.244 \$                      | 7,84 \$                                     | 188.567.221 \$                     | 11,42 \$                                     | 14.055.349 \$                      | 12,18 \$                                     |

Short Duration Euro Bond

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse CHF P<br>NIW | Thesaurierende Klasse CHF P<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse CHF U<br>NIW | Thesaurierende Klasse CHF U<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR A<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR A<br>NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 790.589 CHF                        | 106,84 CHF                                   | 4.804.297 CHF                      | 105,98 CHF                                   | 136.545.355 €                      | 107,40 €                                     |
| 31. Dezember 2023 | 806.151 CHF                        | 102,04 CHF                                   | 5.645.975 CHF                      | 101,34 CHF                                   | 19.721.648 €                       | 100,22 €                                     |
| 31. Dezember 2022 | 770.086 CHF                        | 97,48 CHF                                    | 6.454.030 CHF                      | 96,91 CHF                                    | 5.076.654 €                        | 94,09 €                                      |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Short Duration Euro Bond (Fortsetzung)

|                          | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I<br>NIW je Anteil | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I<br>NIW | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I2<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I2<br>NIW je Anteil |
|--------------------------|--|--|---|---|---|---|
| <b>Geschäftsjahr zum</b> |  |  |   |   |   |   |
| 31. Dezember 2024        | 1.294.842.582 €                          | 113,68 €   | 8.220.459 €                             | 104,65 €  | 90.478.802 €                              | 112,41 €  |
| 31. Dezember 2023        | 611.815.516 €                            | 105,88 €   | 5.218.533 €                             | 99,85 €   | 84.236.821 €                              | 104,65 €  |
| 31. Dezember 2022        | 504.982.352 €                            | 99,21 €  | 1.514.355 €                             | 95,44 €   | 49.163.695 €                              | 98,02 €   |

|                          | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I5<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I5<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR U<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR U<br>NIW je Anteil |
|--------------------------|---|---|--|--|--|--|
| <b>Geschäftsjahr zum</b> |   |   |  |  |  |  |
| 31. Dezember 2024        | 212.357.837 €                             | 114,31 €  | 91.477.780 €                             | 105,86 €   | 34.090.465 €                             | 111,51 €   |
| 31. Dezember 2023        | 179.474.473 €                             | 106,36 €  | 8.273.743 €                              | 98,98 €  | 10.246.656 €                             | 103,96 €   |
| 31. Dezember 2022        | 163.327.491 €                             | 99,56 €   | 75.202 €                                 | 93,22 €  | 3.981.734 €                              | 97,51 €  |

|                          | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR Z<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR Z<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z<br>NIW je Anteil |
|--------------------------|--|--|--|--|--|--|
| <b>Geschäftsjahr zum</b> |  |  |  |  |  |  |
| 31. Dezember 2024        | 1.876.946 €                              | 115,22 €   | 1.935.616 \$                             | 114,53 \$  | 63.414 \$                                | 128,18 \$  |
| 31. Dezember 2023        | 2.038.202 €                              | 107,11 €   | 2.128.401 \$                             | 104,93 \$  | 67.391.984 \$                            | 117,20 \$  |
| 31. Dezember 2022        | 2.239.437 €                              | 100,17 €   | 2.354.804 \$                             | 96,33 \$   | 86.457.213 \$                            | 107,40 \$  |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Short Duration High Yield Engagement

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse<br>AUD A (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>AUD A (Monatlich)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>CHF A<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>CHF A<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>CHF I<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>CHF I<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | 2.400.393 AUD                                    | 6,93 AUD   | 449.472 CHF                           | 11,46 CHF                                       | 245.102 CHF                           | 12,57 CHF                                       |
| 31. Dezember 2023 | 1.140.803 AUD                                    | 7,10 AUD   | 441.932 CHF                           | 11,27 CHF                                       | 239.547 CHF                           | 12,28 CHF                                       |
| 31. Dezember 2022 | 1.192.743 AUD                                    | 7,08 AUD   | 790.227 CHF                           | 10,75 CHF                                       | 227.034 CHF                           | 11,64 CHF                                       |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse<br>CNY A (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>CNY A (Monatlich)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>EUR A<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>EUR A<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>EUR A<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>EUR A<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---------------------------------------|---|--------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 1.926.981 CNY                                    | 80,40 CNY  | 12.035.996 €                          | 12,58 €   | 2.104.531 €                          | 6,83 €   |
| 31. Dezember 2023 | 2.036.218 CNY                                    | 83,39 CNY  | 12.464.115 €                          | 12,07 €   | 1.917.691 €                          | 6,89 €   |
| 31. Dezember 2022 | 2.048.761 CNY                                    | 84,25 CNY  | 11.761.196 €                          | 11,29 €   | 2.515.236 €                          | 6,76 €   |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>EUR I<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>EUR I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>EUR I2<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>EUR I2<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>EUR M<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>EUR M<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|--|--|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | 17.597.493 €                          | 13,58 €   | 25.317.542 €                           | 12,60 €  | 1.191.141 €                           | 11,03 €   |
| 31. Dezember 2023 | 50.324.368 €                          | 12,94 €   | 42.272.021 €                           | 12,01 €  | 976.342 €                             | 10,64 €   |
| 31. Dezember 2022 | 39.889.511 €                          | 12,03 €   | 5.785.967 €                            | 11,15 €  | 922.543 €                             | 10,01 €   |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Short Duration High Yield Engagement (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse EUR M | Ausschüttende Klasse EUR M | Thesaurierende Klasse GBP I | Thesaurierende Klasse GBP I | Ausschüttende Klasse GBP I | Ausschüttende Klasse GBP I |
|-------------------|----------------------------|----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|----------------------------|----------------------------|
|                   | NIW                        | NIW je Anteil              | NIW                         | NIW je Anteil               | NIW                        | NIW je Anteil              |
| 31. Dezember 2024 | 560.835 €                  | 6,64 €                     | 211.879 £                   | 15,31 £                     | 56.804.966 £               | 7,84 £                     |
| 31. Dezember 2023 | 604.904 €                  | 6,83 €                     | 395.559 £                   | 14,40 £                     | 55.855.459 £               | 7,80 £                     |
| 31. Dezember 2022 | 630.438 €                  | 6,83 €                     | 15.610.824 £                | 13,18 £                     | 2.403.578 £                | 7,53 £                     |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse GBP I2 | Thesaurierende Klasse GBP I2 | Ausschüttende Klasse GBP I2 | Ausschüttende Klasse GBP I2 | Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) |
|-------------------|------------------------------|------------------------------|-----------------------------|-----------------------------|--|--|
|                   | NIW                          | NIW je Anteil                | NIW                         | NIW je Anteil               | NIW                                    | NIW je Anteil                          |
| 31. Dezember 2024 | 1.401.126 £                  | 14,25 £                      | 705.357 £                   | 7,64 £                      | 815.756 HKD                            | 9,86 HKD                               |
| 31. Dezember 2023 | 1.317.678 £                  | 13,38 £                      | 910.689 £                   | 7,60 £                      | 1.544.860 HKD                          | 10,06 HKD                              |
| 31. Dezember 2022 | 1.217.801 £                  | 12,24 £                      | 1.385.249 £                 | 7,34 £                      | 2.368.192 HKD                          | 9,97 HKD                               |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse JPY I | Thesaurierende Klasse JPY I | Ausschüttende Klasse JPY I* | Ausschüttende Klasse JPY I* | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) |
|-------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|--|--|
|                   | NIW                         | NIW je Anteil               | NIW                         | NIW je Anteil               | NIW                                    | NIW je Anteil                          |
| 31. Dezember 2024 | 17.346.478.298 ¥            | 1.261,49 ¥                  | –                           | –                           | 5.142.088 SGD                          | 14,49 SGD                              |
| 31. Dezember 2023 | 16.995.177.792 ¥            | 1.250,95 ¥                  | 1.498.004.233 ¥             | 998,67 ¥                    | 3.611.052 SGD                          | 14,92 SGD                              |
| 31. Dezember 2022 | 17.584.604.152 ¥            | 1.205,68 ¥                  | 1.522.033.806 ¥             | 1.014,69 ¥                  | 2.179.241 SGD                          | 14,86 SGD                              |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Short Duration High Yield Engagement (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse<br>USD A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse<br>USD A (Monatlich) | Thesaurierende Klasse<br>USD A | Thesaurierende Klasse<br>USD A | Ausschüttende Klasse<br>USD A | Ausschüttende Klasse<br>USD A |
|-------------------|---|---|--------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|
|                   | NIW                                       | NIW je Anteil                             | NIW                            | NIW je Anteil                  | NIW                           | NIW je Anteil                 |
| 31. Dezember 2024 | 10.887.437 \$                             | 7,62 \$                                   | 39.448.678 \$                  | 15,20 \$                       | 7.760.333 \$                  | 8,30 \$                       |
| 31. Dezember 2023 | 4.053.791 \$                              | 7,71 \$                                   | 34.032.810 \$                  | 14,33 \$                       | 8.347.581 \$                  | 8,23 \$                       |
| 31. Dezember 2022 | 3.099.464 \$                              | 7,57 \$                                   | 35.220.346 \$                  | 13,11 \$                       | 9.519.536 \$                  | 7,91 \$                       |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>USD C1 | Thesaurierende Klasse<br>USD C1 | Thesaurierende Klasse<br>USD I | Thesaurierende Klasse<br>USD I | Ausschüttende Klasse<br>USD I | Ausschüttende Klasse<br>USD I |
|-------------------|---------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|
|                   | NIW                             | NIW je Anteil                   | NIW                            | NIW je Anteil                  | NIW                           | NIW je Anteil                 |
| 31. Dezember 2024 | 2.474.809 \$                    | 11,65 \$                        | 123.993.466 \$                 | 16,42 \$                       | 70.522.281 \$                 | 8,49 \$                       |
| 31. Dezember 2023 | 2.836.248 \$                    | 11,10 \$                        | 130.562.204 \$                 | 15,39 \$                       | 190.980.125 \$                | 8,42 \$                       |
| 31. Dezember 2022 | 3.953.039 \$                    | 10,26 \$                        | 121.367.229 \$                 | 14,00 \$                       | 2.566.217 \$                  | 8,09 \$                       |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>USD I2 | Thesaurierende Klasse<br>USD I2 | Ausschüttende Klasse<br>USD I2 | Ausschüttende Klasse<br>USD I2 | Thesaurierende Klasse<br>USD I4* | Thesaurierende Klasse<br>USD I4* |
|-------------------|---------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|
|                   | NIW                             | NIW je Anteil                   | NIW                            | NIW je Anteil                  | NIW                              | NIW je Anteil                    |
| 31. Dezember 2024 | 1.489.195 \$                    | 15,42 \$                        | 289.259 \$                     | 8,29 \$                        | 11.405 \$                        | 11,41 \$                         |
| 31. Dezember 2023 | 1.524.302 \$                    | 14,44 \$                        | 288.566 \$                     | 8,22 \$                        | 2.996.390 \$                     | 10,66 \$                         |
| 31. Dezember 2022 | 94.032.462 \$                   | 13,11 \$                        | 1.874.619 \$                   | 7,90 \$                        | –                                | –                                |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Short Duration High Yield Engagement (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD I5 | Thesaurierende Klasse USD I5 | Thesaurierende Klasse USD M | Thesaurierende Klasse USD M | Ausschüttende Klasse USD M | Ausschüttende Klasse USD M |
|-------------------|------------------------------|------------------------------|-----------------------------|-----------------------------|----------------------------|----------------------------|
|                   | NIW                          | NIW je Anteil                | NIW                         | NIW je Anteil               | NIW                        | NIW je Anteil              |
| 31. Dezember 2024 | 23.525.129 \$                | 11,85 \$                     | 2.670.305 \$                | 12,08 \$                    | 926.785 \$                 | 8,08 \$                    |
| 31. Dezember 2023 | 27.842.101 \$                | 11,07 \$                     | 3.127.020 \$                | 11,46 \$                    | 1.580.196 \$               | 8,17 \$                    |
| 31. Dezember 2022 | 25.249.794 \$                | 10,04 \$                     | 8.383.843 \$                | 10,55 \$                    | 3.564.599 \$               | 8,00 \$                    |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD Z | Thesaurierende Klasse USD Z |
|-------------------|-----------------------------|-----------------------------|
|                   | NIW                         | NIW je Anteil               |
| 31. Dezember 2024 | 6.676.859 \$                | 15,00 \$                    |
| 31. Dezember 2023 | 5.677.635 \$                | 13,98 \$                    |
| 31. Dezember 2022 | 9.845.241 \$                | 12,64 \$                    |

## Strategic Income

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)* | Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)* | Ausschüttende Klasse AUD Z (Monatlich) | Ausschüttende Klasse AUD Z (Monatlich) |
|-------------------|--|--|---|---|--|--|
|                   | NIW                                    | NIW je Anteil                          | NIW                                     | NIW je Anteil                           | NIW                                    | NIW je Anteil                          |
| 31. Dezember 2024 | 182.475.158 AUD                        | 7,82 AUD                               | 28.656.298 AUD                          | 9,85 AUD                                | 173.700.829 AUD                        | 8,61 AUD                               |
| 31. Dezember 2023 | 63.940.605 AUD                         | 8,07 AUD                               | –                                       | –                                       | 136.796.522 AUD                        | 8,80 AUD                               |
| 31. Dezember 2022 | 3.816.128 AUD                          | 8,10 AUD                               | –                                       | –                                       | 74.440.920 AUD                         | 8,74 AUD                               |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Strategic Income (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse<br>CNY A (Monatlich)* | Ausschüttende Klasse<br>CNY A (Monatlich)* | Ausschüttende Klasse<br>EUR A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse<br>EUR A (Monatlich) | Thesaurierende Klasse<br>EUR A | Thesaurierende Klasse<br>EUR A |
|-------------------|--|--|---|---|--------------------------------|--------------------------------|
|                   | NIW  | NIW je Anteil                              | NIW                                       | NIW je Anteil                             | NIW                            | NIW je Anteil                  |
| 31. Dezember 2024 | 791.512.657 CNY                            | 95,74 CNY                                  | 61.632.490 €                              | 7,22 €                                    | 1.473.264 €                    | 10,94 €                        |
| 31. Dezember 2023 | 95.409.993 CNY                             | 100,06 CNY                                 | 37.619.121 €                              | 7,50 €                                    | 389.376 €                      | 10,64 €                        |
| 31. Dezember 2022 | –  | –  | 6.586.578 €                               | 7,56 €                                    | 54.250 €                       | 10,05 €                        |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>EUR I | Thesaurierende Klasse<br>EUR I | Thesaurierende Klasse<br>EUR M | Thesaurierende Klasse<br>EUR M | Ausschüttende Klasse<br>GBP A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse<br>GBP A (Monatlich) |
|-------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|---|---|
|                   | NIW                            | NIW je Anteil                  | NIW                            | NIW je Anteil                  | NIW                                       | NIW je Anteil                             |
| 31. Dezember 2024 | 6.630.568 €                    | 11,74 €                        | 1.316.924 €                    | 10,59 €                        | 55.196.795 £                              | 7,83 £                                    |
| 31. Dezember 2023 | 8.449.161 €                    | 11,37 €                        | 1.081.589 €                    | 10,37 €                        | 24.369.502 £                              | 8,01 £                                    |
| 31. Dezember 2022 | 7.002.752 €                    | 10,68 €                        | 1.332.181 €                    | 9,85 €                         | 1.790.460 £                               | 7,95 £                                    |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse<br>GBP I (Monatlich)* | Ausschüttende Klasse<br>GBP I (Monatlich)* | Ausschüttende Klasse<br>HKD A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse<br>HKD A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse<br>JPY A (Monatlich)* | Ausschüttende Klasse<br>JPY A (Monatlich)* |
|-------------------|--|--|---|---|--|--|
|                   | NIW  | NIW je Anteil                              | NIW                                       | NIW je Anteil                             | NIW  | NIW je Anteil                              |
| 31. Dezember 2024 | 8.475.500 £                                | 10,05 £                                    | 2.597.352.308 HKD                         | 8,11 HKD                                  | 17.248.643.465 ¥                           | 956,69 ¥                                   |
| 31. Dezember 2023 | 6.640.582 £                                | 10,23 £                                    | 722.673.278 HKD                           | 8,35 HKD                                  | –  | –  |
| 31. Dezember 2022 | –  | –  | 11.395.657 HKD                            | 8,31 HKD                                  | –  | –  |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Strategic Income (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse<br>JPY A (Monatlich) (nicht<br>währungsgesichert)*<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>JPY A (Monatlich) (nicht<br>währungsgesichert)*<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>JPY E (Monatlich) (nicht<br>währungsgesichert)*<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>JPY E (Monatlich) (nicht<br>währungsgesichert)*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>JPY I<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>JPY I<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|--|--|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | 4.643.542 ¥  | 1.061,28 ¥   | 1.542.217 ¥  | 1.051,00 ¥   | 11.392.177.240 ¥                      | 1.083,24 ¥                                      |
| 31. Dezember 2023 | –  | –  | –  | –  | 11.524.159.611 ¥                      | 1.092,06 ¥                                      |
| 31. Dezember 2022 | –  | –  | –  | –  | 12.532.729.742 ¥                      | 1.065,57 ¥                                      |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>JPY I (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>JPY I (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>JPY I CG<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>JPY I CG<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>JPY I<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>JPY I<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---|---|--------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 5.292.761.537 ¥  | 2.258,86 ¥   | 1.040.104.770 ¥                         | 890,14 ¥  | 4.082.831 ¥                          | 770,37 ¥                                       |
| 31. Dezember 2023 | 4.519.951.299 ¥  | 1.926,94 ¥   | 1.049.838.759 ¥                         | 897,38 ¥  | 4.233.937 ¥                          | 798,89 ¥                                       |
| 31. Dezember 2022 | 3.890.984.078 ¥  | 1.656,82 ¥   | 5.903.832.844 ¥                         | 875,62 ¥  | 7.335.571.257 ¥                      | 803,30 ¥                                       |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>JPY Z<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>JPY Z<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>SGD A (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>SGD A (Monatlich)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>SGD A<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>SGD A<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|--|--|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | 5.601.287.108 ¥                       | 939,96 ¥  | 466.366.802 SGD                                  | 15,30 SGD  | 28.528.098 SGD                        | 22,32 SGD                                       |
| 31. Dezember 2023 | 5.618.707.917 ¥                       | 942,88 ¥  | 57.886.443 SGD                                   | 15,90 SGD  | 13.802.740 SGD                        | 21,73 SGD                                       |
| 31. Dezember 2022 | 10.051.163.176 ¥                      | 915,43 ¥  | 22.557.538 SGD                                   | 15,90 SGD  | 4.409.893 SGD                         | 20,36 SGD                                       |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Strategic Income (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse<br>SGD I (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>SGD I (Monatlich)<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>USD A (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>USD A (Monatlich)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD A<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD A<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|--|--|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | 14.533.010 SGD                                   | 17,19 SGD  | 774.681.307 \$                                   | 8,07 \$  | 785.571.343 \$                        | 12,88 \$  |
| 31. Dezember 2023 | 13.508.509 SGD                                   | 17,77 SGD  | 222.806.283 \$                                   | 8,23 \$  | 483.593.209 \$                        | 12,31 \$  |
| 31. Dezember 2022 | 11.455.558 SGD                                   | 17,69 SGD  | 39.825.935 \$                                    | 8,11 \$  | 302.568.244 \$                        | 11,37 \$  |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse<br>USD A<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>USD A<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD C1<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD C1<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>USD E (Monatlich)*<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>USD E (Monatlich)*<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--------------------------------------|--|--|--|---|---|
| 31. Dezember 2024 | 26.331.462 \$                        | 10,00 \$                                       | 30.022.472 \$                          | 11,10 \$   | 242.703.391 \$                                    | 9,93 \$   |
| 31. Dezember 2023 | 23.776.739 \$                        | 9,88 \$  | 38.055.662 \$                          | 10,71 \$   | –   | –   |
| 31. Dezember 2022 | 15.250.191 \$                        | 9,39 \$  | 43.957.466 \$                          | 9,99 \$  | –   | –   |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>USD I<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD I<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>USD I<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>USD I<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>USD I4 (Monatlich)*<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>USD I4 (Monatlich)*<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|--------------------------------------|--|--|--|
| 31. Dezember 2024 | 513.743.639 \$                        | 14,05 \$  | 157.540.148 \$                       | 10,04 \$                                       | 361.271.257 \$                                     | 10,07 \$   |
| 31. Dezember 2023 | 371.079.167 \$                        | 13,36 \$  | 66.192.394 \$                        | 9,93 \$  | –  | –  |
| 31. Dezember 2022 | 369.131.042 \$                        | 12,27 \$  | 25.395.713 \$                        | 9,43 \$  | –  | –  |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Strategic Income (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse | Thesaurierende Klasse  | Ausschüttende Klasse | Ausschüttende Klasse   | Thesaurierende Klasse | Thesaurierende Klasse  |
|-------------------|-----------------------|------------------------|----------------------|------------------------|-----------------------|------------------------|
|                   | USD M<br>NIW          | USD M<br>NIW je Anteil | USD M<br>NIW         | USD M<br>NIW je Anteil | USD Z<br>NIW          | USD Z<br>NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2024 | 150.718.537 \$        | 12,72 \$               | 13.692.831 \$        | 8,47 \$                | 44.432.892 \$         | 14,32 \$               |
| 31. Dezember 2023 | 111.584.156 \$        | 12,23 \$               | 10.651.057 \$        | 8,54 \$                | 46.701.595 \$         | 13,55 \$               |
| 31. Dezember 2022 | 70.446.108 \$         | 11,36 \$               | 8.239.009 \$         | 8,30 \$                | 42.846.054 \$         | 12,39 \$               |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse      | Ausschüttende Klasse                | Ausschüttende Klasse      | Ausschüttende Klasse                |
|-------------------|---------------------------|-------------------------------------|---------------------------|-------------------------------------|
|                   | ZAR A (Monatlich)*<br>NIW | ZAR A (Monatlich)*<br>NIW je Anteil | ZAR E (Monatlich)*<br>NIW | ZAR E (Monatlich)*<br>NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2024 | 18.238.488 ZAR            | 101,79 ZAR                          | 264.630.216 ZAR           | 99,07 ZAR                           |

## Sustainable Asia High Yield

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse | Thesaurierende Klasse   | Thesaurierende Klasse | Thesaurierende Klasse   | Ausschüttende Klasse     | Ausschüttende Klasse               |
|-------------------|-----------------------|-------------------------|-----------------------|-------------------------|--------------------------|------------------------------------|
|                   | EUR X*<br>NIW         | EUR X*<br>NIW je Anteil | GBP X*<br>NIW         | GBP X*<br>NIW je Anteil | USD A (Monatlich)<br>NIW | USD A (Monatlich)<br>NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2024 | –                     | –                       | –                     | –                       | 12.588 \$                | 7,34 \$                            |
| 31. Dezember 2023 | 363.946 €             | 8,52 €                  | 37.849 £              | 9,47 £                  | 19.024 \$                | 7,07 \$                            |
| 31. Dezember 2022 | 3.659.153 €           | 8,51 €                  | 208.349 £             | 9,31 £                  | 7.630 \$                 | 7,63 \$                            |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Sustainable Asia High Yield (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende         | Thesaurierende                   | Thesaurierende         | Thesaurierende                   | Thesaurierende         | Thesaurierende                   |
|-------------------|------------------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|
|                   | Klasse<br>USD A<br>NIW | Klasse<br>USD A<br>NIW je Anteil | Klasse<br>USD I<br>NIW | Klasse<br>USD I<br>NIW je Anteil | Klasse<br>USD Z<br>NIW | Klasse<br>USD Z<br>NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2024 | 9.515 \$               | 9,52 \$                          | 11.878 \$              | 9,69 \$                          | 24.585.025 \$          | 10,23 \$                         |
| 31. Dezember 2023 | 8.400 \$               | 8,40 \$                          | 10.423 \$              | 8,51 \$                          | 21.484.485 \$          | 8,93 \$                          |
| 31. Dezember 2022 | 8.284 \$               | 8,28 \$                          | 10.219 \$              | 8,34 \$                          | 20.955.845 \$          | 8,70 \$                          |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende          | Ausschüttende                    |
|-------------------|------------------------|----------------------------------|
|                   | Klasse<br>USD Z<br>NIW | Klasse<br>USD Z<br>NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2024 | 7.195.367 \$           | 9,97 \$                          |
| 31. Dezember 2023 | 6.587.073 \$           | 9,13 \$                          |
| 31. Dezember 2022 | 6.793.345 \$           | 9,42 \$                          |

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende          | Thesaurierende                    | Thesaurierende           | Thesaurierende                     | Thesaurierende           | Thesaurierende                     |
|-------------------|-------------------------|-----------------------------------|--------------------------|------------------------------------|--------------------------|------------------------------------|
|                   | Klasse<br>EUR I3<br>NIW | Klasse<br>EUR I3<br>NIW je Anteil | Klasse<br>EUR I4*<br>NIW | Klasse<br>EUR I4*<br>NIW je Anteil | Klasse<br>EUR I5*<br>NIW | Klasse<br>EUR I5*<br>NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2024 | 6.342.918 €             | 12,97 €                           | 336.901.985 €            | 11,76 €                            | –                        | –                                  |
| 31. Dezember 2023 | 9.353.104 €             | 11,95 €                           | 252.654.242 €            | 10,83 €                            | –                        | –                                  |
| 31. Dezember 2022 | 23.246.658 €            | 10,79 €                           | –                        | –                                  | 2.500.773 €              | 10,01 €                            |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR X<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR X<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I5<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I5<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|--|--|---|---|
| 31. Dezember 2024 | 144.984.268 €                            | 10,08 €  | 96.467 \$                                | 10,66 \$   | 92.912.243 \$                             | 10,74 \$  |
| 31. Dezember 2023 | 77.767.491 €                             | 9,27 €   | 9.662 \$                                 | 9,66 \$  | 70.543.444 \$                             | 9,71 \$   |
| 31. Dezember 2022 | 64.417.647 €                             | 8,36 €   | 8.540 \$                                 | 8,54 \$  | 62.156.033 \$                             | 8,55 \$   |

Tactical Macro<sup>1</sup>

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I5*<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I5*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I*<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I5*<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I5*<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---|---|--|--|
| 31. Dezember 2024 | 3.068.017 €                                | 10,31 €  | 10.664 \$                                 | 10,66 \$  | 938.814 \$                                 | 10,73 \$   |
| 31. Dezember 2023 | –  | –  | 10.217 \$                                 | 10,22 \$  | 336.955 \$                                 | 10,24 \$   |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z*<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z*<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---|---|
| 31. Dezember 2024 | 31.877.111 \$                             | 10,79 \$  |
| 31. Dezember 2023 | 26.721.857 \$                             | 10,26 \$  |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Uncorrelated Strategies

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse CHF I<br>NIW | Thesaurierende Klasse CHF I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse CHF I5*<br>NIW | Thesaurierende Klasse CHF I5*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR A<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR A<br>NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|--------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 608.719 CHF                        | 9,30 CHF                                     | –                                    | –  | 2.025.335 €                        | 9,31 €                                       |
| 31. Dezember 2023 | 1.933.894 CHF                      | 9,07 CHF                                     | –                                    | –  | 6.159.807 €                        | 8,94 €                                       |
| 31. Dezember 2022 | 3.430.851 CHF                      | 10,34 CHF                                    | 1.500.147 CHF                        | 10,74 CHF                                      | 32.208.149 €                       | 10,07 €                                      |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR I<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I2<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I2<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I5*<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I5*<br>NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|-------------------------------------|---|--------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 5.474.378 €                        | 9,87 €                                       | 3.837.681 €                         | 10,22 €                                       | –                                    | –  |
| 31. Dezember 2023 | 9.422.087 €                        | 9,40 €                                       | 7.184.374 €                         | 9,72 €  | –                                    | –  |
| 31. Dezember 2022 | 157.192.927 €                      | 10,51 €                                      | 15.201.022 €                        | 10,85 €                                       | 6.769.918 €                          | 11,01 €  |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR M<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR M<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR P<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR P<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP I<br>NIW | Thesaurierende Klasse GBP I<br>NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 368.044 €                          | 8,95 €                                       | 27.167 €                           | 9,27 €                                       | 5.176.667 £                        | 11,15 £                                      |
| 31. Dezember 2023 | 658.504 €                          | 8,66 €                                       | 202.696 €                          | 8,83 €                                       | 13.299.187 £                       | 10,47 £                                      |
| 31. Dezember 2022 | 1.654.675 €                        | 9,83 €                                       | 28.465.642 €                       | 9,85 €                                       | 77.383.312 £                       | 11,52 £                                      |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>GBP I2<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP I2<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>GBP I2<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>GBP I2<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>GBP I5<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP I5<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---------------------------------------|---|--|--|
| 31. Dezember 2024 | 324.694.310 £                          | 11,22 £  | 8.310 £                               | 9,68 £  | 433.007 £                              | 11,46 £  |
| 31. Dezember 2023 | 583.156.807 £                          | 10,52 £  | 262.553 £                             | 9,07 £  | 33.902.989 £                           | 10,72 £  |
| 31. Dezember 2022 | 876.636.906 £                          | 11,56 £  | 76.067 £                              | 9,96 £  | 244.341.482 £                          | 11,74 £  |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>GBP P<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP P<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>GBP Z<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP Z<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>JPY I<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>JPY I<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | 107.861.075 £                         | 10,81 £   | 378.224 £                             | 11,82 £   | 3.756.686.119 ¥                       | 896,49 ¥  |
| 31. Dezember 2023 | 349.194.682 £                         | 10,15 £   | 459.179 £                             | 11,01 £   | 3.729.880.338 ¥                       | 887,86 ¥  |
| 31. Dezember 2022 | 733.833.769 £                         | 11,16 £   | 501.313 £                             | 12,02 £   | 4.336.598.065 ¥                       | 1.029,89 ¥                                      |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>SGD A<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>SGD A<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD A<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD A<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD C1<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD C1<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|--|--|
| 31. Dezember 2024 | 27.869 SGD                            | 20,44 SGD                                       | 19.263.167 \$                         | 10,57 \$  | 1.355.411 \$                           | 9,92 \$  |
| 31. Dezember 2023 | 8.864 SGD                             | 19,35 SGD                                       | 36.187.195 \$                         | 9,98 \$   | 3.919.547 \$                           | 9,46 \$  |
| 31. Dezember 2022 | 201.328 SGD                           | 20,11 SGD                                       | 76.331.807 \$                         | 11,03 \$  | 7.019.785 \$                           | 10,57 \$   |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD I<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I2<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I2<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I5<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I5<br>NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | 158.391.642 \$                     | 11,64 \$                                     | 22.858.079 \$                       | 11,72 \$                                      | 14.917.271 \$                       | 11,97 \$                                      |
| 31. Dezember 2023 | 190.714.139 \$                     | 10,91 \$                                     | 46.326.710 \$                       | 10,97 \$                                      | 10.932.246 \$                       | 11,18 \$                                      |
| 31. Dezember 2022 | 253.706.005 \$                     | 11,97 \$                                     | 59.598.401 \$                       | 12,01 \$                                      | 23.473.722 \$                       | 12,22 \$                                      |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD M<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD M<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD P<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD P<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD Z<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD Z<br>NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 3.181.540 \$                       | 10,26 \$                                     | 55.481 \$                          | 11,34 \$                                     | 249.035 \$                         | 12,16 \$                                     |
| 31. Dezember 2023 | 5.177.039 \$                       | 9,77 \$                                      | 6.768.803 \$                       | 10,62 \$                                     | 10.835.712 \$                      | 11,31 \$                                     |
| 31. Dezember 2022 | 14.132.913 \$                      | 10,89 \$                                     | 54.279.664 \$                      | 11,66 \$                                     | 27.792.127 \$                      | 12,32 \$                                     |

Uncorrelated Trading\*\*

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR X*<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR X*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD X*<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD X*<br>NIW je Anteil |
|-------------------|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | –                                   | –   | –                                   | –   |
| 31. Dezember 2023 | –                                   | –   | –                                   | –   |
| 31. Dezember 2022 | 649.030.110 €                       | 9,83 €  | 18.184.485 \$                       | 10,00 \$                                      |

\*\* Das Portfolio wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## US Equity

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)*<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I5*<br>NIW                          | Thesaurierende Klasse EUR I5*<br>NIW je Anteil                          | Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)*<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)*<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---|---|---|---|--|--|
| 31. Dezember 2024 | 10.270 €  | 11,20 €   | 9.893.073 €   | 10,73 €   | 10.456 €   | 11,21 €  |
| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)*<br>NIW | Ausschüttende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR X (nicht währungsgesichert)*<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR X (nicht währungsgesichert)*<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)*<br>NIW  | Ausschüttende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)*<br>NIW je Anteil  |
| 31. Dezember 2024 | 10.456 €  | 11,21 €   | 257.954 €   | 12,18 €   | 8.640 £  | 10,96 £  |
| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse GBP X (nicht währungsgesichert)*<br>NIW | Thesaurierende Klasse GBP X (nicht währungsgesichert)*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse JPY I3<br>NIW                           | Thesaurierende Klasse JPY I3<br>NIW je Anteil                           | Thesaurierende Klasse USD A<br>NIW                             | Thesaurierende Klasse USD A<br>NIW je Anteil                             |
| 31. Dezember 2024 | 1.794.722 £   | 11,80 £   | 394.054.551 ¥   | 1.234,06 ¥  | 25.100.236 \$  | 22,94 \$   |
| 31. Dezember 2023 | –   | –   | 4.044.133.157 ¥   | 1.058,06 ¥  | 4.099.498 \$   | 18,69 \$   |
| 31. Dezember 2022 | –   | –   | 2.722.761.830 ¥   | 816,04 ¥  | 3.127.165 \$   | 13,76 \$   |
| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD I<br>NIW                            | Thesaurierende Klasse USD I<br>NIW je Anteil                            | Ausschüttende Klasse USD I<br>NIW                             | Ausschüttende Klasse USD I<br>NIW je Anteil                             | Thesaurierende Klasse USD I5*<br>NIW                           | Thesaurierende Klasse USD I5*<br>NIW je Anteil                           |
| 31. Dezember 2024 | 12.058.927 \$   | 34,43 \$  | 7.826.978 \$  | 34,16 \$  | 35.902.884 \$  | 11,49 \$   |
| 31. Dezember 2023 | 4.648.286 \$  | 27,83 \$  | 6.328.003 \$  | 27,62 \$  | –  | –  |
| 31. Dezember 2022 | 3.063.327 \$  | 20,34 \$  | 4.623.317 \$  | 20,18 \$  | –  | –  |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Equity (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse<br>USD I5* | Ausschüttende Klasse<br>USD I5* | Thesaurierende Klasse<br>USD M | Thesaurierende Klasse<br>USD M | Thesaurierende Klasse<br>USD X* | Thesaurierende Klasse<br>USD X* |
|-------------------|---------------------------------|---------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|
|                   | NIW                             | NIW je Anteil                   | NIW                            | NIW je Anteil                  | NIW                             | NIW je Anteil                   |
| 31. Dezember 2024 | 32.487 \$                       | 10,83 \$                        | 7.016.539 \$                   | 12,70 \$                       | 11.605 \$                       | 11,61 \$                        |
| 31. Dezember 2023 | –                               | –                               | 5.680.856 \$                   | 10,43 \$                       | –                               | –                               |
| 31. Dezember 2022 | –                               | –                               | 7.737 \$                       | 7,74 \$                        | –                               | –                               |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>USD Z* | Thesaurierende Klasse<br>USD Z* |
|-------------------|---------------------------------|---------------------------------|
|                   | NIW                             | NIW je Anteil                   |
| 31. Dezember 2024 | 3.689.807 \$                    | 10,40 \$                        |

US Equity Premium

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>EUR I | Thesaurierende Klasse<br>EUR I | Ausschüttende Klasse<br>EUR I3 | Ausschüttende Klasse<br>EUR I3 | Thesaurierende Klasse<br>EUR I4 | Thesaurierende Klasse<br>EUR I4 |
|-------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|
|                   | NIW                            | NIW je Anteil                  | NIW                            | NIW je Anteil                  | NIW                             | NIW je Anteil                   |
| 31. Dezember 2024 | 4.112.530 €                    | 14,68 €                        | 3.446.474 €                    | 10,78 €                        | 607.949 €                       | 14,71 €                         |
| 31. Dezember 2023 | 4.043.345 €                    | 13,19 €                        | 5.017.909 €                    | 9,95 €                         | 583.657 €                       | 13,18 €                         |
| 31. Dezember 2022 | 519.574 €                      | 11,69 €                        | 4.848.784 €                    | 8,83 €                         | 769.301 €                       | 11,65 €                         |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## US Equity Premium (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse<br>EUR I4*<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>EUR I4*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>EUR M<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>EUR M<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>GBP I (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP I (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---------------------------------------|---|--|--|
| 31. Dezember 2024 | 30.052 €                               | 10,93 €  | 214.785 €                             | 13,14 €   | 2.014.995 £  | 17,04 £  |
| 31. Dezember 2023 | 27.686 €                               | 10,07 €  | 307.642 €                             | 11,98 €   | 15.677.985 £   | 14,79 £  |
| 31. Dezember 2022 | –                                      | –  | 295.878 €                             | 10,76 €   | 32.974.906 £   | 13,58 £  |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>GBP I3<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP I3<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>GBP I3<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>GBP I3<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>GBP I3 (nicht<br>währungsgesichert)*<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>GBP I3 (nicht<br>währungsgesichert)*<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---------------------------------------|---|---|---|
| 31. Dezember 2024 | 96.233.157 £                           | 14,58 £  | 126.692.497 £                         | 11,82 £   | 9.224 £   | 11,75 £   |
| 31. Dezember 2023 | 112.770.545 £                          | 12,63 £  | 243.278.811 £                         | 10,76 £   | 8.228 £   | 10,48 £   |
| 31. Dezember 2022 | 72.609.172 £                           | 11,58 £  | 199.939.675 £                         | 9,40 £  | –   | –   |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>GBP I4 (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP I4 (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>GBP I4*<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>GBP I4*<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>GBP P (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>GBP P (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---|---|--|--|---|---|
| 31. Dezember 2024 | 891.364 £   | 17,71 £   | 86.434 £                               | 11,26 £  | 2.826.590 £   | 11,65 £   |
| 31. Dezember 2023 | 56.296.882 £  | 15,33 £   | 443.810 £                              | 10,24 £  | 3.959.945 £   | 10,53 £   |
| 31. Dezember 2022 | 131.866.462 £   | 14,05 £   | –                                      | –  | 4.612.426 £   | 10,06 £   |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Equity Premium (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>GBP X (nicht währungs-<br>gesichert)*<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP X (nicht währungs-<br>gesichert)*<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>SGD A (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>SGD A (Monatlich)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD A<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD A<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---|---|--|--|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | 105.210.591 £   | 11,22 £   | 7.639.301 SGD                                    | 20,99 SGD  | 21.821.281 \$                         | 16,86 \$  |
| 31. Dezember 2023 | –   | –   | 191.141 SGD                                      | 20,38 SGD  | 13.352.314 \$                         | 14,98 \$  |
| 31. Dezember 2022 | –   | –   | 182.949 SGD                                      | 18,85 SGD  | 12.416.490 \$                         | 13,06 \$  |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse<br>USD I (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>USD I (Monatlich)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD I<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD I<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>USD I3<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>USD I3<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | 53.313 \$  | 12,28 \$   | 124.124.603 \$                        | 17,90 \$  | 16.309.772 \$                         | 11,53 \$  |
| 31. Dezember 2023 | 10.367 \$  | 11,64 \$   | 69.249.366 \$                         | 15,82 \$  | 24.031.846 \$                         | 10,47 \$  |
| 31. Dezember 2022 | 11.585.856 \$                                    | 10,55 \$   | 55.168.614 \$                         | 13,71 \$  | 18.562.430 \$                         | 9,09 \$   |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>USD I4<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD I4<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD M<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD M<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD Z<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD Z<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | 6.907.514 \$                           | 17,44 \$   | 3.784.110 \$                          | 15,64 \$  | 53.471.247 \$                         | 18,33 \$  |
| 31. Dezember 2023 | 5.805.985 \$                           | 15,37 \$   | 1.228.399 \$                          | 14,02 \$  | 52.893.166 \$                         | 16,10 \$  |
| 31. Dezember 2022 | 5.127.891 \$                           | 13,29 \$   | 1.208.956 \$                          | 12,32 \$  | 37.615.063 \$                         | 13,87 \$  |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## US Large Cap Value

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR A NIW | Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I NIW | Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------|---|---|---|---------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | 618.002 €                       | 11,04 €                                   | 229.860 €   | 11,64 €   | 14.706.589 €                    | 9,49 €                                    |
| 31. Dezember 2023 | 584.267 €                       | 10,25 €                                   | 234.125 €   | 9,96 €  | 25.517.697 €                    | 8,75 €                                    |
| 31. Dezember 2022 | 151.717 €                       | 10,87 €                                   | 421.987 €   | 10,68 €   | 13.504.321 €                    | 9,20 €                                    |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert) NIW | Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil |
|-------------------|---|---|---|---|--|--|
| 31. Dezember 2024 | 240.674.903 €   | 10,44 €   | 266.426 €   | 10,75 €   | 109.175.546 €  | 11,62 €  |
| 31. Dezember 2023 | 146.699.614 €   | 8,86 €  | 11.657.942 €  | 9,26 €  | 104.079.203 €  | 9,84 €   |
| 31. Dezember 2022 | 37.390.049 €  | 9,42 €  | 14.242.602 €  | 9,91 €  | 117.300.158 €  | 10,42 €  |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse GBP I NIW | Thesaurierende Klasse GBP I NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) NIW | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse GBP I NIW | Ausschüttende Klasse GBP I NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------|---|---|---|--------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 26.196 £                        | 10,36 £                                   | 202.877 £   | 9,97 £  | 334.523 £                      | 10,22 £                                  |
| 31. Dezember 2023 | 23.832 £                        | 9,43 £                                    | 462.887 £   | 8,88 £  | 299.756 £                      | 9,42 £                                   |
| 31. Dezember 2022 | 24.659 £                        | 9,76 £                                    | 8.138 £   | 9,66 £  | 24.659 £                       | 9,76 £                                   |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Large Cap Value (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse<br>GBP I (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>GBP I (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>GBP I4 (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>GBP I4 (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>GBP P (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP P (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---|---|--|--|--|--|
| 31. Dezember 2024 | 626.217 £   | 9,82 £  | 44.659.988 £   | 11,04 £  | 3.256.456 £  | 10,61 £  |
| 31. Dezember 2023 | 5.459.927 £   | 8,86 £  | 713.712.896 £  | 9,96 £   | 1.510.453 £  | 9,44 £   |
| 31. Dezember 2022 | 8.138 £   | 9,66 £  | 767.350.829 £  | 10,92 £  | 1.047.402 £  | 10,28 £  |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse<br>GBP P<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>GBP P<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>GBP Y (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP Y (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>GBP Y (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>GBP Y (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--------------------------------------|--|--|--|---|---|
| 31. Dezember 2024 | 62.541 £                             | 11,11 £  | 128.152.272 £  | 10,83 £  | 571.735 £   | 10,45 £   |
| 31. Dezember 2023 | 27.450 £                             | 10,25 £  | 96.933.670 £   | 9,63 £   | 289.665 £   | 9,43 £  |
| 31. Dezember 2022 | 28.455 £                             | 10,63 £  | 79.855.605 £   | 10,48 £  | 57.641 £  | 10,29 £   |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>USD A<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD A<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD I<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD I<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>USD I4<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>USD I4<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | 54.425.878 \$                         | 10,05 \$  | 223.515.751 \$                        | 11,05 \$  | 2.915.233 \$                          | 10,13 \$  |
| 31. Dezember 2023 | 64.226.695 \$                         | 9,18 \$   | 348.767.232 \$                        | 10,01 \$  | 42.162.635 \$                         | 9,31 \$   |
| 31. Dezember 2022 | 64.127.333 \$                         | 9,50 \$   | 370.024.843 \$                        | 10,28 \$  | 55.448.399 \$                         | 9,63 \$   |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## US Large Cap Value (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende          | Thesaurierende                    | Thesaurierende         | Thesaurierende                   | Thesaurierende          | Thesaurierende                    |
|-------------------|-------------------------|-----------------------------------|------------------------|----------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|                   | Klasse<br>USD I5<br>NIW | Klasse<br>USD I5<br>NIW je Anteil | Klasse<br>USD M<br>NIW | Klasse<br>USD M<br>NIW je Anteil | Klasse<br>USD Y*<br>NIW | Klasse<br>USD Y*<br>NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2024 | 31.135 \$               | 10,45 \$                          | 17.738.836 \$          | 9,73 \$                          | 117.971.038 \$          | 10,93 \$                          |
| 31. Dezember 2023 | 42.443 \$               | 9,43 \$                           | 21.629.855 \$          | 8,95 \$                          | 99.162.277 \$           | 9,89 \$                           |
| 31. Dezember 2022 | 51.156 \$               | 9,65 \$                           | 47.864.951 \$          | 9,35 \$                          | –                       | –                                 |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende         | Thesaurierende                   |
|-------------------|------------------------|----------------------------------|
|                   | Klasse<br>USD Z<br>NIW | Klasse<br>USD Z<br>NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2024 | 223.348 \$             | 11,01 \$                         |
| 31. Dezember 2023 | 200.943 \$             | 9,90 \$                          |
| 31. Dezember 2022 | 13.571.781 \$          | 10,10 \$                         |

## US Long Short Equity

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende         | Thesaurierende                   | Thesaurierende         | Thesaurierende                   | Thesaurierende          | Thesaurierende                    |
|-------------------|------------------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|
|                   | Klasse<br>EUR A<br>NIW | Klasse<br>EUR A<br>NIW je Anteil | Klasse<br>EUR I<br>NIW | Klasse<br>EUR I<br>NIW je Anteil | Klasse<br>EUR I3<br>NIW | Klasse<br>EUR I3<br>NIW je Anteil |
| 31. Dezember 2024 | 273.134 €              | 11,87 €                          | 28.343.093 €           | 13,05 €                          | 46.890.868 €            | 12,36 €                           |
| 31. Dezember 2023 | 260.420 €              | 11,44 €                          | 32.376.271 €           | 12,46 €                          | 35.415.422 €            | 11,75 €                           |
| 31. Dezember 2022 | 607.101 €              | 10,40 €                          | 36.739.571 €           | 11,22 €                          | 36.252.558 €            | 10,54 €                           |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Long Short Equity (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert)*<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert)*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR M<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR M<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse GBP I3<br>NIW | Ausschüttende Klasse GBP I3<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 10.061 €   | 10,78 €  | 2.300.869 €                        | 11,47 €                                      | 4.879.535 £                        | 11,91 £                                      |
| 31. Dezember 2023 | –  | –  | 2.749.134 €                        | 11,14 €                                      | 1.560.470 £                        | 11,34 £                                      |
| 31. Dezember 2022 | –  | –  | 3.231.098 €                        | 10,21 €                                      | 553.045 £                          | 10,08 £                                      |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse SGD A1<br>NIW | Thesaurierende Klasse SGD A1<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD A (PF)<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD A (PF)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD A<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD A<br>NIW je Anteil |
|-------------------|-------------------------------------|---|---|---|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 132.664 SGD                         | 27,97 SGD                                     | 1.372.793 \$                            | 13,84 \$  | 15.417.189 \$                      | 14,07 \$                                     |
| 31. Dezember 2023 | 175.595 SGD                         | 26,86 SGD                                     | 1.596.521 \$                            | 13,16 \$  | 15.728.474 \$                      | 13,33 \$                                     |
| 31. Dezember 2022 | 306.753 SGD                         | 24,13 SGD                                     | 2.738.736 \$                            | 11,72 \$  | 15.008.727 \$                      | 11,86 \$                                     |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD A1<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD A1<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD I (PF)<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD I (PF)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I<br>NIW je Anteil |
|-------------------|-------------------------------------|---|--|--|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 10.424.782 \$                       | 15,10 \$                                      | 30.671.866 \$                          | 14,58 \$   | 53.668.060 \$                      | 16,28 \$                                     |
| 31. Dezember 2023 | 13.821.003 \$                       | 14,24 \$                                      | 35.630.199 \$                          | 13,83 \$   | 31.634.246 \$                      | 15,29 \$                                     |
| 31. Dezember 2022 | 13.820.694 \$                       | 12,63 \$                                      | 32.577.472 \$                          | 12,33 \$   | 49.565.162 \$                      | 13,49 \$                                     |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## US Long Short Equity (Fortsetzung)

|                   | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I3<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I3<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD U<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD U<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---|---|--|--|--|--|
| Geschäftsjahr zum |   |   |  |  |  |  |
| 31. Dezember 2024 | 19.466.452 \$                             | 13,38 \$  | 968.350 \$                               | 12,81 \$   | 735.117 \$                               | 14,83 \$   |
| 31. Dezember 2023 | 11.481.908 \$                             | 12,51 \$  | 951.613 \$                               | 12,24 \$   | 1.239.097 \$                             | 13,99 \$   |
| 31. Dezember 2022 | 13.048.932 \$                             | 10,99 \$  | 1.229.714 \$                             | 10,98 \$   | 6.626.973 \$                             | 12,39 \$   |

|                   | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|
| Geschäftsjahr zum |  |  |
| 31. Dezember 2024 | 6.016.811 \$                             | 18,49 \$   |
| 31. Dezember 2023 | 3.442.847 \$                             | 17,13 \$   |
| 31. Dezember 2022 | 3.984.842 \$                             | 14,90 \$   |

## US Multi Cap Opportunities

|                   | Thesaurierende<br>Klasse<br>AUD E<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>AUD E<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>AUD T<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>AUD T<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I (nicht<br>währungsgesichert)*<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I (nicht<br>währungsgesichert)*<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|--|--|--|--|
| Geschäftsjahr zum |  |  |  |  |  |  |
| 31. Dezember 2024 | 707.869 AUD                              | 21,38 AUD  | 1.776.200 AUD                            | 20,48 AUD  | 7.011.374 €  | 9,70 €   |
| 31. Dezember 2023 | 1.190.855 AUD                            | 18,33 AUD  | 2.064.476 AUD                            | 17,38 AUD  | –  | –  |
| 31. Dezember 2022 | 1.517.141 AUD                            | 16,18 AUD  | 1.676.142 AUD                            | 15,19 AUD  | –  | –  |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR I3<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I3<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR M<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR M<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR1 A<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR1 A<br>NIW je Anteil |
|-------------------|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|-------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | 2.610.266 €                         | 31,02 €                                       | 441.246 €                          | 20,96 €                                      | 1.453.031 €                         | 33,72 €                                       |
| 31. Dezember 2023 | 2.192.792 €                         | 26,06 €                                       | 485.467 €                          | 18,00 €                                      | 2.025.069 €                         | 28,67 €                                       |
| 31. Dezember 2022 | 1.895.752 €                         | 22,53 €                                       | 493.074 €                          | 15,91 €                                      | 1.953.365 €                         | 25,08 €                                       |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR1 I<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR1 I<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse GBP I3*<br>NIW | Ausschüttende Klasse GBP I3*<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert)<br>NIW | Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert)<br>NIW je Anteil |
|-------------------|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|--|--|
| 31. Dezember 2024 | 2.058.840 €                         | 37,40 €                                       | 25.658 £                            | 10,84 £                                       | 23.942 £   | 22,47 £  |
| 31. Dezember 2023 | 3.590.284 €                         | 31,53 €                                       | –                                   | –   | 19.454 £   | 18,26 £  |
| 31. Dezember 2022 | 3.440.135 €                         | 27,36 €                                       | –                                   | –   | 17.444 £   | 16,38 £  |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)*<br>NIW | Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse SGD A<br>NIW | Thesaurierende Klasse SGD A<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD B<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD B<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---|---|------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 13.098 £  | 10,68 £   | 53.872.459 SGD                     | 57,24 SGD                                    | 7.612.859 \$                       | 24,40 \$                                     |
| 31. Dezember 2023 | –   | –   | 30.545.781 SGD                     | 48,71 SGD                                    | 11.529.828 \$                      | 20,61 \$                                     |
| 31. Dezember 2022 | –   | –   | 24.554.266 SGD                     | 42,26 SGD                                    | 14.429.013 \$                      | 17,80 \$                                     |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

|                          | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD C1<br>NIW  | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD C1<br>NIW je Anteil  | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD C2*<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD C2*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD E<br>NIW  | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD E<br>NIW je Anteil  |
|--------------------------|--|--|--|--|---|---|
| <b>Geschäftsjahr zum</b> |  |  |  |  |   |   |
| 31. Dezember 2024        | 1.827.500 \$                               | 18,71 \$   | –  | –  | 5.185.629 \$                              | 22,96 \$  |
| 31. Dezember 2023        | 1.857.404 \$                               | 15,79 \$   | 11.020 \$                                  | 20,62 \$   | 12.497.526 \$                             | 19,40 \$  |
| 31. Dezember 2022        | 1.855.172 \$                               | 13,62 \$   | 775.262 \$                                 | 17,80 \$   | 12.157.572 \$                             | 16,75 \$  |
|                          | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I2*<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I2*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I3<br>NIW  | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I3<br>NIW je Anteil  | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I3*<br>NIW | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I3*<br>NIW je Anteil |
| <b>Geschäftsjahr zum</b> |  |  |  |  |   |   |
| 31. Dezember 2024        | 13.541 \$                                  | 13,54 \$   | 26.577.897 \$                              | 37,50 \$   | –   | –   |
| 31. Dezember 2023        | 11.201 \$                                  | 11,20 \$   | 20.516.313 \$                              | 30,97 \$   | 5.968.476 \$                              | 27,71 \$  |
| 31. Dezember 2022        | –  | –  | 23.096.196 \$                              | 26,14 \$   | 5.049.971 \$                              | 23,44 \$  |
|                          | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M<br>NIW   | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M<br>NIW je Anteil   | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD T<br>NIW   | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD T<br>NIW je Anteil   | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD U<br>NIW  | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD U<br>NIW je Anteil  |
| <b>Geschäftsjahr zum</b> |  |  |  |  |   |   |
| 31. Dezember 2024        | 9.053.426 \$                               | 26,03 \$   | 19.973.435 \$                              | 27,27 \$   | 55.991.599 \$                             | 37,92 \$  |
| 31. Dezember 2023        | 7.990.996 \$                               | 21,97 \$   | 20.597.988 \$                              | 22,81 \$   | 51.624.971 \$                             | 31,54 \$  |
| 31. Dezember 2022        | 8.827.718 \$                               | 18,95 \$   | 18.665.561 \$                              | 19,51 \$   | 55.179.479 \$                             | 26,82 \$  |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD1 A<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD1 A<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD1 I<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD1 I<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|---|---|---|---|
| 31. Dezember 2024 | 367.048 \$                               | 31,97 \$   | 72.289.087 \$                             | 40,96 \$  | 115.606.375 \$                            | 46,62 \$  |
| 31. Dezember 2023 | 315.494 \$                               | 26,27 \$   | 61.309.908 \$                             | 34,23 \$  | 157.972.113 \$                            | 38,63 \$  |
| 31. Dezember 2022 | 285.453 \$                               | 22,06 \$   | 68.130.989 \$                             | 29,24 \$  | 188.629.207 \$                            | 32,71 \$  |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD1 I<br>NIW | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD1 I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>ZAR B<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>ZAR B<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>ZAR C2*<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>ZAR C2*<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|--|--|--|--|
| 31. Dezember 2024 | 7.439.917 \$                             | 44,98 \$   | 22.609.761 ZAR                           | 372,97 ZAR   | –  | –  |
| 31. Dezember 2023 | 6.535.567 \$                             | 37,27 \$   | 33.968.071 ZAR                           | 306,92 ZAR   | 52.951 ZAR                                 | 305,28 ZAR   |
| 31. Dezember 2022 | 5.497.999 \$                             | 31,57 \$   | 44.251.345 ZAR                           | 258,68 ZAR   | 714.961 ZAR                                | 257,19 ZAR   |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende<br>Klasse<br>ZAR E<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>ZAR E<br>NIW je Anteil | Thesaurierende<br>Klasse<br>ZAR T<br>NIW | Thesaurierende<br>Klasse<br>ZAR T<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|--|--|
| 31. Dezember 2024 | 77.741.240 ZAR                           | 343,48 ZAR   | 58.500.801 ZAR                           | 416,53 ZAR   |
| 31. Dezember 2023 | 40.553.464 ZAR                           | 282,64 ZAR   | 62.068.144 ZAR                           | 339,34 ZAR   |
| 31. Dezember 2022 | 58.876.819 ZAR                           | 238,22 ZAR   | 62.283.522 ZAR                           | 283,17 ZAR   |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## US Real Estate Securities

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse<br>AUD A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse<br>AUD A (Monatlich) | Ausschüttende Klasse<br>AUD B (Monatlich) | Ausschüttende Klasse<br>AUD B (Monatlich) | Thesaurierende Klasse<br>AUD B | Thesaurierende Klasse<br>AUD B |
|-------------------|---|---|---|---|--------------------------------|--------------------------------|
|                   | NIW                                       | NIW je Anteil                             | NIW                                       | NIW je Anteil                             | NIW                            | NIW je Anteil                  |
| 31. Dezember 2024 | 2.702.627 AUD                             | 8,17 AUD                                  | 2.069.804 AUD                             | 7,37 AUD                                  | 1.057.562 AUD                  | 11,91 AUD                      |
| 31. Dezember 2023 | 3.363.584 AUD                             | 8,36 AUD                                  | 2.517.096 AUD                             | 7,64 AUD                                  | 1.491.037 AUD                  | 11,86 AUD                      |
| 31. Dezember 2022 | 5.496.298 AUD                             | 8,13 AUD                                  | 3.710.929 AUD                             | 7,53 AUD                                  | 1.551.669 AUD                  | 11,22 AUD                      |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse<br>AUD C2 (Monatlich)* | Ausschüttende Klasse<br>AUD C2 (Monatlich)* | Ausschüttende Klasse<br>AUD E (Monatlich) | Ausschüttende Klasse<br>AUD E (Monatlich) | Thesaurierende Klasse<br>AUD E | Thesaurierende Klasse<br>AUD E |
|-------------------|---|---|---|---|--------------------------------|--------------------------------|
|                   | NIW   | NIW je Anteil                               | NIW                                       | NIW je Anteil                             | NIW                            | NIW je Anteil                  |
| 31. Dezember 2024 | –   | –   | 877.059 AUD                               | 7,36 AUD                                  | 946.181 AUD                    | 12,89 AUD                      |
| 31. Dezember 2023 | –   | –   | 1.664.244 AUD                             | 7,63 AUD                                  | 684.626 AUD                    | 12,83 AUD                      |
| 31. Dezember 2022 | 13.633 AUD                                  | 7,54 AUD                                    | 1.845.753 AUD                             | 7,52 AUD                                  | 1.473.276 AUD                  | 12,14 AUD                      |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse<br>AUD T (Monatlich) | Ausschüttende Klasse<br>AUD T (Monatlich) | Thesaurierende Klasse<br>AUD T | Thesaurierende Klasse<br>AUD T | Thesaurierende Klasse<br>CHF A | Thesaurierende Klasse<br>CHF A |
|-------------------|---|---|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
|                   | NIW                                       | NIW je Anteil                             | NIW                            | NIW je Anteil                  | NIW                            | NIW je Anteil                  |
| 31. Dezember 2024 | 4.271.855 AUD                             | 8,73 AUD                                  | 3.694.492 AUD                  | 15,56 AUD                      | 1.140.273 CHF                  | 13,81 CHF                      |
| 31. Dezember 2023 | 4.085.229 AUD                             | 8,96 AUD                                  | 4.675.218 AUD                  | 15,33 AUD                      | 1.432.392 CHF                  | 13,99 CHF                      |
| 31. Dezember 2022 | 4.048.009 AUD                             | 8,74 AUD                                  | 5.292.429 AUD                  | 14,37 AUD                      | 1.863.576 CHF                  | 13,32 CHF                      |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR A<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR A<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR I<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse EUR M<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR M<br>NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 1.153.551 €                        | 8,65 €                                       | 2.540.239 €                        | 19,39 €                                      | 533.759 €                          | 11,44 €                                      |
| 31. Dezember 2023 | 942.080 €                          | 8,54 €                                       | 9.589.385 €                        | 19,01 €                                      | 553.935 €                          | 11,42 €                                      |
| 31. Dezember 2022 | 1.065.458 €                        | 7,98 €                                       | 9.711.898 €                        | 17,63 €                                      | 525.424 €                          | 10,78 €                                      |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse SGD A<br>NIW | Thesaurierende Klasse SGD A<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---|---|------------------------------------|--|---|---|
| 31. Dezember 2024 | 36.988.091 HKD                                | 9,04 HKD  | 1.140.205 SGD                      | 30,58 SGD                                    | 18.812.772 \$                                 | 10,61 \$  |
| 31. Dezember 2023 | 41.922.187 HKD                                | 9,20 HKD  | 841.397 SGD                        | 30,21 SGD                                    | 26.897.176 \$                                 | 10,69 \$  |
| 31. Dezember 2022 | 63.131.693 HKD                                | 8,82 HKD  | 798.510 SGD                        | 27,99 SGD                                    | 34.765.827 \$                                 | 10,15 \$  |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD A<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD A<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD A<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD A<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich)<br>NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|-----------------------------------|---|---|---|
| 31. Dezember 2024 | 125.593.738 \$                     | 24,84 \$                                     | 12.722.091 \$                     | 17,53 \$                                    | 14.059.441 \$                                 | 8,61 \$   |
| 31. Dezember 2023 | 184.962.493 \$                     | 24,05 \$                                     | 13.581.267 \$                     | 17,15 \$                                    | 18.281.128 \$                                 | 8,79 \$   |
| 31. Dezember 2022 | 219.433.044 \$                     | 21,92 \$                                     | 14.624.460 \$                     | 15,81 \$                                    | 21.360.783 \$                                 | 8,45 \$   |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## US Real Estate Securities (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD B | Thesaurierende Klasse USD B | Thesaurierende Klasse USD C1 | Thesaurierende Klasse USD C1 | Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich)* | Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich)* |
|-------------------|-----------------------------|-----------------------------|------------------------------|------------------------------|--|--|
|                   | NIW                         | NIW je Anteil               | NIW                          | NIW je Anteil                | NIW                                      | NIW je Anteil                            |
| 31. Dezember 2024 | 9.874.911 \$                | 14,88 \$                    | 8.289.019 \$                 | 12,49 \$                     | –  | –  |
| 31. Dezember 2023 | 10.818.583 \$               | 14,60 \$                    | 11.437.427 \$                | 12,22 \$                     | –  | –  |
| 31. Dezember 2022 | 17.275.041 \$               | 13,48 \$                    | 13.832.889 \$                | 11,25 \$                     | 285.279 \$                               | 8,56 \$                                  |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD C2* | Thesaurierende Klasse USD C2* | Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich) | Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich) | Thesaurierende Klasse USD E | Thesaurierende Klasse USD E |
|-------------------|-------------------------------|-------------------------------|--|--|-----------------------------|-----------------------------|
|                   | NIW                           | NIW je Anteil                 | NIW                                    | NIW je Anteil                          | NIW                         | NIW je Anteil               |
| 31. Dezember 2024 | –                             | –                             | 3.623.102 \$                           | 8,61 \$                                | 8.699.557 \$                | 14,12 \$                    |
| 31. Dezember 2023 | –                             | –                             | 7.924.348 \$                           | 8,79 \$                                | 7.630.425 \$                | 13,85 \$                    |
| 31. Dezember 2022 | 345.981 \$                    | 13,47 \$                      | 9.804.365 \$                           | 8,45 \$                                | 11.862.421 \$               | 12,79 \$                    |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) | Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) | Thesaurierende Klasse USD I | Thesaurierende Klasse USD I | Ausschüttende Klasse USD I | Ausschüttende Klasse USD I |
|-------------------|--|--|-----------------------------|-----------------------------|----------------------------|----------------------------|
|                   | NIW                                    | NIW je Anteil                          | NIW                         | NIW je Anteil               | NIW                        | NIW je Anteil              |
| 31. Dezember 2024 | 209.450 \$                             | 9,22 \$                                | 98.606.297 \$               | 28,47 \$                    | 14.210.594 \$              | 16,10 \$                   |
| 31. Dezember 2023 | 214.529 \$                             | 9,22 \$                                | 109.751.203 \$              | 27,36 \$                    | 8.362.345 \$               | 15,75 \$                   |
| 31. Dezember 2022 | 202.117 \$                             | 8,69 \$                                | 136.972.776 \$              | 24,75 \$                    | 8.086.151 \$               | 14,51 \$                   |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD I2<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I2<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD M<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD M<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)<br>NIW je Anteil |
|-------------------|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|---|---|
| 31. Dezember 2024 | 18.477.848 \$                       | 21,01 \$                                      | 31.128.386 \$                      | 14,57 \$                                     | 13.960.248 \$                                 | 10,10 \$  |
| 31. Dezember 2023 | 17.723.091 \$                       | 20,15 \$                                      | 35.815.499 \$                      | 14,25 \$                                     | 11.734.470 \$                                 | 10,21 \$  |
| 31. Dezember 2022 | 16.291.811 \$                       | 18,19 \$                                      | 47.619.174 \$                      | 13,12 \$                                     | 12.964.064 \$                                 | 9,72 \$   |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD T<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD T<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD Z<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD Z<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)<br>NIW | Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)<br>NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|------------------------------------|--|---|---|
| 31. Dezember 2024 | 16.506.967 \$                      | 16,66 \$                                     | 5.943.659 \$                       | 16,77 \$                                     | 49.199.013 ZAR                                | 77,85 ZAR   |
| 31. Dezember 2023 | 17.063.493 \$                      | 16,18 \$                                     | 1.163.860 \$                       | 16,00 \$                                     | 80.144.798 ZAR                                | 80,01 ZAR   |
| 31. Dezember 2022 | 17.827.622 \$                      | 14,79 \$                                     | 2.792.788 \$                       | 14,36 \$                                     | 95.145.043 ZAR                                | 78,11 ZAR   |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse ZAR B<br>NIW | Thesaurierende Klasse ZAR B<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich)*<br>NIW | Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich)*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse ZAR C2*<br>NIW | Thesaurierende Klasse ZAR C2*<br>NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|---|---|--------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 9.389.845 ZAR                      | 188,02 ZAR                                   | –   | –   | –                                    | –  |
| 31. Dezember 2023 | 22.512.585 ZAR                     | 179,65 ZAR                                   | –   | –   | 315.043 ZAR                          | 177,41 ZAR                                     |
| 31. Dezember 2022 | 32.016.598 ZAR                     | 162,51 ZAR                                   | 2.020.359 ZAR                                   | 77,23 ZAR   | 955.698 ZAR                          | 160,47 ZAR                                     |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## US Real Estate Securities (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse<br>ZAR E (Monatlich) | Ausschüttende Klasse<br>ZAR E (Monatlich) | Thesaurierende Klasse<br>ZAR E | Thesaurierende Klasse<br>ZAR E | Ausschüttende Klasse<br>ZAR T (Monatlich) | Ausschüttende Klasse<br>ZAR T (Monatlich) |
|-------------------|---|---|--------------------------------|--------------------------------|---|---|
|                   | NIW                                       | NIW je Anteil                             | NIW                            | NIW je Anteil                  | NIW                                       | NIW je Anteil                             |
| 31. Dezember 2024 | 42.487.794 ZAR                            | 77,86 ZAR                                 | 14.214.796 ZAR                 | 210,35 ZAR                     | 123.217.648 ZAR                           | 122,23 ZAR                                |
| 31. Dezember 2023 | 41.472.352 ZAR                            | 80,02 ZAR                                 | 27.239.513 ZAR                 | 200,99 ZAR                     | 97.954.018 ZAR                            | 124,36 ZAR                                |
| 31. Dezember 2022 | 50.137.837 ZAR                            | 78,12 ZAR                                 | 28.025.473 ZAR                 | 181,81 ZAR                     | 103.488.803 ZAR                           | 120,20 ZAR                                |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>ZAR T | Thesaurierende Klasse<br>ZAR T |
|-------------------|--------------------------------|--------------------------------|
|                   | NIW                            | NIW je Anteil                  |
| 31. Dezember 2024 | 36.139.522 ZAR                 | 263,70 ZAR                     |
| 31. Dezember 2023 | 40.917.501 ZAR                 | 249,46 ZAR                     |
| 31. Dezember 2022 | 47.847.359 ZAR                 | 223,40 ZAR                     |

## US Small Cap

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>AUD B | Thesaurierende Klasse<br>AUD B | Thesaurierende Klasse<br>AUD C2* | Thesaurierende Klasse<br>AUD C2* | Thesaurierende Klasse<br>AUD E | Thesaurierende Klasse<br>AUD E |
|-------------------|--------------------------------|--------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
|                   | NIW                            | NIW je Anteil                  | NIW                              | NIW je Anteil                    | NIW                            | NIW je Anteil                  |
| 31. Dezember 2024 | 1.008.298 AUD                  | 12,58 AUD                      | –                                | –                                | 1.986.753 AUD                  | 17,61 AUD                      |
| 31. Dezember 2023 | 1.742.449 AUD                  | 11,99 AUD                      | 11.823 AUD                       | 11,70 AUD                        | 2.052.624 AUD                  | 16,78 AUD                      |
| 31. Dezember 2022 | 1.174.595 AUD                  | 10,86 AUD                      | 17.906 AUD                       | 10,59 AUD                        | 1.486.516 AUD                  | 15,20 AUD                      |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Small Cap (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>AUD T<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>AUD T<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>EUR A<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>EUR A<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>EUR A (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>EUR A (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|--|--|
| 31. Dezember 2024 | 2.606.724 AUD                         | 16,59 AUD                                       | 45.876.338 €                          | 18,07 €   | 9.474.080 €  | 16,05 €  |
| 31. Dezember 2023 | 1.621.168 AUD                         | 15,66 AUD                                       | 1.411.931 €                           | 17,04 €   | 368.951 €  | 13,95 €  |
| 31. Dezember 2022 | 1.570.235 AUD                         | 14,04 AUD                                       | 2.265.778 €                           | 15,29 €   | 368.888 €  | 12,63 €  |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>EUR I<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>EUR I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>EUR I (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>EUR I (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>EUR I2 (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>EUR I2 (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|--|--|---|---|
| 31. Dezember 2024 | 2.406.761 €                           | 21,73 €   | 24.741.608 €   | 21,15 €  | 558.731 €   | 19,79 €   |
| 31. Dezember 2023 | 7.003.214 €                           | 20,33 €   | 4.743.299 €  | 18,23 €  | 8.827.680 €   | 17,02 €   |
| 31. Dezember 2022 | 3.429.996 €                           | 18,08 €   | 3.457.660 €  | 16,36 €  | 22.369.014 €  | 15,26 €   |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>EUR I4 (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>EUR I4 (nicht<br>währungsgesichert)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>EUR M<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>EUR M<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>EUR Z<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>EUR Z<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---|---|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | 31.799.472 €  | 12,83 €   | 609.016 €                             | 17,94 €   | 588.147 €                             | 20,90 €   |
| 31. Dezember 2023 | 49.451.043 €  | 11,02 €   | 359.461 €                             | 17,10 €   | 373.669 €                             | 19,39 €   |
| 31. Dezember 2022 | 38.159.092 €  | 9,86 €  | 213.152 €                             | 15,49 €   | 323.177 €                             | 17,10 €   |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## US Small Cap (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>GBP P (nicht<br>währungsgesichert)*<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>GBP P (nicht<br>währungsgesichert)*<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>JPY I<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>JPY I<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD A<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD A<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---|---|--------------------------------------|--|---------------------------------------|---|
| 31. Dezember 2024 | 7.621 £   | 9,91 £  | 4.619.287.325 ¥                      | 7,20 ¥   | 130.066.483 \$                        | 30,10 \$  |
| 31. Dezember 2023 | –   | –   | 4.420.253.539 ¥                      | 5,94 ¥   | 102.356.393 \$                        | 27,90 \$  |
| 31. Dezember 2022 | –   | –   | 4.342.939.609 ¥                      | 4,82 ¥   | 96.318.017 \$                         | 24,40 \$  |

| Geschäftsjahr zum | Ausschüttende Klasse<br>USD A<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>USD A<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD B<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD B<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD C2*<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD C2*<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--------------------------------------|--|---------------------------------------|---|---|---|
| 31. Dezember 2024 | 14.006.939 \$                        | 19,43 \$                                       | 6.842.647 \$                          | 21,84 \$  | –                                       | –   |
| 31. Dezember 2023 | 11.394.615 \$                        | 18,01 \$                                       | 9.816.052 \$                          | 20,47 \$  | 3.134 \$                                | 20,50 \$  |
| 31. Dezember 2022 | 10.366.064 \$                        | 15,75 \$                                       | 7.251.318 \$                          | 18,10 \$  | 61.322 \$                               | 18,12 \$  |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse<br>USD E<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD E<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse<br>USD I<br>NIW | Thesaurierende Klasse<br>USD I<br>NIW je Anteil | Ausschüttende Klasse<br>USD I<br>NIW | Ausschüttende Klasse<br>USD I<br>NIW je Anteil |
|-------------------|---------------------------------------|---|---------------------------------------|---|--------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 25.693.828 \$                         | 19,26 \$  | 387.027.597 \$                        | 33,90 \$  | 32.654.934 \$                        | 24,67 \$                                       |
| 31. Dezember 2023 | 4.842.626 \$                          | 18,05 \$  | 235.603.429 \$                        | 31,17 \$  | 23.788.319 \$                        | 22,68 \$                                       |
| 31. Dezember 2022 | 2.587.858 \$                          | 15,96 \$  | 225.900.152 \$                        | 27,02 \$  | 21.992.051 \$                        | 19,66 \$                                       |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Small Cap (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD I3<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I3<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD M<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD M<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD T<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD T<br>NIW je Anteil |
|-------------------|-------------------------------------|---|------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 113.340.773 \$                      | 17.064,14 \$                                  | 10.559.101 \$                      | 22,03 \$                                     | 11.463.076 \$                      | 24,49 \$                                     |
| 31. Dezember 2023 | 116.444.993 \$                      | 15.647,89 \$                                  | 4.726.621 \$                       | 20,63 \$                                     | 7.744.749 \$                       | 22,73 \$                                     |
| 31. Dezember 2022 | 101.463.016 \$                      | 13.534,58 \$                                  | 3.240.409 \$                       | 18,23 \$                                     | 7.242.861 \$                       | 19,89 \$                                     |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD Z<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD Z<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse ZAR E<br>NIW | Thesaurierende Klasse ZAR E<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse ZAR T<br>NIW | Thesaurierende Klasse ZAR T<br>NIW je Anteil |
|-------------------|------------------------------------|--|------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 1.807.508 \$                       | 23,37 \$                                     | 19.692.685 ZAR                     | 285,90 ZAR                                   | 16.911.547 ZAR                     | 243,45 ZAR                                   |
| 31. Dezember 2023 | 1.801.567 \$                       | 21,30 \$                                     | 8.580.171 ZAR                      | 261,62 ZAR                                   | 16.439.253 ZAR                     | 220,56 ZAR                                   |
| 31. Dezember 2022 | 2.213.208 \$                       | 18,32 \$                                     | 18.435.416 ZAR                     | 226,59 ZAR                                   | 18.202.064 ZAR                     | 189,12 ZAR                                   |

US Small Cap Intrinsic Value

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse EUR I3*<br>NIW | Thesaurierende Klasse EUR I3*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse GBP I2 (nicht währungsgesichert)<br>NIW | Thesaurierende Klasse GBP I2 (nicht währungsgesichert)<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--------------------------------------|--|--|--|---|---|
| 31. Dezember 2024 | 7.605.017 €                          | 10,97 €  | 111.785.209 £  | 11,86 £  | 20.439.954 £  | 11,04 £   |
| 31. Dezember 2023 | –                                    | –  | 76.995.502 £   | 10,82 £  | 18.429.244 £  | 10,05 £   |
| 31. Dezember 2022 | –                                    | –  | 42.248.255 £   | 10,04 £  | 13.137.811 £  | 9,31 £  |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 13. VERGLEICHSAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

## US Small Cap Intrinsic Value (Fortsetzung)

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse JPY I3 (nicht währungsgesichert)*<br>NIW | Thesaurierende Klasse JPY I3 (nicht währungsgesichert)*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD A<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD A<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I<br>NIW je Anteil |
|-------------------|--|--|------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 686.991.470 ¥  | 1.218,84 ¥   | 8.778.778 \$                       | 23,10 \$                                     | 139.580.283 \$                     | 20,66 \$                                     |
| 31. Dezember 2023 | 641.072.643 ¥  | 1.012,53 ¥   | 9.039.299 \$                       | 21,63 \$                                     | 116.918.013 \$                     | 19,18 \$                                     |
| 31. Dezember 2022 | –  | –  | 8.698.122 \$                       | 19,11 \$                                     | 85.094.541 \$                      | 16,80 \$                                     |

| Geschäftsjahr zum | Thesaurierende Klasse USD I2<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I2<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD I3*<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD I3*<br>NIW je Anteil | Thesaurierende Klasse USD M<br>NIW | Thesaurierende Klasse USD M<br>NIW je Anteil |
|-------------------|-------------------------------------|---|--------------------------------------|--|------------------------------------|--|
| 31. Dezember 2024 | 50.871.268 \$                       | 10,42 \$                                      | 21.943.707 \$                        | 9,65 \$  | 1.334.628 \$                       | 18,81 \$                                     |
| 31. Dezember 2023 | 68.837.919 \$                       | 9,66 \$                                       | –                                    | –  | 415.451 \$                         | 17,79 \$                                     |
| 31. Dezember 2022 | 32.935.389 \$                       | 8,44 \$                                       | –                                    | –  | 500.654 \$                         | 15,88 \$                                     |

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

Bei sämtlichen angegebenen Beträgen zum NIW und NIW je Anteil handelt es sich um Werte für den Handel mit Anteilhabern oder bei Portfolios, die nicht täglich gehandelt werden, um indikative Werte.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

14. WECHSELKURSE

Zur Umrechnung der auf Fremdwährungen lautenden Vermögenswerte und Verbindlichkeiten am Ende des Geschäftsjahres (31. Dezember 2024) wurden die folgenden Wechselkurse verwendet

|                         |                          |                         |                       |                          |
|-------------------------|--------------------------|-------------------------|-----------------------|--------------------------|
| 1 USD = 3,67305 AED     | 1 USD = 24,31195 CZK     | 1 USD = 85,61375 INR    | 1 USD = 57,84500 PHP  | 1 USD = 35,36050 TRY     |
| 1 USD = 1.189,16000 ARS | 1 USD = 7,20160 DKK      | 1 USD = 157,16000 JPY   | 1 USD = 278,37500 PKR | 1 USD = 32,78450 TWD     |
| 1 USD = 1,61512 AUD     | 1 USD = 61,06000 DOP     | 1 USD = 129,35000 KES   | 1 USD = 4,13060 PLN   | 1 USD = 3.700,00000 UGX  |
| 1 USD = 6,17785 BRL     | 1 USD = 50,83000 EGP     | 1 USD = 1.472,15000 KRW | 1 USD = 3,64100 QAR   | 1 USD = 43,66500 UYU     |
| 1 USD = 1,43820 CAD     | 1 USD = 0,96572 EUR      | 1 USD = 524,61000 KZT   | 1 USD = 4,80490 RON   | 1 USD = 25.485,00000 VND |
| 1 USD = 0,90625 CHF     | 1 USD = 0,79847 GBP      | 1 USD = 20,79275 MXN    | 1 USD = 112,95000 RSD | 1 USD = 18,87000 ZAR     |
| 1 USD = 994,52500 CLP   | 1 USD = 14,70000 GHS     | 1 USD = 4,47150 MYR     | 1 USD = 109,75000 RUB | 1 USD = 27,88070 ZMW     |
| 1 USD = 7,34150 CNH     | 1 USD = 7,76795 HKD      | 1 USD = 1.544,00000 NGN | 1 USD = 3,75740 SAR   |                          |
| 1 USD = 7,29925 CNY     | 1 USD = 397,26220 HUF    | 1 USD = 11,35735 NOK    | 1 USD = 11,04925 SEK  |                          |
| 1 USD = 4.405,54000 COP | 1 USD = 16.095,00000 IDR | 1 USD = 1,78492 NZD     | 1 USD = 1,36420 SGD   |                          |
| 1 USD = 508,83500 CRC   | 1 USD = 3,64365 ILS      | 1 USD = 3,75690 PEN     | 1 USD = 34,09500 THB  |                          |
| 1 EUR = 1,67245 AUD     | 1 EUR = 25,17502 CZK     | 1 EUR = 8,04371 HKD     | 1 EUR = 4,27724 PLN   | 1 EUR = 1,03550 USD      |
| 1 EUR = 1,48926 CAD     | 1 EUR = 7,45726 DKK      | 1 EUR = 162,73918 JPY   | 1 EUR = 11,44150 SEK  |                          |
| 1 EUR = 0,93842 CHF     | 1 EUR = 0,82681 GBP      | 1 EUR = 11,76054 NOK    | 1 EUR = 1,41263 SGD   |                          |
| 1 CNH = 1,00000 CNY     | 1 CNH = 0,10876 GBP      | 1 CNH = 0,18582 SGD     |                       |                          |
| 1 CNH = 0,13154 EUR     | 1 CNH = 1,05809 HKD      | 1 CNH = 0,13621 USD     |                       |                          |
| 1 EUR = 0,00613 EUR     | 1 EUR = 0,00508 GBP      | 1 EUR = 0,00636 USD     |                       |                          |

Zur Umrechnung der auf Fremdwährungen lautenden Vermögenswerte und Verbindlichkeiten am Ende des Geschäftsjahres (31. Dezember 2023) wurden die folgenden Wechselkurse verwendet

|                         |                          |                         |                       |                          |
|-------------------------|--------------------------|-------------------------|-----------------------|--------------------------|
| 1 USD = 3,67275 AED     | 1 USD = 22,34960 CZK     | 1 USD = 3,60090 ILS     | 1 USD = 1,57940 NZD   | 1 USD = 1,31910 SGD      |
| 1 USD = 975,38000 ARS   | 1 USD = 6,74835 DKK      | 1 USD = 83,21375 INR    | 1 USD = 3,70260 PEN   | 1 USD = 34,13250 THB     |
| 1 USD = 1,46552 AUD     | 1 USD = 58,06000 DOP     | 1 USD = 140,98000 JPY   | 1 USD = 55,37500 PHP  | 1 USD = 29,53400 TRY     |
| 1 USD = 4,85760 BRL     | 1 USD = 30,92500 EGP     | 1 USD = 157,00000 KES   | 1 USD = 3,93225 PLN   | 1 USD = 30,69050 TWD     |
| 1 USD = 1,31860 CAD     | 1 USD = 0,90526 EUR      | 1 USD = 1.287,90000 KRW | 1 USD = 3,64100 QAR   | 1 USD = 3.780,00000 UGX  |
| 1 USD = 0,84165 CHF     | 1 USD = 0,78444 GBP      | 1 USD = 455,89000 KZT   | 1 USD = 4,50360 RON   | 1 USD = 39,04000 UYU     |
| 1 USD = 873,28500 CLP   | 1 USD = 11,91500 GHS     | 1 USD = 16,93450 MXN    | 1 USD = 106,13000 RSD | 1 USD = 24.262,00000 VND |
| 1 USD = 7,12060 CNH     | 1 USD = 7,80855 HKD      | 1 USD = 4,59500 MYR     | 1 USD = 89,40000 RUB  | 1 USD = 18,28750 ZAR     |
| 1 USD = 7,09220 CNY     | 1 USD = 346,00555 HUF    | 1 USD = 897,50000 NGN   | 1 USD = 3,75000 SAR   | 1 USD = 25,71030 ZMW     |
| 1 USD = 3.874,00000 COP | 1 USD = 15.397,00000 IDR | 1 USD = 10,15570 NOK    | 1 USD = 10,07785 SEK  |                          |
| 1 EUR = 1,61889 AUD     | 1 EUR = 24,68849 CZK     | 1 EUR = 8,62571 HKD     | 1 EUR = 4,34376 PLN   | 1 EUR = 1,45714 SGD      |
| 1 EUR = 1,45659 CAD     | 1 EUR = 7,45456 DKK      | 1 EUR = 155,73356 JPY   | 1 EUR = 11,13250 SEK  | 1 EUR = 1,10465 USD      |
| 1 EUR = 0,92973 CHF     | 1 EUR = 0,86653 GBP      | 1 EUR = 11,21849 NOK    |                       |                          |
| 1 CNH = 1,00000 CNY     | 1 CNH = 0,11016 GBP      | 1 CNH = 0,18525 SGD     |                       |                          |
| 1 CNH = 0,12713 EUR     | 1 CNH = 1,09661 HKD      | 1 CNH = 0,14044 USD     |                       |                          |
| 1 EUR = 0,00642 EUR     | 1 EUR = 0,00556 GBP      | 1 EUR = 0,00709 USD     |                       |                          |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 14. WECHSELKURSE (FORTSETZUNG)

|      |                            |     |                            |     |                             |
|------|----------------------------|-----|----------------------------|-----|-----------------------------|
| AED  | VAE-Dirham                 | HKD | Hongkong-Dollar            | QAR | Katar-Rial                  |
| ARS  | Argentinischer Peso        | HUF | Ungarischer Forint         | RON | Rumänischer neuer Leu       |
| AUD  | Australischer Dollar       | IDR | Indonesische Rupiah        | RSD | Serbischer Dinar            |
| BRL  | Brasilianischer Real       | ILS | Israelischer Neuer Schekel | RUB | Russischer Rubel            |
| CAD  | Kanadischer Dollar         | INR | Indische Rupie             | SAR | Saudi-Riyal                 |
| CHF  | Schweizer Franken          | JPY | Japanischer Yen (¥)        | SEK | Schwedische Krone           |
| CLP  | Chilenischer Peso          | KES | Kenianischer Schilling     | SGD | Singapur-Dollar             |
| *CNH | Chinesischer Yuan Renminbi | KRW | Südkoreanischer Won        | THB | Thailändischer Baht         |
| *CNY | Chinesischer Yuan Renminbi | KZT | Kasachischer Tenge         | TRY | Türkische Lira              |
| COP  | Kolumbianischer Peso       | MXN | Mexikanischer Peso         | TWD | Neuer taiwanesischer Dollar |
| CRC  | Costa Rican Colon          | MYR | Malaysischer Ringgit       | UGX | Uganda-Schilling            |
| CZK  | Tschechische Krone         | NGN | Nigerianischer Naira       | USD | US-Dollar (\$)              |
| DKK  | Dänische Krone             | NOK | Norwegische Krone          | UYU | Uruguayischer Peso          |
| DOP  | Dominikanischer Peso       | NZD | Neuseeländischer Dollar    | VND | Vietnamesischer Dong        |
| EGP  | Ägyptisches Pfund          | PEN | Peruanischer Sol           | ZAR | Südafrikanischer Rand       |
| EUR  | Euro (€)                   | PHP | Philippinischer Peso       | ZMW | Sambischer Kwacha           |
| GBP  | Britisches Pfund (£)       | PKR | Pakistanische Rupie        |     |                             |
| GHS  | Ghanaischer Cedi           | PLN | Polnischer Zloty           |     |                             |

\*Es gibt in China eine offizielle Währung, den chinesischen Yuan Renminbi. Der CNY wird „onshore“, auf dem chinesischen Festland, gehandelt, der CNH „offshore“, in erster Linie in Hongkong, zu jeweils unterschiedlichen Wechselkursen.

## 15. BERICHTIGUNG DER WÄHRUNGSUMRECHNUNG

Der Konzernabschluss für den Fonds ist auf US-Dollar denominated. Zum Zwecke der Berichterstattung der Gesamtergebnisse des Fonds wurden die Ergebnisse einiger Portfolios zu den nachstehend angegebenen Kursen in US-Dollar umgerechnet.

| Portfolio                   | Bilanz                |                       | Gewinn- und Verlustrechnung und die Aufstellung über die Entwicklung der auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens |                       |
|-----------------------------|-----------------------|-----------------------|--|-----------------------|
|                             | Schlusskurs           |                       | Durchschnittskurs  |                       |
|                             | 31. Dezember 2024     | 31. Dezember 2023     | 31. Dezember 2024  | 31. Dezember 2023     |
| China A-Share Equity        | US\$ 1 = CNY 7,29925  | US\$ 1 = CNY 7,09220  | US\$ 1 = CNY 7,18641   | US\$ 1 = CNY 7,08452  |
| China Bond                  | US\$ 1 = CNY 7,29925  | US\$ 1 = CNY 7,09220  | US\$ 1 = CNY 7,18641   | US\$ 1 = CNY 7,08452  |
| Corporate Hybrid Bond       | US\$ 1 = EUR 0,96572  | US\$ 1 = EUR 0,90526  | US\$ 1 = EUR 0,92481   | US\$ 1 = EUR 0,92479  |
| Euro Bond                   | US\$ 1 = EUR 0,96572  | US\$ 1 = EUR 0,90526  | US\$ 1 = EUR 0,92481   | US\$ 1 = EUR 0,92479  |
| Euro Bond Absolute Return   | US\$ 1 = EUR 0,96572  | US\$ 1 = EUR 0,90526  | US\$ 1 = EUR 0,92481   | US\$ 1 = EUR 0,92479  |
| European High Yield Bond    | US\$ 1 = EUR 0,96572  | US\$ 1 = EUR 0,90526  | US\$ 1 = EUR 0,92481   | US\$ 1 = EUR 0,92479  |
| European Sustainable Equity | US\$ 1 = EUR 0,96572  | US\$ 1 = EUR 0,90526  | US\$ 1 = EUR 0,92481   | US\$ 1 = EUR 0,92479  |
| Japan Equity Engagement     | US\$ 1 = JPY 157,1600 | US\$ 1 = JPY 140,9800 | US\$ 1 = JPY 150,9473  | US\$ 1 = JPY 140,6815 |
| Macro Opportunities FX*     | US\$ 1 = EUR 0,96572  | US\$ 1 = EUR 0,90526  | US\$ 1 = EUR 0,92481   | US\$ 1 = EUR 0,92479  |
| Short Duration Euro Bond    | US\$ 1 = EUR 0,96572  | US\$ 1 = EUR 0,90526  | US\$ 1 = EUR 0,92481   | US\$ 1 = EUR 0,92479  |

\* Das Portfolio wurde am 8. Februar 2024 aufgelöst.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

### 15. BERICHTIGUNG DER WÄHRUNGSUMRECHNUNG (FORTSETZUNG)

Aus der Umrechnung des Eröffnungsnettovermögens, der Gewinn- und Verlustrechnung und der Aufstellung über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens ergab sich eine nominale Währungsanpassung von (329.834.723) US\$ (31. Dezember 2023: 111.001.114 US\$) ergab sich aus der Umrechnung des Eröffnungsnettovermögens, der Gewinn- und Verlustrechnung und der Aufstellung über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens eine nominale Währungsanpassung. Die Umrechnungsmethode hat keinen Einfluss auf den Wert des Nettovermögens, der den einzelnen Portfolios zuzuschreiben ist.

### 16. VEREINBARUNGEN ÜBER PROVISIONSNACHLÄSSE (SOFT COMMISSIONS)

Der Manager und verbundene Personen haben in begrenzten Fällen Vereinbarungen über Provisionsnachlässe mit Brokern in Bezug auf Research-Produkte abgeschlossen unter der Voraussetzung, dass sie die beste Ausführung (Best Execution) zur Unterstützung von Anlagenentscheidungen erhalten.

Zu den erhaltenen Research-Leistungen gehören alle standardmäßigen Research-Produkte, insbesondere aktuelle und historische Daten in Bezug auf bestimmte Unternehmen, Branchen und die Finanzwirtschaft insgesamt sowie Informationen über Chancen, Risiken und Trends sowie Analysen in Bezug auf spezielle Situationen. Der Manager ist der Auffassung, dass diese Vereinbarungen den Portfolios zugute kommen, und hat sich davon überzeugt, dass er für die Portfolios die beste Ausführung erhält.

### 17. GETRENNTE HAFTUNG

Der Fonds hat mehrere Portfolios und weitere Portfolios können künftig aufgelegt werden. Mit der Zustimmung der Anteilhaber des Fonds, die am 3. November 2006 durch einen Sonderbeschluss erteilt wurde, hat der Fonds die getrennte Haftung zwischen seinen Portfolios eingeführt. Ab diesem Datum trägt jedes Portfolio seine eigenen Verbindlichkeiten, und weder der Fonds noch die vom Fonds ernannten Dienstleistungsanbieter noch die Direktoren, Konkursverwalter, Prüfer oder Liquidatoren noch eine sonstige Person erhalten Zugriff auf die Vermögenswerte eines Portfolios zur Begleichung von Verbindlichkeiten eines anderen Portfolios.

### 18. EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT

Der Fonds kann zu den Bedingungen und innerhalb der Grenzen, die von der Zentralbank vorgegeben werden, in Bezug auf Wertpapiere und/oder Finanzinstrumente, einschließlich derivative Instrumente, Anlagetechniken und Instrumente anwenden, vorausgesetzt, dass diese für Zwecke des effizienten Portfoliomanagements (d. h. zur Absicherung, zur Reduzierung von Risiken oder Kosten oder zur Steigerung der Kapital- oder Ertragsrendite) oder für Anlagezwecke angewandt werden. Die angewandten Techniken und Instrumente dürfen nur in Einklang mit den Anlagezielen des jeweiligen Portfolios eingesetzt werden.

Nach Ermessen des Managers und des Sub-Investment-Managers kann jedes Portfolio zu den von den OGAW-Vorschriften der Zentralbank festgelegten Bedingungen und Grenzen für alle Arten von Vermögenswerten, in die das Portfolio anlegen kann, Wertpapierleihgeschäfte („Wertpapierleihverträge“) abschließen, so wie im Abschnitt „Instrumente/Anlageklassen“ im jeweiligen Zusatz für das Portfolio beschrieben. Solche Wertpapierleihgeschäfte können zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements eingesetzt werden.

Wertpapierleihverträge sind Transaktionen, über die ein Portfolio seine Wertpapiere an eine andere Partei, den Kreditnehmer, ausleiht, der vertraglich verpflichtet ist, zum Ende eines vereinbarten Zeitraums äquivalente Wertpapiere zurückzugeben. Solange die Wertpapiere ausgeliehen sind, zahlt der Kreditnehmer dem Portfolio (i) eine Kreditgebühr und (ii) Erträge aus den Wertpapieren.

Zum 31. Dezember 2024 und 31. Dezember 2023 hatte der Fonds keine Wertpapierleihgeschäfte abgeschlossen.

Im am 31. Dezember 2024 beendeten Geschäftsjahr haben der CLO Income, Corporate Hybrid Bond, der EMD Corporate – Social and Environmental Transition, der Emerging Market Debt - Hard Currency, der Emerging Market Debt - Local Currency, der Global Flexible Credit Income, der Global High Yield Engagement, der High Yield Bond, der Short Duration Emerging Market Debt, der Short Duration High Yield Engagement, der Strategic Income und der Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte abgeschlossen. Die gesamten Zinserträge aus Pensionsgeschäften und umgekehrten Pensionsgeschäften lagen für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024 bei 13.619.831 US\$ bzw. 47 US\$. Die gesamten Zinsaufwendungen aus Pensionsgeschäften und umgekehrten Pensionsgeschäften lagen für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024 bei null7 US\$ bzw. 69.915 US\$. Direkte und indirekte Kosten im Zusammenhang mit effizienten Portfoliomanagementstechniken können nicht ohne Weiteres bestimmt werden.

Im zum 31. Dezember 2023 endenden Geschäftsjahr haben der Corporate Hybrid Bond, der Emerging Market Debt Blend und der Short Duration Emerging Market Debt Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte abgeschlossen. Die gesamten Zinserträge aus Pensionsgeschäften und umgekehrten Pensionsgeschäften lagen für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 bei 1.613 US\$ bzw. 38.355 US\$. Die gesamten Zinsaufwendungen aus Pensionsgeschäften und umgekehrten Pensionsgeschäften lagen für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024 bei 2.677 US\$ bzw. 175.821 US\$. Direkte und indirekte Kosten im Zusammenhang mit effizienten Portfoliomanagementstechniken können nicht ohne Weiteres bestimmt werden.

**FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR****19. KREDITFAZILITÄT**

Bei der Sitzung der Direktoren vom 20. Juni 2016 wurde mit The Bank of Tokyo Mitsubishi UFJ Ltd. vereinbart, dass sie zusammen mit einem Syndikat von anderen Banken (zusammen die „Kreditgeber“) dem Fonds in Bezug auf die Portfolios ab dem Datum der Ausfertigung eines Kreditvertrags mit der Bank eine zugesagte Liquiditätsfazilität (die „Fazilität“) zur Verfügung stellt, und dass der Gegenwert der Fazilität nur für den vorübergehenden Liquiditätsbedarf oder in Notlagen der Portfolios in Anspruch genommen werden darf. Die Fazilität in Höhe von 850.000.000 US\$ wurde am 26. September 2024 für den Zeitraum von 364 Tagen für sämtliche Portfolios verlängert. Die Kosten für die Bereitstellungsprovision wurden dementsprechend geändert.

Zum 31. Dezember 2024 gab es keine im Rahmen der Fazilität ausstehenden Kredite (31. Dezember 2023: ebenso). In den Geschäftsjahren zum 31. Dezember 2024 und 31. Dezember 2023 wurde die Kreditfazilität von keinem der Portfolios in Anspruch genommen

**20. UNGEDECKTE KREDITZUSAGEN**

Zum 31. Dezember 2024 hatte der Fonds die folgenden ungedeckten Kreditverbindlichkeiten:

| Name des Portfolios           | Name des Wertpapiers           | Ungedeckte<br>Verpflichtungen<br>USD | Zeitwert<br>USD |
|-------------------------------|--------------------------------|--------------------------------------|-----------------|
| Global Flexible Credit Income | Focus Financial Partners LLC   | 97.350                               | 97.998          |
| Global Flexible Credit Income | Raven Acquisition Holdings LLC | 66.500                               | 66.900          |
| Strategic Income              | ArchKey Holdings Inc           | 312.440                              | 312.914         |

Zum 31. Dezember 2023 hatte der Fonds keine ungedeckten Kreditverbindlichkeiten:

**21. WICHTIGE EREIGNISSE WÄHREND DES GESCHÄFTSJAHR**

Mit Wirkung zum 1. Februar 2024 wurde die Managementgebühr für den Neuberger Berman Global Equity Megatrends Fund für die Thesaurierende Klasse EUR I und die Thesaurierende Klasse USD I von 0,85 % auf 0,80 %, für die Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert), die Thesaurierende Klasse SGD A, die Thesaurierende Klasse USD A, die Thesaurierende Klasse USD C1, die Thesaurierende Klasse USD M von 1,70 % auf 1,60 % und für die Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) von 0,81 % auf 0,76 % gesenkt.

Der Macro Opportunities FX wurde am 8. Februar 2024 aufgelöst.

Mit Wirkung vom 1. März 2024 wurde die Managementgebühr für den Neuberger Berman EMD Corporate - Social and Environmental Transition Fund für die Thesaurierende Klasse EUR X von 0,46 % auf 0,35 % gesenkt.

Der Global Diversified Income FMP – 2024 wurde am 28. Juni 2024 aufgelöst.

Eine neue Version des Prospekts des Fonds und neue Zusätze zum Verkaufsprospekt, die die Namensänderungen der Portfolios und die Aktualisierung des Benchmarknamens des Neuberger Berman Tactical Macro Fund betreffen, wurden am 1. Juli 2024 von der Zentralbank entgegengenommen. Der Neuberger Berman 5G Connectivity Fund wurde in Neuberger Berman Next Generation Connectivity Fund, der Neuberger Berman InnovAsia 5G Fund in Neuberger Berman InnovAsia Fund, der Neuberger Berman Global Sustainable Value Fund in Neuberger Berman Global Value Fund und der Neuberger Berman US Equity Index PutWrite Fund in Neuberger Berman US Equity Premium Fund umbenannt. Die Benchmark des Neuberger Berman Tactical Macro Fund wurde in ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity (Total Return, USD) umbenannt.

Mit Wirkung zum 1. August 2024 stellte die Soloda Investment Advisors LLP ihre Tätigkeit als nicht verbundener Unterberater des Fonds ein.

Mit Wirkung zum 1. August 2024 stellte die Cipher Capital LP ihre Tätigkeit als nicht verbundener Unterberater des Fonds ein.

Mit Wirkung vom 7. Oktober 2024 wurde der Neuberger Berman CLO Income Fund von einem Artikel-6-Portfolio zu einem Artikel-8-Portfolio für die Zwecke der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rats vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor („SFDR“) umklassifiziert.

Mit Wirkung vom 1. November 2024 bis zum 31. Dezember 2024 wurde die Managementgebühr für den Neuberger Berman Global Investment Grade Credit Fund für die Thesaurierende Klasse EUR I vorübergehend von 0,30 % auf 0,10 % gesenkt und anschließend mit Wirkung vom 1. Januar 2025 auf 0,30 % erhöht.

**FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR**

**21. WICHTIGE EREIGNISSE WÄHREND DES GESCHÄFTSJAHRES (FORTSETZUNG)**

Mit Wirkung vom 26. November 2024 trat Alex Duncan als Direktor des Fonds zurück.

Eine neue Version des Prospekts des Fonds und neue Nachträge zum Verkaufsprospekt, die sich auf Namensänderungen von Portfolios beziehen, wurden am 12. Dezember 2024 von der Zentralbank entgegengenommen. Der Neuberger Berman Responsible Asian Debt - Hard Currency Fund wurde in Neuberger Berman Asia Responsible Transition Bond Fund umbenannt, der Neuberger Berman Sustainable Emerging Market Corporate Debt Fund in Neuberger Berman EMD Corporate – Social and Environmental Transition Fund, der Neuberger Berman Global High Yield SDG Engagement Fund in Neuberger Berman Global High Yield Engagement Fund, der Neuberger Berman Short Duration High Yield SDG Engagement Fund in Neuberger Berman Short Duration High Yield Engagement Fund und der Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund in Neuberger Berman Short Duration Euro Bond Fund.

Mit Wirkung vom 12. Dezember 2024 wurde der Neuberger Berman US Small Cap Intrinsic Value Fund von einem Artikel-6-Portfolio in ein Artikel-8-Portfolio für die Zwecke der SFDR umklassifiziert.

Mit Wirkung vom 16. Dezember 2024 stellte die Matheson LLP ihre Tätigkeit als Rechtsberater für irisches Recht ein.

Mit Wirkung vom 17. Dezember 2024 wurde die Maples and Calder (Ireland) LLP zum Rechtsberater für irisches Recht ernannt.

Eine neue Version des Thematic-Equity-Prospektnachtrags, der die Aufnahme einer neuen Klasse-S-Kategorie in den Neuberger Berman Global Equity Megatrends Fund betrifft, wurde am 19. Dezember 2024 von der Zentralbank entgegengenommen.

Der Global Real Estate Securities wurde am 31. Dezember 2024 aufgelöst.

Mit Wirkung vom 31. Dezember 2024 stellte die Matsack Trust Limited ihre Tätigkeit als Secretary und eingetragener Geschäftssitz des Fonds ein.

Außer den oben erwähnten sind während des Geschäftsjahres keine wesentlichen, den Fonds betreffenden Ereignisse eingetreten.

**22. WESENTLICHE EREIGNISSE SEIT DEM ENDE DES GESCHÄFTSJAHRES**

Mit Wirkung vom 1. Januar 2025 wurde die MFD Secretaries Limited zum Secretary und eingetragenen Geschäftssitz des Fonds ernannt.

Eine neue Version des Thematic-Equity-Prospektnachtrags, der die Korrektur des Fehlers in Bezug auf die Erstzeichnungs- und Mindestbestandsbeträge für die Klasse-S-Kategorie betrifft, wurde am 20. Januar 2025 von der Zentralbank entgegengenommen.

Mit Wirkung vom 3. Februar 2025 wurde Mary Brady zur Direktorin des Fonds ernannte.

Mit Wirkung vom 28. März 2025 wurde der Neuberger Berman China Bond Fund aufgelöst.

Im Zeitraum vom 1. Januar 2025 bis einschließlich 16. April 2025 gab es größere Zeichnungen und Rücknahmen, die 5 % des Nettovermögens des jeweiligen Portfolios überstiegen, ausgewiesen in nachstehender Tabelle:

| Portfolio                             | Währung | Zeichnungen | Rücknahmen  |
|---------------------------------------|---------|-------------|-------------|
| China Bond                            | CNY     | 12.009      | 119.327.190 |
| China Equity                          | USD     | -           | 31.246.175  |
| CLO Income                            | USD     | 412.930.067 | 38.298.045  |
| Commodities                           | USD     | 122.465.192 | 9.622.841   |
| Corporate Hybrid Bond                 | EUR     | 318.890.662 | 176.209.781 |
| Developed Market FMP – 2027           | USD     | -           | 7.910.410   |
| Emerging Market Debt - Hard Currency  | USD     | 186.301.676 | 182.500.503 |
| Emerging Market Debt - Local Currency | USD     | 15.975.118  | 55.820.912  |
| Emerging Market Debt Blend            | USD     | 20.359.048  | 28.910.764  |
| Emerging Markets Equity               | USD     | 9.419.168   | 14.772.907  |
| Euro Bond                             | EUR     | 2.554.055   | 1.535.252   |
| European High Yield Bond              | EUR     | 62.186.064  | 19.870.832  |
| Event Driven                          | USD     | 114.894.951 | 30.175.695  |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 22. WESENTLICHE EREIGNISSE SEIT DEM ENDE DES GESCHÄFTSJAHRES (FORTSETZUNG)

| Portfolio (Fortsetzung)              | Währung | Zeichnungen   | Rücknahmen  |
|--------------------------------------|---------|---------------|-------------|
| Global Bond                          | USD     | 631.558       | 11.976.203  |
| Global Equity Megatrends             | USD     | 159.446.413   | 45.765.238  |
| Global Flexible Credit Income        | USD     | 90.160.658    | 21.170.971  |
| Global High Yield Engagement         | USD     | 9.235.474     | 55.332.569  |
| Global Opportunistic Bond            | USD     | 455.342       | 10.729.643  |
| Global Sustainable Equity            | USD     | 634.597       | 30.292.515  |
| Global Value                         | USD     | 1.604.018     | 5.392.470   |
| High Yield Bond                      | USD     | 139.452.570   | 160.196.810 |
| InnovAsia                            | USD     | -             | 7.972.290   |
| Japan Equity Engagement              | JPY     | 2.262.161.779 | 337.224.139 |
| Next Generation Connectivity         | USD     | 138.422.977   | 147.245.174 |
| Next Generation Mobility             | USD     | 1.382.829     | 19.890.684  |
| Next Generation Space Economy        | USD     | 33.445.423    | 12.604.849  |
| Short Duration Emerging Market Debt  | USD     | 500.545.226   | 328.650.934 |
| Short Duration Euro Bond             | EUR     | 611.574.686   | 183.604.406 |
| Short Duration High Yield Engagement | USD     | 68.929.543    | 80.463.731  |
| Strategic Income                     | USD     | 743.421.082   | 416.773.779 |
| Tactical Macro                       | USD     | 7.026.391     | 7.156.500   |
| Uncorrelated Strategies              | USD     | 27.303.724    | 90.616.977  |
| US Equity                            | USD     | 45.984.946    | 11.160.623  |
| US Equity Premium                    | USD     | 41.149.870    | 36.167.979  |
| US Large Cap Value                   | USD     | 100.135.033   | 378.207.278 |
| US Long Short Equity                 | USD     | 10.813.397    | 13.085.195  |
| US Multi Cap Opportunities           | USD     | 41.047.428    | 34.115.505  |
| US Real Estate Securities            | USD     | 29.055.257    | 48.689.255  |
| US Small Cap                         | USD     | 91.757.977    | 263.763.116 |
| US Small Cap Intrinsic Value         | USD     | 27.249.788    | 10.623.703  |

Informationen zu zusätzlicher Marktvolatilität seit dem Jahresende finden Sie im Abschnitt Sonstige Sachverhalte im Bericht der Direktoren.

Außer den oben erwähnten sind seit Jahresende keine wesentlichen, den Fonds betreffenden Ereignisse eingetreten.

## 23. GENEHMIGUNG DES ABSCHLUSSES

Die Direktoren haben den Jahresbericht und den geprüften Jahresabschluss am 16. April 2025 genehmigt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN

Der Manager des Fonds ist ein verbundenes Unternehmen von Neuberger Berman Investment Advisers LLC, einem bei der Securities and Exchange Commission („SEC“) in den USA registrierten Anlageberater. Die hierin enthaltenen Informationen spiegeln die den allgemein anerkannten Bilanzierungsgrundsätzen der USA („US GAAP“) entsprechenden Offenlegungen wider, so dass der Manager von bestimmten Ausnahmen Gebrauch machen kann, die ihm gemäß SEC Custody Rule zur Verfügung stehen.

Asia Responsible Transition Bond

|   | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD A<br>(Monatlich)<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD C1<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I4<br>(Monatlich)<br>US\$ |
|---|---|---|--|---|--|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |   |  |   |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 7,78  | 11,63                                     | 9,09                                       | 12,21                                     | 9,21                                     | 10,14  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |   |  |   |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,23  | 0,37                                      | 0,18                                       | 0,47                                      | 0,34                                     | 0,40   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,14  | 0,19                                      | 0,16                                       | 0,20                                      | 0,14                                     | 0,16   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,37  | 0,56                                      | 0,34                                       | 0,67                                      | 0,48                                     | 0,56   |
| Ausschüttungen  | (0,51)  | –   | –  | –   | (0,33)                                   | (0,67)   |
| Schlussnettoinventarwert  | 7,64  | 12,19                                     | 9,43                                       | 12,88                                     | 9,36                                     | 10,03  |
| Gesamtertrag  | 4,89 %  | 4,82 %                                    | 3,74 %                                     | 5,49 %                                    | 5,40 %                                   | 5,65 %   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |   |  |   |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,36 %  | 1,37 %                                    | 2,38 %                                     | 0,77 %                                    | 0,77 %                                   | 0,53 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 2,98 %  | 3,07 %                                    | 2,01 %                                     | 3,70 %                                    | 3,71 %                                   | 3,93 %   |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |   |   |  |   |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 7,83  | 10,99                                     | 8,68                                       | 11,47                                     | 8,96                                     | 10,12  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |   |  |   |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,24  | 0,35                                      | 0,19                                       | 0,44                                      | 0,42                                     | 0,40   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,20  | 0,29                                      | 0,22                                       | 0,30                                      | 0,14                                     | 0,25   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,44  | 0,64                                      | 0,41                                       | 0,74                                      | 0,56                                     | 0,65   |
| Ausschüttungen  | (0,49)  | –   | –  | –   | (0,31)                                   | (0,63)   |
| Schlussnettoinventarwert  | 7,78  | 11,63                                     | 9,09                                       | 12,21                                     | 9,21                                     | 10,14  |
| Gesamtertrag  | 5,82 %  | 5,82 %                                    | 4,72 %                                     | 6,45 %                                    | 6,46 %                                   | 6,70 %   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |   |  |   |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,36 %  | 1,36 %                                    | 2,36 %                                     | 0,76 %                                    | 1,05 %                                   | 0,52 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 3,12 %  | 3,12 %                                    | 2,10 %                                     | 3,72 %                                    | 4,80 %                                   | 3,96 %   |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Asia Responsible Transition Bond (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I4<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD X<br>(Monatlich)<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD X<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z<br>US\$ |
|---|--|---|---|---|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |   |   |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,92                                      | 9,32                                      | 10,05   | 9,05                                      | 10,72                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |   |   |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,46                                       | 0,23                                      | 0,32  | 0,30                                      | 0,47                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,16                                       | 0,16                                      | 0,16  | 0,14                                      | 0,18                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,62                                       | 0,39                                      | 0,48  | 0,44                                      | 0,65                                      |
| Ausschüttungen  | –  | –   | (0,66)  | –   | –   |
| Schlussnettoinventarwert  | 11,54                                      | 9,71                                      | 9,87  | 9,49                                      | 11,37                                     |
| Gesamtertrag  | 5,68 %                                     | 4,18 %                                    | 4,90 %  | 4,86 %                                    | 6,06 %                                    |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |   |   |   |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,52 %                                     | 1,97 %                                    | 1,27 %  | 1,27 %                                    | 0,17 %                                    |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 4,03 %                                     | 2,46 %                                    | 3,19 %  | 3,20 %                                    | 4,26 %                                    |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |  |   |   |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,23                                      | 8,86                                      | 10,10   | 8,54                                      | 10,01                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |   |   |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,42                                       | 0,22                                      | 0,32  | 0,28                                      | 0,45                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,27                                       | 0,24                                      | 0,26  | 0,23                                      | 0,26                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,69                                       | 0,46                                      | 0,58  | 0,51                                      | 0,71                                      |
| Ausschüttungen  | –  | –   | (0,63)  | –   | –   |
| Schlussnettoinventarwert  | 10,92                                      | 9,32                                      | 10,05   | 9,05                                      | 10,72                                     |
| Gesamtertrag  | 6,74 %                                     | 5,19 %                                    | 5,97 %  | 5,97 %                                    | 7,09 %                                    |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |   |   |   |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,51 %                                     | 1,97 %                                    | 1,26 %  | 1,26 %                                    | 0,16 %                                    |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 3,97 %                                     | 2,48 %                                    | 3,22 %  | 3,22 %                                    | 4,38 %                                    |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

China A-Share Equity

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>CNY I<br>CNY | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I (nicht<br>währungs-<br>gesichert)<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I (nicht<br>währungsgesichert)<br>US\$ |
|---|--|---|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 80,34                                    | 7,90  | 7,89  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 1,04                                     | 0,14  | 0,10  |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 2,02                                     | (0,08)  | (0,04)  |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 3,06                                     | 0,06  | 0,06  |
| Ausschüttungen  | –  | –   | (0,06)  |
| Schlussnettoinventarwert  | 83,40                                    | 7,96  | 7,89  |
| Gesamtertrag  | 3,81 %                                   | 0,76 %  | 0,78 %  |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |        |        |
|--------------------------------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 1,22 % | 1,20 % | 1,19 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 1,28 % | 1,73 % | 1,25 % |

**31. Dezember 2023**

|   |           |           |           |
|---|-----------|-----------|-----------|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 91,62     | 9,28      | 9,27      |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |           |           |           |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,60      | 0,06      | 0,06      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | (11,88)   | (1,44)    | (1,43)    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | (11,28)   | (1,38)    | (1,37)    |
| Ausschüttungen  | –         | –         | (0,01)    |
| Schlussnettoinventarwert  | 80,34     | 7,90      | 7,89      |
| Gesamtertrag  | (12,31 %) | (14,87 %) | (14,81 %) |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |        |        |
|--------------------------------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 1,22 % | 1,21 % | 1,21 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,68 % | 0,68 % | 0,68 % |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## China Bond

|   | Ausschüttende<br>Klasse<br>CNY A<br>(Monatlich)<br>CNY | Ausschüttende<br>Klasse<br>CNY I<br>CNY | Thesaurierende<br>Klasse<br>CNY Z<br>CNY | Ausschüttende<br>Klasse<br>SGD A<br>(Monatlich)<br>(nicht<br>währungs-<br>gesichert)<br>SGD | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I (nicht<br>währungs-<br>gesichert)<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z<br>US\$ |
|---|--|---|--|---|---|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |   |  |   |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 76,55  | 90,61                                   | 119,47                                   | 13,71   | 10,27   | 10,14                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |   |  |   |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,96   | 1,73                                    | 3,11                                     | 0,17  | 0,19  | 0,25                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 1,30   | 1,56                                    | 2,10                                     | 0,28  | (0,14)  | 0,51                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 2,26   | 3,29                                    | 5,21                                     | 0,45  | 0,05  | 0,76                                      |
| Ausschüttungen  | (2,29)   | (1,78)                                  | –  | (0,41)  | –   | –   |
| Schlussnettoinventarwert  | 76,52  | 92,12                                   | 124,68                                   | 13,75   | 10,32   | 10,90                                     |
| Gesamtertrag  | 3,01 %   | 3,68 %                                  | 4,36 %                                   | 3,35 %  | 0,49 %  | 7,50 %                                    |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |   |  |   |   |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,55 %   | 0,90 %                                  | 0,25 %                                   | 1,55 %  | 0,89 %  | 0,24 %                                    |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 1,25 %   | 1,90 %                                  | 2,56 %                                   | 1,27 %  | 1,84 %  | 2,42 %                                    |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |  |   |  |   |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 78,36  | 89,19                                   | 114,82                                   | 14,69   | 10,22   | 9,49                                      |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |   |  |   |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 1,15   | 1,93                                    | 3,28                                     | 0,21  | 0,22  | 0,27                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,94   | 1,08                                    | 1,37                                     | (0,47)  | (0,17)  | 0,38                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 2,09   | 3,01                                    | 4,65                                     | (0,26)  | 0,05  | 0,65                                      |
| Ausschüttungen  | (3,90)   | (1,59)                                  | –  | (0,72)  | –   | –   |
| Schlussnettoinventarwert  | 76,55  | 90,61                                   | 119,47                                   | 13,71   | 10,27   | 10,14                                     |
| Gesamtertrag  | 2,70 %   | 3,39 %                                  | 4,05 %                                   | (1,88 %)  | 0,49 %  | 6,85 %                                    |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |   |  |   |   |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,53 %   | 0,88 %                                  | 0,23 %                                   | 1,51 %  | 0,88 %  | 0,23 %                                    |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 1,49 %   | 2,14 %                                  | 2,79 %                                   | 1,46 %  | 2,14 %  | 2,77 %                                    |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

China Bond (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z (nicht<br>währungsgesichert)<br>US\$ |
|---|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 9,88   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,24   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | (0,11)   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,13   |
| Schlussnettoinventarwert  | 10,01  |
| Gesamtertrag  | 1,32 %   |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |
|--------------------------------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,24 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 2,44 % |

**31. Dezember 2023**

|   |        |
|---|--------|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 9,78   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |        |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,27   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | (0,17) |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,10   |
| Schlussnettoinventarwert  | 9,88   |
| Gesamtertrag  | 1,02 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |
|--------------------------------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,23 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 2,77 % |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## China Equity

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF I<br>CHF | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR Z<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>SGD A<br>SGD | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A<br>US\$ |
|---|--|--|--|--|--|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |  |  |  |  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 9,11                                     | 16,18                                  | 17,69                                  | 13,82                                  | 22,90                                    | 19,81                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |  |  |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,10                                     | 0,03                                   | 0,18                                   | 0,31                                   | 0,12                                     | 0,03                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 1,17                                     | 2,52                                   | 2,76                                   | 2,17                                   | 3,47                                     | 3,52                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,27                                     | 2,55                                   | 2,94                                   | 2,48                                   | 3,59                                     | 3,55                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 10,38                                    | 18,73                                  | 20,63                                  | 16,30                                  | 26,49                                    | 23,36                                     |
| Gesamtertrag  | 13,94 %                                  | 15,76 %                                | 16,62 %                                | 17,95 %                                | 15,68 %                                  | 17,92 %                                   |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |        |        |        |        |        |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 1,35 % | 2,15 % | 1,37 % | 0,21 % | 2,11 % | 2,06 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 1,06 % | 0,17 % | 0,95 % | 2,11 % | 0,49 % | 0,16 % |

**31. Dezember 2023**

|   |           |           |           |           |           |           |
|---|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 12,23     | 21,49     | 23,33     | 18,02     | 30,18     | 25,67     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |           |           |           |           |           |           |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,09      | 0,01      | 0,16      | 0,30      | 0,01      | 0,00      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | (3,21)    | (5,32)    | (5,80)    | (4,50)    | (7,29)    | (5,86)    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | (3,12)    | (5,31)    | (5,64)    | (4,20)    | (7,28)    | (5,86)    |
| Schlussnettoinventarwert  | 9,11      | 16,18     | 17,69     | 13,82     | 22,90     | 19,81     |
| Gesamtertrag  | (25,51 %) | (24,71 %) | (24,17 %) | (23,31 %) | (24,12 %) | (22,83 %) |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |        |        |        |        |        |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 1,21 % | 2,00 % | 1,27 % | 0,18 % | 2,01 % | 2,04 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,85 % | 0,07 % | 0,78 % | 1,86 % | 0,03 % | 0,01 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

China Equity (Fortsetzung)

|   | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD A<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I2<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD U<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z<br>US\$ |
|---|--|---|--|---|---|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |   |  |   |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 12,15                                    | 21,74                                     | 13,47                                      | 11,38                                     | 13,90                                     | 14,81                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |   |  |   |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,02                                     | 0,19                                      | 0,16                                       | (0,10)                                    | 0,09                                      | 0,32                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 2,14                                     | 3,89                                      | 2,40                                       | 2,00                                      | 2,46                                      | 2,65                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 2,16                                     | 4,08                                      | 2,56                                       | 1,90                                      | 2,55                                      | 2,97                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 14,31                                    | 25,82                                     | 16,03                                      | 13,28                                     | 16,45                                     | 17,78                                     |
| Gesamtertrag  | 17,81 %                                  | 18,77 %                                   | 19,01 %                                    | 16,70 %                                   | 18,35 %                                   | 20,05 %                                   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |   |  |   |   |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 2,06 %                                   | 1,31 %                                    | 1,09 %                                     | 3,05 %                                    | 1,66 %                                    | 0,21 %                                    |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 0,15 %                                   | 0,81 %                                    | 1,11 %                                     | (0,82 %)                                  | 0,61 %                                    | 2,00 %                                    |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |  |   |  |   |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 15,80                                    | 27,95                                     | 17,28                                      | 14,88                                     | 17,93                                     | 18,83                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |   |  |   |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,01                                     | 0,23                                      | 0,13                                       | (0,13)                                    | 0,08                                      | 0,32                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | (3,60)                                   | (6,44)                                    | (3,94)                                     | (3,37)                                    | (4,11)                                    | (4,34)                                    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | (3,59)                                   | (6,21)                                    | (3,81)                                     | (3,50)                                    | (4,03)                                    | (4,02)                                    |
| Ausschüttungen  | (0,06)                                   | –   | –  | –   | –   | –   |
| Schlussnettoinventarwert  | 12,15                                    | 21,74                                     | 13,47                                      | 11,38                                     | 13,90                                     | 14,81                                     |
| Gesamtertrag  | (22,81 %)                                | (22,22 %)                                 | (22,05 %)                                  | (23,52 %)                                 | (22,48 %)                                 | (21,35 %)                                 |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |   |  |   |   |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 2,05 %                                   | 1,29 %                                    | 1,08 %                                     | 3,03 %                                    | 1,64 %                                    | 0,19 %                                    |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 0,04 %                                   | 0,89 %                                    | 0,83 %                                     | (0,96 %)                                  | 0,50 %                                    | 1,88 %                                    |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Climate Innovation<sup>1</sup>

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I5<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z<br>US\$ |
|---|---|---|--|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |   |  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 9,66                                      | 9,70                                      | 9,71                                       | 9,73                                      |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |   |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,06)                                    | 0,03                                      | 0,07                                       | 0,12                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,38                                      | 0,37                                      | 0,39                                       | 0,38                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,32                                      | 0,40                                      | 0,46                                       | 0,50                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 9,98                                      | 10,10                                     | 10,17                                      | 10,23                                     |
| Gesamtertrag  | 3,31 %                                    | 4,12 %                                    | 4,74 %                                     | 5,14 %                                    |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |          |        |        |        |
|--------------------------------|----------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 1,91 %   | 1,06 % | 0,63 % | 0,22 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,57 %) | 0,27 % | 0,70 % | 1,12 % |

**31. Dezember 2023**

|   |          |          |          |          |
|---|----------|----------|----------|----------|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,00    | 10,00    | 10,00    | 10,00    |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |          |          |          |          |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,04)   | (0,01)   | 0,01     | 0,02     |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | (0,30)   | (0,29)   | (0,30)   | (0,29)   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | (0,34)   | (0,30)   | (0,29)   | (0,27)   |
| Schlussnettoinventarwert  | 9,66     | 9,70     | 9,71     | 9,73     |
| Gesamtertrag  | (3,40 %) | (3,00 %) | (2,90 %) | (2,70 %) |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |          |        |        |          |
|--------------------------------|----------|--------|--------|----------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 1,56 %   | 0,71 % | 0,28 % | (0,14 %) |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,74 %) | 0,11 % | 0,54 % | 0,96 %   |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

CLO Income

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I<br>€ | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I2<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR X*<br>€ | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR X*<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP Z<br>£ |
|---|--|--|--|---|--|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |  |  |   |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 11,44                                  | 12,20                                  | 8,52                                   | 10,00                                   | 10,00                                  | 13,09                                  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |  |   |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 1,04                                   | 1,24                                   | 0,84                                   | 0,75                                    | 0,27                                   | 1,41                                   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,64                                   | 0,65                                   | 0,44                                   | 0,26                                    | 0,10                                   | 0,79                                   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,68                                   | 1,89                                   | 1,28                                   | 1,01                                    | 0,37                                   | 2,20                                   |
| Ausschüttungen  | –                                      | –                                      | (0,77)                                 | –                                       | (0,08)                                 | –                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 13,12                                  | 14,09                                  | 9,03                                   | 11,01                                   | 10,29                                  | 15,29                                  |
| Gesamtertrag  | 14,69 %                                | 15,49 %                                | 15,58 %                                | 10,10 %                                 | 3,70 %                                 | 16,81 %                                |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |        |        |        |        |         |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|---------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 1,67 % | 0,89 % | 0,73 % | 0,51 % | 0,52 % | 0,10 %  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 8,17 % | 9,28 % | 9,51 % | 9,26 % | 8,69 % | 10,10 % |

**31. Dezember 2023**

|   |         |         |         |   |   |         |
|---|---------|---------|---------|---|---|---------|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 9,67    | 10,23   | 7,90    | – | – | 10,84   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |         |         |         |   |   |         |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 1,00    | 1,17    | 0,86    | – | – | 1,32    |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,77    | 0,80    | 0,58    | – | – | 0,93    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,77    | 1,97    | 1,44    | – | – | 2,25    |
| Ausschüttungen  | –       | –       | (0,82)  | – | – | –       |
| Schlussnettoinventarwert  | 11,44   | 12,20   | 8,52    | – | – | 13,09   |
| Gesamtertrag  | 18,30 % | 19,26 % | 19,33 % | – | – | 20,76 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |         |         |   |   |         |
|--------------------------------|--------|---------|---------|---|---|---------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 1,62 % | 0,90 %  | 0,74 %  | – | – | 0,16 %  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 9,66 % | 10,36 % | 10,65 % | – | – | 11,11 % |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## CLO Income (Fortsetzung)

|   | Ausschüttende<br>Klasse<br>JPY I* | Ausschüttende<br>Klasse<br>JPY I (nicht<br>währungs-<br>gesichert)* | Thesaurierende<br>Klasse<br>SEK I | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I |
|---|-----------------------------------|---|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|----------------------------------|
|   | ¥                                 | ¥   | SEK                               | US\$                              | US\$                              | US\$                             |
| <b>31. Dezember 2024</b>  |                                   |   |                                   |                                   |                                   |                                  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 1.000,00                          | 1.000,00  | 124,19                            | 11,87                             | 13,62                             | 10,42                            |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |                                   |   |                                   |                                   |                                   |                                  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 36,06                             | 36,51   | 12,77                             | 1,04                              | 1,31                              | 0,94                             |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | (7,11)                            | 63,31   | 6,31                              | 0,92                              | 1,06                              | 0,79                             |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 28,95                             | 99,82   | 19,08                             | 1,96                              | 2,37                              | 1,73                             |
| Ausschüttungen  | (17,85)                           | (17,36)   | –                                 | –                                 | –                                 | (1,00)                           |
| Schlussnettoinventarwert  | 1.011,10                          | 1.082,46  | 143,27                            | 13,83                             | 15,99                             | 11,15                            |
| Gesamtertrag  | 2,92 %                            | 10,08 %   | 15,36 %                           | 16,51 %                           | 17,40 %                           | 17,32 %                          |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |                                   |   |                                   |                                   |                                   |                                  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,89 %                            | 0,89 %  | 0,88 %                            | 1,59 %                            | 0,85 %                            | 0,87 %                           |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 8,65 %                            | 8,66 %  | 9,52 %                            | 7,81 %                            | 8,55 %                            | 8,66 %                           |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |                                   |   |                                   |                                   |                                   |                                  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | –                                 | –   | 104,04                            | 9,83                              | 11,19                             | 10,00                            |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |                                   |   |                                   |                                   |                                   |                                  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | –                                 | –   | 11,41                             | 1,06                              | 1,34                              | 0,41                             |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | –                                 | –   | 8,74                              | 0,98                              | 1,09                              | 0,18                             |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | –                                 | –   | 20,15                             | 2,04                              | 2,43                              | 0,59                             |
| Ausschüttungen  | –                                 | –   | –                                 | –                                 | –                                 | (0,17)                           |
| Schlussnettoinventarwert  | –                                 | –   | 124,19                            | 11,87                             | 13,62                             | 10,42                            |
| Gesamtertrag  | –                                 | –   | 19,37 %                           | 20,75 %                           | 21,72 %                           | 5,97 %                           |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |                                   |   |                                   |                                   |                                   |                                  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | –                                 | –   | 0,86 %                            | 1,65 %                            | 0,93 %                            | 0,97 %                           |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | –                                 | –   | 10,11 %                           | 9,86 %                            | 10,59 %                           | 10,86 %                          |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

CLO Income (Fortsetzung)

|   | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I2<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I4*<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I5<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD U*<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z<br>US\$ |
|---|---|---|---|--|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |   |   |  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 9,99                                      | 10,00                                       | 9,51                                      | 10,00                                      | 14,15                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |   |   |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,93                                      | 0,64  | 0,94                                      | 0,15                                       | 1,50                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,74                                      | 0,37  | 0,67                                      | 0,09                                       | 1,09                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,67                                      | 1,01  | 1,61                                      | 0,24                                       | 2,59                                      |
| Ausschüttungen  | (0,96)                                    | –   | (0,93)                                    | –  | –   |
| Schlussnettoinventarwert  | 10,70                                     | 11,01                                       | 10,19                                     | 10,24                                      | 16,74                                     |
| Gesamtertrag  | 17,49 %                                   | 10,10 %                                     | 17,77 %                                   | 2,40 %                                     | 18,30 %                                   |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |        |        |        |        |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,71 % | 0,54 % | 0,49 % | 1,28 % | 0,11 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 8,89 % | 8,84 % | 9,51 % | 7,72 % | 9,38 % |

**31. Dezember 2023**

|   |         |   |         |   |         |
|---|---------|---|---------|---|---------|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 9,09    | – | 8,65    | – | 11,53   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |         |   |         |   |         |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 1,02    | – | 0,99    | – | 1,45    |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,84    | – | 0,80    | – | 1,17    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,86    | – | 1,79    | – | 2,62    |
| Ausschüttungen  | (0,96)  | – | (0,93)  | – | –       |
| Schlussnettoinventarwert  | 9,99    | – | 9,51    | – | 14,15   |
| Gesamtertrag  | 21,73 % | – | 22,04 % | – | 22,72 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |         |   |         |   |         |
|--------------------------------|---------|---|---------|---|---------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,76 %  | – | 0,53 %  | – | 0,16 %  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 10,80 % | – | 11,07 % | – | 11,40 % |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Commodities

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I (nicht<br>währungs-<br>gesichert)<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I2*<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I3 (nicht<br>währungs-<br>gesichert)*<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I5<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP P*<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A<br>US\$ |
|---|--|--|--|---|---|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |  |  |   |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 9,20   | 10,00                                    | 10,00  | 8,74                                    | 10,00                                   | 9,00                                      |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |  |   |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,28   | 0,02                                     | 0,14   | 0,29                                    | 0,14                                    | 0,20                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,48   | 0,06                                     | 0,60   | 0,26                                    | 0,55                                    | 0,30                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,76   | 0,08                                     | 0,74   | 0,55                                    | 0,69                                    | 0,50                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 9,96   | 10,08                                    | 10,74  | 9,29                                    | 10,69                                   | 9,50                                      |
| Gesamtertrag  | 8,26 %   | 0,80 %                                   | 7,40 %   | 6,29 %                                  | 6,90 %                                  | 5,56 %                                    |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |  |   |   |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,83 %   | 0,74 %                                   | 0,69 %   | 0,50 %                                  | 0,80 %                                  | 1,56 %                                    |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 2,91 %   | 2,56 %                                   | 3,38 %   | 3,17 %                                  | 3,31 %                                  | 2,15 %                                    |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |  |  |  |   |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,43  | –  | –  | 9,42                                    | –                                       | 9,71                                      |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |  |   |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,22   | –  | –  | 0,20                                    | –                                       | 0,10                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | (1,45)   | –  | –  | (0,88)                                  | –                                       | (0,81)                                    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | (1,23)   | –  | –  | (0,68)                                  | –                                       | (0,71)                                    |
| Schlussnettoinventarwert  | 9,20   | –  | –  | 8,74                                    | –                                       | 9,00                                      |
| Gesamtertrag  | (11,79 %)  | –  | –  | (7,22 %)                                | –                                       | (7,31 %)                                  |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |  |   |   |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,85 %   | –  | –  | 0,53 %                                  | –                                       | 1,61 %                                    |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 2,27 %   | –  | –  | 2,26 %                                  | –                                       | 1,10 %                                    |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Commodities (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I3*<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I5<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z<br>US\$ |
|---|---|---|--|---|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |   |  |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,47                                     | 10,00                                       | 9,17                                       | 8,21                                      | 10,65                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |   |  |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,31                                      | 0,03  | 0,29                                       | 0,13                                      | 0,39                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,35                                      | 0,08  | 0,32                                       | 0,28                                      | 0,35                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,66                                      | 0,11  | 0,61                                       | 0,41                                      | 0,74                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 11,13                                     | 10,11                                       | 9,78                                       | 8,62                                      | 11,39                                     |
| Gesamtertrag  | 6,30 %                                    | 1,10 %                                      | 6,65 %                                     | 4,99 %                                    | 6,95 %                                    |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |        |        |        |        |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,82 % | 0,64 % | 0,50 % | 2,16 % | 0,17 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 2,82 % | 3,20 % | 3,04 % | 1,54 % | 3,52 % |

**31. Dezember 2023**

|   |          |   |          |          |          |
|---|----------|---|----------|----------|----------|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 11,20    | – | 9,78     | 8,91     | 11,32    |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |          |   |          |          |          |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,22     | – | 0,21     | 0,05     | 0,28     |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | (0,95)   | – | (0,82)   | (0,75)   | (0,95)   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | (0,73)   | – | (0,61)   | (0,70)   | (0,67)   |
| Schlussnettoinventarwert  | 10,47    | – | 9,17     | 8,21     | 10,65    |
| Gesamtertrag  | (6,52 %) | – | (6,24 %) | (7,86 %) | (5,92 %) |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |   |        |        |        |
|--------------------------------|--------|---|--------|--------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,86 % | – | 0,54 % | 2,22 % | 0,21 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 2,04 % | – | 2,22 % | 0,54 % | 2,54 % |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Corporate Hybrid Bond

|   | Ausschüttende<br>Klasse<br>AUD A<br>(Monatlich)<br>AUD | Ausschüttende<br>Klasse<br>CHF A*<br>CHF | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF I3*<br>CHF | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF P<br>CHF | Ausschüttende<br>Klasse<br>CHF P<br>CHF | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR A<br>(Monatlich)<br>€ |
|---|--|--|--|--|---|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |  |  |  |   |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 8,02   | 10,00                                    | 10,00                                      | 10,24                                    | 9,00                                    | 8,09   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |  |  |   |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,29   | 0,31                                     | 0,23                                       | 0,43                                     | 0,38                                    | 0,29   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,41   | 0,17                                     | 0,14                                       | 0,22                                     | 0,18                                    | 0,37   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,70   | 0,48                                     | 0,37                                       | 0,65                                     | 0,56                                    | 0,66   |
| Ausschüttungen  | (0,53)   | (0,23)                                   | –  | –  | (0,37)                                  | (0,45)   |
| Schlussnettoinventarwert  | 8,19   | 10,25                                    | 10,37                                      | 10,89                                    | 9,19                                    | 8,30   |
| Gesamtertrag  | 9,08 %   | 4,80 %                                   | 3,70 %                                     | 6,35 %                                   | 6,42 %                                  | 8,41 %   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |  |  |   |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,30 %   | 1,26 %                                   | 0,49 %                                     | 0,64 %                                   | 0,63 %                                  | 1,28 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 3,63 %   | 3,51 %                                   | 4,28 %                                     | 4,11 %                                   | 4,13 %                                  | 3,56 %   |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |  |  |  |  |   |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 7,88   | –  | –  | 9,64                                     | 8,79                                    | 7,91   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |  |  |   |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,24   | –  | –  | 0,33                                     | 0,31                                    | 0,25   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,38   | –  | –  | 0,27                                     | 0,21                                    | 0,33   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,62   | –  | –  | 0,60                                     | 0,52                                    | 0,58   |
| Ausschüttungen  | (0,48)   | –  | –  | –  | (0,31)                                  | (0,40)   |
| Schlussnettoinventarwert  | 8,02   | –  | –  | 10,24                                    | 9,00                                    | 8,09   |
| Gesamtertrag  | 8,14 %   | –  | –  | 6,22 %                                   | 6,09 %                                  | 7,57 %   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |  |  |   |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,29 %   | –  | –  | 0,64 %                                   | 0,64 %                                  | 1,30 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 3,10 %   | –  | –  | 3,36 %                                   | 3,59 %                                  | 3,11 %   |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I<br>€ | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I2<br>€ | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I2<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I3<br>€ |
|---|--|--|---------------------------------------|---|--|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |  |                                       |   |  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 11,14                                  | 11,96                                  | 9,38                                  | 11,04                                   | 8,55                                   | 11,16                                   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |                                       |   |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,41                                   | 0,52                                   | 0,40                                  | 0,49                                    | 0,37                                   | 0,52                                    |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,53                                   | 0,56                                   | 0,43                                  | 0,53                                    | 0,40                                   | 0,52                                    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,94                                   | 1,08                                   | 0,83                                  | 1,02                                    | 0,77                                   | 1,04                                    |
| Ausschüttungen  | –                                      | –                                      | (0,39)                                | –                                       | (0,37)                                 | –                                       |
| Schlussnettoinventarwert  | 12,08                                  | 13,04                                  | 9,82                                  | 12,06                                   | 8,95                                   | 12,20                                   |
| Gesamtertrag  | 8,44 %                                 | 9,03 %                                 | 9,08 %                                | 9,24 %                                  | 9,19 %                                 | 9,32 %                                  |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |                                       |   |  |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,28 %                                 | 0,68 %                                 | 0,68 %                                | 0,56 %                                  | 0,56 %                                 | 0,50 %                                  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 3,56 %                                 | 4,15 %                                 | 4,16 %                                | 4,27 %                                  | 4,27 %                                 | 4,36 %                                  |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |  |  |                                       |   |  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,36                                  | 11,06                                  | 8,98                                  | 10,20                                   | 8,19                                   | 10,30                                   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |                                       |   |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,33                                   | 0,43                                   | 0,34                                  | 0,41                                    | 0,30                                   | 0,41                                    |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,45                                   | 0,47                                   | 0,37                                  | 0,43                                    | 0,36                                   | 0,45                                    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,78                                   | 0,90                                   | 0,71                                  | 0,84                                    | 0,66                                   | 0,86                                    |
| Ausschüttungen  | –                                      | –                                      | (0,31)                                | –                                       | (0,30)                                 | –                                       |
| Schlussnettoinventarwert  | 11,14                                  | 11,96                                  | 9,38                                  | 11,04                                   | 8,55                                   | 11,16                                   |
| Gesamtertrag  | 7,53 %                                 | 8,14 %                                 | 8,17 %                                | 8,24 %                                  | 8,24 %                                 | 8,35 %                                  |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |                                       |   |  |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,30 %                                 | 0,70 %                                 | 0,70 %                                | 0,58 %                                  | 0,58 %                                 | 0,52 %                                  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 3,12 %                                 | 3,74 %                                 | 3,76 %                                | 3,87 %                                  | 3,67 %                                 | 3,84 %                                  |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I5<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M<br>€ | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR M<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR P<br>€ | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR P<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I<br>£ |
|---|---|--|---------------------------------------|--|---------------------------------------|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |  |                                       |  |                                       |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 12,26                                   | 11,62                                  | 7,80                                  | 10,65                                  | 9,41                                  | 11,58                                  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |                                       |  |                                       |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,57                                    | 0,36                                   | 0,23                                  | 0,47                                   | 0,40                                  | 0,50                                   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,58                                    | 0,55                                   | 0,36                                  | 0,50                                   | 0,44                                  | 0,73                                   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,15                                    | 0,91                                   | 0,59                                  | 0,97                                   | 0,84                                  | 1,23                                   |
| Ausschüttungen  | –                                       | –                                      | (0,38)                                | –                                      | (0,40)                                | –                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 13,41                                   | 12,53                                  | 8,01                                  | 11,62                                  | 9,85                                  | 12,81                                  |
| Gesamtertrag  | 9,38 %                                  | 7,83 %                                 | 7,74 %                                | 9,11 %                                 | 9,10 %                                | 10,62 %                                |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |  |                                       |  |                                       |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,38 %                                  | 1,88 %                                 | 1,88 %                                | 0,65 %                                 | 0,65 %                                | 0,66 %                                 |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 4,45 %                                  | 2,96 %                                 | 2,96 %                                | 4,18 %                                 | 4,17 %                                | 4,08 %                                 |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |   |  |                                       |  |                                       |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 11,30                                   | 10,88                                  | 7,61                                  | 9,84                                   | 9,02                                  | 10,54                                  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |                                       |  |                                       |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,46                                    | 0,28                                   | 0,19                                  | 0,36                                   | 0,36                                  | 0,39                                   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,50                                    | 0,46                                   | 0,32                                  | 0,45                                   | 0,35                                  | 0,65                                   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,96                                    | 0,74                                   | 0,51                                  | 0,81                                   | 0,71                                  | 1,04                                   |
| Ausschüttungen  | –                                       | –                                      | (0,32)                                | –                                      | (0,32)                                | –                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 12,26                                   | 11,62                                  | 7,80                                  | 10,65                                  | 9,41                                  | 11,58                                  |
| Gesamtertrag  | 8,50 %                                  | 6,80 %                                 | 6,90 %                                | 8,23 %                                 | 8,07 %                                | 9,87 %                                 |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |  |                                       |  |                                       |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,40 %                                  | 1,90 %                                 | 1,90 %                                | 0,67 %                                 | 0,67 %                                | 0,69 %                                 |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 3,94 %                                  | 2,50 %                                 | 2,49 %                                | 3,58 %                                 | 4,00 %                                | 3,61 %                                 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I2<br>£ | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP I2<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP P<br>£ | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP P<br>£ | Ausschüttende<br>Klasse<br>SGD A<br>(Monatlich)<br>SGD | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD A<br>(Monatlich)<br>US\$ |
|---|---|--|--|---------------------------------------|--|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |  |  |                                       |  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 11,42                                   | 9,64                                   | 10,42                                  | 9,32                                  | 16,40  | 8,49  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |  |                                       |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,50                                    | 0,43                                   | 0,46                                   | 0,39                                  | 0,58   | 0,29  |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,73                                    | 0,59                                   | 0,65                                   | 0,58                                  | 0,73   | 0,55  |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,23                                    | 1,02                                   | 1,11                                   | 0,97                                  | 1,31   | 0,84  |
| Ausschüttungen  | –                                       | (0,41)                                 | –                                      | (0,39)                                | (0,91)   | (0,62)  |
| Schlussnettoinventarwert  | 12,65                                   | 10,25                                  | 11,53                                  | 9,90                                  | 16,80  | 8,71  |
| Gesamtertrag  | 10,77 %                                 | 10,89 %                                | 10,65 %                                | 10,67 %                               | 8,24 %   | 10,23 %   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |  |  |                                       |  |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,55 %                                  | 0,56 %                                 | 0,63 %                                 | 0,63 %                                | 1,25 %   | 1,22 %  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 4,16 %                                  | 4,27 %                                 | 4,11 %                                 | 4,06 %                                | 3,50 %   | 3,41 %  |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |   |  |  |                                       |  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,38                                   | 9,09                                   | 9,48                                   | 8,78                                  | 16,07  | 8,26  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |  |                                       |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,39                                    | 0,33                                   | 0,35                                   | 0,33                                  | 0,50   | 0,26  |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,65                                    | 0,55                                   | 0,59                                   | 0,52                                  | 0,79   | 0,51  |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,04                                    | 0,88                                   | 0,94                                   | 0,85                                  | 1,29   | 0,77  |
| Ausschüttungen  | –                                       | (0,33)                                 | –                                      | (0,31)                                | (0,96)   | (0,54)  |
| Schlussnettoinventarwert  | 11,42                                   | 9,64                                   | 10,42                                  | 9,32                                  | 16,40  | 8,49  |
| Gesamtertrag  | 10,02 %                                 | 9,95 %                                 | 9,92 %                                 | 9,96 %                                | 8,32 %   | 9,73 %  |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |  |  |                                       |  |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,58 %                                  | 0,57 %                                 | 0,67 %                                 | 0,67 %                                | 1,31 %   | 1,33 %  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 3,66 %                                  | 3,54 %                                 | 3,56 %                                 | 3,71 %                                | 3,13 %   | 3,16 %  |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD A<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD C1<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I<br>(Monatlich)<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ |
|--|---|--|--|---|---|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>   |   |  |  |   |   |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert  | 12,27                                     | 8,99                                     | 10,50                                      | 10,00   | 13,63                                     | 9,01                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:  |   |  |  |   |   |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>  | 0,44                                      | 0,32                                     | 0,27                                       | 0,12  | 0,58                                      | 0,39                                     |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,81                                      | 0,58                                     | 0,68                                       | 0,11  | 0,91                                      | 0,57                                     |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit   | 1,25                                      | 0,90                                     | 0,95                                       | 0,23  | 1,49                                      | 0,96                                     |
| Ausschüttungen   | –   | (0,32)                                   | –  | (0,14)  | –   | (0,38)                                   |
| Schlussnettoinventarwert   | 13,52                                     | 9,57                                     | 11,45                                      | 10,09   | 15,12                                     | 9,59                                     |
| Gesamtertrag   | 10,19 %                                   | 10,27 %                                  | 9,05 %                                     | 2,26 %  | 10,93 %                                   | 10,92 %                                  |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>   |   |  |  |   |   |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>   | 1,22 %                                    | 1,22 %                                   | 2,18 %                                     | 0,68 %  | 0,65 %                                    | 0,66 %                                   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)   | 3,40 %                                    | 3,42 %                                   | 2,43 %                                     | 4,33 %  | 3,99 %                                    | 4,12 %                                   |
| <b>31. Dezember 2023</b>   |   |  |  |   |   |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert  | 11,18                                     | 8,44                                     | 9,66                                       | –   | 12,35                                     | 8,45                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:  |   |  |  |   |   |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>  | 0,37                                      | 0,27                                     | 0,21                                       | –   | 0,49                                      | 0,32                                     |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,72                                      | 0,53                                     | 0,63                                       | –   | 0,79                                      | 0,54                                     |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit   | 1,09                                      | 0,80                                     | 0,84                                       | –   | 1,28                                      | 0,86                                     |
| Ausschüttungen   | –   | (0,25)                                   | –  | –   | –   | (0,30)                                   |
| Schlussnettoinventarwert   | 12,27                                     | 8,99                                     | 10,50                                      | –   | 13,63                                     | 9,01                                     |
| Gesamtertrag   | 9,75 %                                    | 9,67 %                                   | 8,70 %                                     | –   | 10,36 %                                   | 10,44 %                                  |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>   |   |  |  |   |   |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>   | 1,33 %                                    | 1,32 %                                   | 2,35 %                                     | –   | 0,71 %                                    | 0,72 %                                   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)   | 3,18 %                                    | 3,19 %                                   | 2,08 %                                     | –   | 3,78 %                                    | 3,73 %                                   |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I2<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I2<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD M<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD P<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z<br>US\$ |
|---|--|---|---|--|---|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |   |   |  |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 12,74                                      | 10,31                                     | 10,76                                     | 8,60                                     | 12,14                                     | 13,15                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |   |   |  |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,56                                       | 0,44                                      | 0,32                                      | 0,25                                     | 0,51                                      | 0,63                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,84                                       | 0,67                                      | 0,71                                      | 0,55                                     | 0,82                                      | 0,89                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,40                                       | 1,11                                      | 1,03                                      | 0,80                                     | 1,33                                      | 1,52                                      |
| Ausschüttungen  | –  | (0,45)                                    | –   | (0,42)                                   | –   | –   |
| Schlussnettoinventarwert  | 14,14                                      | 10,97                                     | 11,79                                     | 8,98                                     | 13,47                                     | 14,67                                     |
| Gesamtertrag  | 10,99 %                                    | 11,01 %                                   | 9,57 %                                    | 9,57 %                                   | 10,96 %                                   | 11,56 %                                   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |   |   |  |   |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,53 %                                     | 0,54 %                                    | 1,80 %                                    | 1,80 %                                   | 0,62 %                                    | 0,08 %                                    |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 4,11 %                                     | 4,15 %                                    | 2,83 %                                    | 2,82 %                                   | 4,00 %                                    | 4,54 %                                    |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |  |   |   |  |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 11,52                                      | 9,68                                      | 9,86                                      | 8,23                                     | 11,00                                     | 11,84                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |   |   |  |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,47                                       | 0,39                                      | 0,26                                      | 0,21                                     | 0,43                                      | 0,54                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,75                                       | 0,59                                      | 0,64                                      | 0,51                                     | 0,71                                      | 0,77                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,22                                       | 0,98                                      | 0,90                                      | 0,72                                     | 1,14                                      | 1,31                                      |
| Ausschüttungen  | –  | (0,35)                                    | –   | (0,35)                                   | –   | –   |
| Schlussnettoinventarwert  | 12,74                                      | 10,31                                     | 10,76                                     | 8,60                                     | 12,14                                     | 13,15                                     |
| Gesamtertrag  | 10,59 %                                    | 10,45 %                                   | 9,13 %                                    | 9,01 %                                   | 10,36 %                                   | 11,06 %                                   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |   |   |  |   |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,59 %                                     | 0,59 %                                    | 1,94 %                                    | 1,94 %                                   | 0,69 %                                    | 0,10 %                                    |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 3,89 %                                     | 3,91 %                                    | 2,54 %                                    | 2,55 %                                   | 3,74 %                                    | 4,41 %                                    |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Developed Market FMP – 2027<sup>1</sup>

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A<br>€ | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD A<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ |
|---|--|---------------------------------------|---|--|---|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |                                       |   |  |   |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,31                                  | 10,38                                 | 10,38                                     | 10,38                                    | 10,40                                     | 10,48                                    |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |                                       |   |  |   |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,37                                   | 0,41                                  | 0,36                                      | 0,35                                     | 0,40                                      | 0,39                                     |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | (0,06)                                 | (0,07)                                | 0,14                                      | 0,14                                     | 0,13                                      | 0,14                                     |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,31                                   | 0,34                                  | 0,50                                      | 0,49                                     | 0,53                                      | 0,53                                     |
| Ausschüttungen  | –                                      | (0,40)                                | –   | (0,41)                                   | –   | (0,44)                                   |
| Schlussnettoinventarwert  | 10,62                                  | 10,32                                 | 10,88                                     | 10,46                                    | 10,93                                     | 10,57                                    |
| Gesamtertrag  | 3,01 %                                 | 3,41 %                                | 4,82 %                                    | 4,84 %                                   | 5,10 %                                    | 5,19 %                                   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |                                       |   |  |   |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,85 %                                 | 0,48 %                                | 0,81 %                                    | 0,81 %                                   | 0,46 %                                    | 0,46 %                                   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 3,59 %                                 | 3,95 %                                | 3,43 %                                    | 3,43 %                                   | 3,78 %                                    | 3,78 %                                   |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |  |                                       |   |  |   |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,00                                  | 10,00                                 | 10,00                                     | 10,00                                    | 10,00                                     | 10,00                                    |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |                                       |   |  |   |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,14                                   | 0,11                                  | 0,15                                      | 0,15                                     | 0,16                                      | 0,14                                     |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,17                                   | 0,27                                  | 0,23                                      | 0,23                                     | 0,24                                      | 0,34                                     |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,31                                   | 0,38                                  | 0,38                                      | 0,38                                     | 0,40                                      | 0,48                                     |
| Schlussnettoinventarwert  | 10,31                                  | 10,38                                 | 10,38                                     | 10,38                                    | 10,40                                     | 10,48                                    |
| Gesamtertrag  | 3,10 %                                 | 3,80 %                                | 3,80 %                                    | 3,80 %                                   | 4,00 %                                    | 4,80 %                                   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |                                       |   |  |   |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,77 %                                 | 0,39 %                                | 0,78 %                                    | 0,79 %                                   | 0,44 %                                    | 0,41 %                                   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 3,40 %                                 | 3,89 %                                | 3,54 %                                    | 3,51 %                                   | 3,81 %                                    | 3,95 %                                   |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Developed Market FMP – 2027<sup>1</sup> (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD X<br>US\$ |
|---|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,39                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,39                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,14                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,53                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 10,92                                     |
| Gesamtertrag  | 5,10 %                                    |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |
|--------------------------------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,56 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,68 % |

**31. Dezember 2023**

|   |        |
|---|--------|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,00  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |        |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,16   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,23   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,39   |
| Schlussnettoinventarwert  | 10,39  |
| Gesamtertrag  | 3,90 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |
|--------------------------------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,53 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,81 % |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## EMD Corporate – Social and Environmental Transition

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF I<br>CHF | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I3<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M<br>€ | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR M<br>€ |
|---|--|--|--|---|--|---------------------------------------|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |  |  |   |  |                                       |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 11,37                                    | 10,41                                  | 12,07                                  | 10,33                                   | 9,88                                   | 6,56                                  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |  |   |  |                                       |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,57                                     | 0,43                                   | 0,59                                   | 0,56                                    | 0,33                                   | 0,21                                  |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | (0,12)                                   | 0,17                                   | 0,21                                   | 0,17                                    | 0,17                                   | 0,11                                  |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,45                                     | 0,60                                   | 0,80                                   | 0,73                                    | 0,50                                   | 0,32                                  |
| Ausschüttungen  | –  | –                                      | –                                      | –                                       | –                                      | (0,36)                                |
| Schlussnettoinventarwert  | 11,82                                    | 11,01                                  | 12,87                                  | 11,06                                   | 10,38                                  | 6,52                                  |
| Gesamtertrag  | 3,96 %                                   | 5,76 %                                 | 6,63 %                                 | 7,07 %                                  | 5,06 %                                 | 4,99 %                                |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |  |   |  |                                       |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,05 %                                   | 1,90 %                                 | 1,07 %                                 | 0,73 %                                  | 2,73 %                                 | 2,73 %                                |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 4,85 %                                   | 4,04 %                                 | 4,81 %                                 | 5,23 %                                  | 3,22 %                                 | 3,23 %                                |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |  |  |  |   |  |                                       |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,96                                    | 9,94                                   | 11,42                                  | 9,75                                    | 9,51                                   | 6,66                                  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |  |   |  |                                       |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,44                                     | 0,34                                   | 0,48                                   | 0,44                                    | 0,25                                   | 0,17                                  |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | (0,03)                                   | 0,13                                   | 0,17                                   | 0,14                                    | 0,12                                   | 0,07                                  |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,41                                     | 0,47                                   | 0,65                                   | 0,58                                    | 0,37                                   | 0,24                                  |
| Ausschüttungen  | –  | –                                      | –                                      | –                                       | –                                      | (0,34)                                |
| Schlussnettoinventarwert  | 11,37                                    | 10,41                                  | 12,07                                  | 10,33                                   | 9,88                                   | 6,56                                  |
| Gesamtertrag  | 3,74 %                                   | 4,73 %                                 | 5,69 %                                 | 5,95 %                                  | 3,89 %                                 | 3,81 %                                |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |  |   |  |                                       |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,95 %                                   | 1,78 %                                 | 0,99 %                                 | 0,68 %                                  | 2,56 %                                 | 2,56 %                                |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 3,95 %                                   | 3,36 %                                 | 4,14 %                                 | 4,44 %                                  | 2,57 %                                 | 2,57 %                                |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

EMD Corporate – Social and Environmental Transition (Fortsetzung)

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR X<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>SEK A<br>SEK | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD A<br>(Monatlich)<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD C1<br>US\$ |
|--|--|--|--|---|---|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>   |  |  |  |   |   |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert  | 10,99                                  | 13,25                                  | 91,82                                    | 7,40  | 13,10                                     | 9,88                                       |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:  |  |  |  |   |   |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>  | 0,63                                   | 0,66                                   | 3,84                                     | 0,29  | 0,53                                      | 0,29                                       |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,16                                   | 0,43                                   | 1,28                                     | 0,25  | 0,48                                      | 0,36                                       |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit   | 0,79                                   | 1,09                                   | 5,12                                     | 0,54  | 1,01                                      | 0,65                                       |
| Ausschüttungen   | –                                      | –                                      | –  | (0,57)  | –   | –  |
| Schlussnettoinventarwert   | 11,78                                  | 14,34                                  | 96,94                                    | 7,37  | 14,11                                     | 10,53                                      |
| Gesamtertrag   | 7,19 %                                 | 8,23 %                                 | 5,58 %                                   | 7,64 %  | 7,71 %                                    | 6,58 %                                     |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>   |  |  |  |   |   |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>   | 0,50 %                                 | 1,04 %                                 | 1,90 %                                   | 1,82 %  | 1,82 %                                    | 2,81 %                                     |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)   | 5,46 %                                 | 4,78 %                                 | 4,05 %                                   | 3,89 %  | 3,90 %                                    | 2,87 %                                     |
| <b>31. Dezember 2023</b>   |  |  |  |   |   |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert  | 10,36                                  | 12,35                                  | 87,48                                    | 7,32  | 12,24                                     | 9,32                                       |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:  |  |  |  |   |   |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>  | 0,48                                   | 0,52                                   | 2,88                                     | 0,25  | 0,43                                      | 0,23                                       |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,15                                   | 0,38                                   | 1,46                                     | 0,24  | 0,43                                      | 0,33                                       |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit   | 0,63                                   | 0,90                                   | 4,34                                     | 0,49  | 0,86                                      | 0,56                                       |
| Ausschüttungen   | –                                      | –                                      | –  | (0,41)  | –   | –  |
| Schlussnettoinventarwert   | 10,99                                  | 13,25                                  | 91,82                                    | 7,40  | 13,10                                     | 9,88                                       |
| Gesamtertrag   | 6,08 %                                 | 7,29 %                                 | 4,96 %                                   | 6,95 %  | 7,03 %                                    | 6,01 %                                     |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>   |  |  |  |   |   |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>   | 0,58 %                                 | 0,99 %                                 | 1,73 %                                   | 1,81 %  | 1,81 %                                    | 2,82 %                                     |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)   | 4,54 %                                 | 4,11 %                                 | 3,26 %                                   | 3,42 %  | 3,42 %                                    | 2,42 %                                     |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## EMD Corporate – Social and Environmental Transition (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I2<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD M<br>US\$ |
|---|---|--|--|---|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |  |  |   |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 14,24                                     | 9,07                                     | 12,89                                      | 9,95                                      | 7,24                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |  |   |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,69                                      | 0,43                                     | 0,65                                       | 0,32                                      | 0,22                                     |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,52                                      | 0,33                                     | 0,48                                       | 0,36                                      | 0,26                                     |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,21                                      | 0,76                                     | 1,13                                       | 0,68                                      | 0,48                                     |
| Ausschüttungen  | –   | (0,41)                                   | –  | –   | (0,40)                                   |
| Schlussnettoinventarwert  | 15,45                                     | 9,42                                     | 14,02                                      | 10,63                                     | 7,32                                     |
| Gesamtertrag  | 8,50 %                                    | 8,60 %                                   | 8,77 %                                     | 6,83 %                                    | 6,82 %                                   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |  |  |   |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,02 %                                    | 1,01 %                                   | 0,85 %                                     | 2,61 %                                    | 2,61 %                                   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 4,66 %                                    | 4,68 %                                   | 4,84 %                                     | 3,08 %                                    | 3,07 %                                   |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |   |  |  |   |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 13,20                                     | 8,77                                     | 11,93                                      | 9,38                                      | 7,19                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |  |   |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,57                                      | 0,37                                     | 0,53                                       | 0,25                                      | 0,19                                     |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,47                                      | 0,30                                     | 0,43                                       | 0,32                                      | 0,23                                     |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,04                                      | 0,67                                     | 0,96                                       | 0,57                                      | 0,42                                     |
| Ausschüttungen  | –   | (0,37)                                   | –  | –   | (0,37)                                   |
| Schlussnettoinventarwert  | 14,24                                     | 9,07                                     | 12,89                                      | 9,95                                      | 7,24                                     |
| Gesamtertrag  | 7,88 %                                    | 7,90 %                                   | 8,05 %                                     | 6,08 %                                    | 6,16 %                                   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |  |  |   |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,01 %                                    | 1,02 %                                   | 0,85 %                                     | 2,60 %                                    | 2,62 %                                   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 4,23 %                                    | 4,23 %                                   | 4,37 %                                     | 2,60 %                                    | 2,62 %                                   |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Hard Currency

|   | Ausschüttende<br>Klasse<br>AUD A<br>(Monatlich)<br>AUD | Ausschüttende<br>Klasse<br>AUD I<br>AUD | Thesaurierende<br>Klasse<br>CAD I3 (nicht<br>währungs-<br>gesichert)<br>CAD | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF I2<br>CHF | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF P<br>CHF | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR A<br>(Monatlich)<br>€ |
|---|--|---|---|---|--|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |   |   |   |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 7,08   | 8,31                                    | 12,26   | 8,45                                      | 8,51                                     | 6,33   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |   |   |   |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,35   | 0,46                                    | 0,79  | 0,49                                      | 0,48                                     | 0,30   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,38   | 0,49                                    | 2,11  | 0,23                                      | 0,23                                     | 0,33   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,73   | 0,95                                    | 2,90  | 0,72                                      | 0,71                                     | 0,63   |
| Ausschüttungen  | (0,57)   | (0,39)                                  | –   | –   | –  | (0,51)   |
| Schlussnettoinventarwert  | 7,24   | 8,87                                    | 15,16   | 9,17                                      | 9,22                                     | 6,45   |
| Gesamtertrag  | 10,81 %  | 11,80 %                                 | 23,65 %   | 8,52 %                                    | 8,34 %                                   | 10,42 %  |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |   |   |   |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,59 %   | 0,87 %                                  | 0,61 %  | 0,67 %                                    | 0,78 %                                   | 1,56 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 4,89 %   | 5,50 %                                  | 5,79 %  | 5,60 %                                    | 5,45 %                                   | 4,78 %   |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |  |   |   |   |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 6,88   | 7,81                                    | 11,04   | 7,73                                      | 7,79                                     | 6,20   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |   |   |   |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,28   | 0,38                                    | 0,57  | 0,37                                      | 0,37                                     | 0,25   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,45   | 0,52                                    | 0,65  | 0,35                                      | 0,35                                     | 0,35   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,73   | 0,90                                    | 1,22  | 0,72                                      | 0,72                                     | 0,60   |
| Ausschüttungen  | (0,53)   | (0,40)                                  | –   | –   | –  | (0,47)   |
| Schlussnettoinventarwert  | 7,08   | 8,31                                    | 12,26   | 8,45                                      | 8,51                                     | 6,33   |
| Gesamtertrag  | 11,27 %  | 12,11 %                                 | 11,05 %   | 9,31 %                                    | 9,24 %                                   | 10,37 %  |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |   |   |   |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,47 %   | 0,79 %                                  | 0,58 %  | 0,62 %                                    | 0,72 %                                   | 1,47 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 4,11 %   | 4,83 %                                  | 4,97 %  | 4,72 %                                    | 4,61 %                                   | 4,09 %   |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I (nicht<br>währungs-<br>gesichert)<br>€ | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I2<br>€ | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I2<br>€ |
|---|--|--|--|---------------------------------------|---|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |  |  |                                       |   |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,53                                  | 11,46                                  | 9,70   | 6,86                                  | 8,77                                    | 7,36                                   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |  |                                       |   |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,53                                   | 0,67                                   | 0,59   | 0,39                                  | 0,51                                    | 0,43                                   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,56                                   | 0,61                                   | 1,44   | 0,35                                  | 0,47                                    | 0,38                                   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,09                                   | 1,28                                   | 2,03   | 0,74                                  | 0,98                                    | 0,81                                   |
| Ausschüttungen  | –                                      | –                                      | –  | (0,33)                                | –                                       | (0,37)                                 |
| Schlussnettoinventarwert  | 11,62                                  | 12,74                                  | 11,73  | 7,27                                  | 9,75                                    | 7,80                                   |
| Gesamtertrag  | 10,35 %                                | 11,17 %                                | 20,93 %  | 11,12 %                               | 11,17 %                                 | 11,27 %                                |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |  |                                       |   |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,56 %                                 | 0,83 %                                 | 0,82 %   | 0,83 %                                | 0,68 %                                  | 0,68 %                                 |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 4,81 %                                 | 5,55 %                                 | 5,59 %   | 5,52 %                                | 5,60 %                                  | 5,68 %                                 |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |  |  |  |                                       |   |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 9,53                                   | 10,31                                  | 8,82   | 6,49                                  | 7,87                                    | 6,96                                   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |  |                                       |   |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,40                                   | 0,51                                   | 0,43   | 0,31                                  | 0,40                                    | 0,34                                   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,60                                   | 0,64                                   | 0,45   | 0,39                                  | 0,50                                    | 0,43                                   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,00                                   | 1,15                                   | 0,88   | 0,70                                  | 0,90                                    | 0,77                                   |
| Ausschüttungen  | –                                      | –                                      | –  | (0,33)                                | –                                       | (0,37)                                 |
| Schlussnettoinventarwert  | 10,53                                  | 11,46                                  | 9,70   | 6,86                                  | 8,77                                    | 7,36                                   |
| Gesamtertrag  | 10,49 %                                | 11,15 %                                | 9,98 %   | 11,36 %                               | 11,44 %                                 | 11,56 %                                |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |  |                                       |   |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,48 %                                 | 0,79 %                                 | 0,79 %   | 0,79 %                                | 0,65 %                                  | 0,65 %                                 |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 4,09 %                                 | 4,81 %                                 | 4,78 %   | 4,79 %                                | 4,91 %                                  | 4,92 %                                 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I3<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I4<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I5 (nicht<br>währungsgesichert)<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M<br>€ | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR M<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR P<br>€ |
|---|---|---|--|--|---------------------------------------|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |   |  |  |                                       |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 9,84                                    | 11,13                                   | 11,04  | 9,81                                   | 6,36                                  | 8,88                                   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |   |  |  |                                       |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,60                                    | 0,71                                    | 0,71   | 0,41                                   | 0,25                                  | 0,52                                   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,52                                    | 0,56                                    | 1,63   | 0,51                                   | 0,33                                  | 0,48                                   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,12                                    | 1,27                                    | 2,34   | 0,92                                   | 0,58                                  | 1,00                                   |
| Ausschüttungen  | –                                       | –                                       | –  | –                                      | (0,36)                                | –                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 10,96                                   | 12,40                                   | 13,38  | 10,73                                  | 6,58                                  | 9,88                                   |
| Gesamtertrag  | 11,38 %                                 | 11,41 %                                 | 21,20 %  | 9,38 %                                 | 9,37 %                                | 11,26 %                                |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |   |  |  |                                       |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,61 %                                  | 0,53 %                                  | 0,46 %   | 2,39 %                                 | 2,39 %                                | 0,79 %                                 |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 5,75 %                                  | 5,94 %                                  | 5,90 %   | 3,97 %                                 | 3,94 %                                | 5,58 %                                 |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |   |   |  |  |                                       |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 8,83                                    | 9,97                                    | 10,00  | 8,95                                   | 6,16                                  | 7,98                                   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |   |  |  |                                       |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,46                                    | 0,52                                    | 0,53   | 0,30                                   | 0,20                                  | 0,40                                   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,55                                    | 0,64                                    | 0,51   | 0,56                                   | 0,36                                  | 0,50                                   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,01                                    | 1,16                                    | 1,04   | 0,86                                   | 0,56                                  | 0,90                                   |
| Ausschüttungen  | –                                       | –                                       | –  | –                                      | (0,36)                                | –                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 9,84                                    | 11,13                                   | 11,04  | 9,81                                   | 6,36                                  | 8,88                                   |
| Gesamtertrag  | 11,44 %                                 | 11,63 %                                 | 10,40 %  | 9,61 %                                 | 9,68 %                                | 11,28 %                                |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |   |  |  |                                       |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,58 %                                  | 0,51 %                                  | 0,45 %   | 2,26 %                                 | 2,26 %                                | 0,76 %                                 |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 5,08 %                                  | 5,08 %                                  | 5,14 %   | 3,32 %                                 | 3,32 %                                | 4,82 %                                 |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR Z<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I<br>£ | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP I<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I2<br>£ | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP I2<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP P<br>£ |
|---|--|--|---------------------------------------|---|--|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |  |                                       |   |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 9,27                                   | 10,78                                  | 7,41                                  | 9,48                                    | 7,71                                   | 9,67                                   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |                                       |   |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,62                                   | 0,60                                   | 0,41                                  | 0,54                                    | 0,44                                   | 0,55                                   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,48                                   | 0,77                                   | 0,51                                  | 0,68                                    | 0,52                                   | 0,68                                   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,10                                   | 1,37                                   | 0,92                                  | 1,22                                    | 0,96                                   | 1,23                                   |
| Ausschüttungen  | –                                      | –                                      | (0,36)                                | –                                       | (0,38)                                 | –                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 10,37                                  | 12,15                                  | 7,97                                  | 10,70                                   | 8,29                                   | 10,90                                  |
| Gesamtertrag  | 11,87 %                                | 12,71 %                                | 12,74 %                               | 12,87 %                                 | 12,85 %                                | 12,72 %                                |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |                                       |   |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,10 %                                 | 0,81 %                                 | 0,81 %                                | 0,67 %                                  | 0,67 %                                 | 0,77 %                                 |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 6,28 %                                 | 5,28 %                                 | 5,37 %                                | 5,47 %                                  | 5,50 %                                 | 5,37 %                                 |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |  |  |                                       |   |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 8,27                                   | 9,55                                   | 6,91                                  | 8,39                                    | 7,18                                   | 8,56                                   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |                                       |   |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,46                                   | 0,48                                   | 0,34                                  | 0,42                                    | 0,35                                   | 0,43                                   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,54                                   | 0,75                                   | 0,52                                  | 0,67                                    | 0,56                                   | 0,68                                   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,00                                   | 1,23                                   | 0,86                                  | 1,09                                    | 0,91                                   | 1,11                                   |
| Ausschüttungen  | –                                      | –                                      | (0,36)                                | –                                       | (0,38)                                 | –                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 9,27                                   | 10,78                                  | 7,41                                  | 9,48                                    | 7,71                                   | 9,67                                   |
| Gesamtertrag  | 12,09 %                                | 12,88 %                                | 12,97 %                               | 12,99 %                                 | 13,28 %                                | 12,97 %                                |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |                                       |   |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,11 %                                 | 0,79 %                                 | 0,78 %                                | 0,65 %                                  | 0,65 %                                 | 0,75 %                                 |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 5,42 %                                 | 4,83 %                                 | 4,84 %                                | 4,85 %                                  | 4,85 %                                 | 4,87 %                                 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

|   | Ausschüttende<br>Klasse<br>HKD A<br>(Monatlich)<br>HKD | Thesaurierende<br>Klasse<br>JPY I<br>¥ | Thesaurierende<br>Klasse<br>SEK A<br>SEK | Thesaurierende<br>Klasse<br>SEK I2<br>SEK | Ausschüttende<br>Klasse<br>SGD A<br>(Monatlich)<br>SGD | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD A<br>(Monatlich)<br>US\$ |
|---|--|--|--|---|--|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |  |  |   |  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 7,64   | 876,83                                 | 101,47                                   | 86,45                                     | 14,34  | 7,21  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |  |   |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,37   | 49,82                                  | 5,04                                     | 5,18                                      | 0,69   | 0,34  |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,45   | 8,31                                   | 5,13                                     | 4,29                                      | 0,71   | 0,52  |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,82   | 58,13                                  | 10,17                                    | 9,47                                      | 1,40   | 0,86  |
| Ausschüttungen  | (0,62)   | –                                      | –  | –   | (1,16)   | (0,59)  |
| Schlussnettoinventarwert  | 7,84   | 934,96                                 | 111,64                                   | 95,92                                     | 14,58  | 7,48  |
| Gesamtertrag  | 11,20 %  | 6,63 %                                 | 10,02 %                                  | 10,95 %                                   | 10,18 %  | 12,42 %   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |  |   |  |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,48 %   | 0,82 %                                 | 1,55 %                                   | 0,68 %                                    | 1,53 %   | 1,49 %  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 4,73 %   | 5,50 %                                 | 4,72 %                                   | 5,68 %                                    | 4,79 %   | 4,59 %  |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |  |  |  |   |  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 7,38   | 816,31                                 | 91,78                                    | 77,53                                     | 13,92  | 6,89  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |  |   |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,31   | 40,64                                  | 3,85                                     | 3,93                                      | 0,57   | 0,29  |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,52   | 19,88                                  | 5,84                                     | 4,99                                      | 0,92   | 0,56  |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,83   | 60,52                                  | 9,69                                     | 8,92                                      | 1,49   | 0,85  |
| Ausschüttungen  | (0,57)   | –                                      | –  | –   | (1,07)   | (0,53)  |
| Schlussnettoinventarwert  | 7,64   | 876,83                                 | 101,47                                   | 86,45                                     | 14,34  | 7,21  |
| Gesamtertrag  | 11,87 %  | 7,41 %                                 | 10,56 %                                  | 11,51 %                                   | 11,36 %  | 13,08 %   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |  |   |  |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,51 %   | 0,81 %                                 | 1,43 %                                   | 0,63 %                                    | 1,48 %   | 1,51 %  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 4,22 %   | 4,92 %                                 | 4,09 %                                   | 4,93 %                                    | 4,12 %   | 4,19 %  |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD A<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD C1<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I2<br>US\$ |
|---|---|--|--|---|--|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |  |  |   |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 12,73                                     | 8,36                                     | 9,46                                       | 13,71                                     | 8,32                                     | 11,91                                      |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |  |   |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,62                                      | 0,41                                     | 0,36                                       | 0,78                                      | 0,46                                     | 0,69                                       |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,95                                      | 0,60                                     | 0,70                                       | 1,02                                      | 0,61                                     | 0,89                                       |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,57                                      | 1,01                                     | 1,06                                       | 1,80                                      | 1,07                                     | 1,58                                       |
| Ausschüttungen  | –   | (0,35)                                   | –  | –   | (0,41)                                   | –  |
| Schlussnettoinventarwert  | 14,30                                     | 9,02                                     | 10,52                                      | 15,51                                     | 8,98                                     | 13,49                                      |
| Gesamtertrag  | 12,33 %                                   | 12,37 %                                  | 11,21 %                                    | 13,13 %                                   | 13,18 %                                  | 13,27 %                                    |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |  |  |   |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,49 %                                    | 1,50 %                                   | 2,49 %                                     | 0,79 %                                    | 0,79 %                                   | 0,65 %                                     |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 4,61 %                                    | 4,76 %                                   | 3,59 %                                     | 5,31 %                                    | 5,32 %                                   | 5,41 %                                     |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |   |  |  |   |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 11,26                                     | 7,74                                     | 8,45                                       | 12,04                                     | 7,70                                     | 10,45                                      |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |  |   |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,49                                      | 0,33                                     | 0,28                                       | 0,61                                      | 0,38                                     | 0,52                                       |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,98                                      | 0,64                                     | 0,73                                       | 1,06                                      | 0,64                                     | 0,94                                       |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,47                                      | 0,97                                     | 1,01                                       | 1,67                                      | 1,02                                     | 1,46                                       |
| Ausschüttungen  | –   | (0,35)                                   | –  | –   | (0,40)                                   | –  |
| Schlussnettoinventarwert  | 12,73                                     | 8,36                                     | 9,46                                       | 13,71                                     | 8,32                                     | 11,91                                      |
| Gesamtertrag  | 13,06 %                                   | 13,01 %                                  | 11,95 %                                    | 13,87 %                                   | 13,87 %                                  | 13,97 %                                    |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |  |  |   |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,51 %                                    | 1,51 %                                   | 2,51 %                                     | 0,81 %                                    | 0,81 %                                   | 0,67 %                                     |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 4,17 %                                    | 4,23 %                                   | 3,19 %                                     | 4,88 %                                    | 4,90 %                                   | 4,74 %                                     |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

|   | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I2<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I3<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD M<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD P<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD X<br>US\$ |
|---|---|---|---|--|---|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |   |   |  |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 8,07                                      | 8,22                                      | 9,56                                      | 6,75                                     | 10,19                                     | 9,30                                      |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |   |   |  |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,46                                      | 0,47                                      | 0,39                                      | 0,26                                     | 0,58                                      | 0,56                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,58                                      | 0,59                                      | 0,70                                      | 0,49                                     | 0,76                                      | 0,70                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,04                                      | 1,06                                      | 1,09                                      | 0,75                                     | 1,34                                      | 1,26                                      |
| Ausschüttungen  | (0,41)                                    | (0,42)                                    | –   | (0,38)                                   | –   | –   |
| Schlussnettoinventarwert  | 8,70                                      | 8,86                                      | 10,65                                     | 7,12                                     | 11,53                                     | 10,56                                     |
| Gesamtertrag  | 13,20 %                                   | 13,26 %                                   | 11,40 %                                   | 11,52 %                                  | 13,15 %                                   | 13,55 %                                   |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |        |        |        |        |        |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,65 % | 0,58 % | 2,29 % | 2,29 % | 0,76 % | 0,47 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 5,46 % | 5,51 % | 3,83 % | 3,83 % | 5,34 % | 5,65 % |

**31. Dezember 2023**

|   |         |         |         |         |         |         |
|---|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 7,47    | 7,60    | 8,52    | 6,39    | 8,95    | 8,15    |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |         |         |         |         |         |         |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,37    | 0,39    | 0,30    | 0,22    | 0,46    | 0,44    |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,63    | 0,64    | 0,74    | 0,52    | 0,78    | 0,71    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,00    | 1,03    | 1,04    | 0,74    | 1,24    | 1,15    |
| Ausschüttungen  | (0,40)  | (0,41)  | –       | (0,38)  | –       | –       |
| Schlussnettoinventarwert  | 8,07    | 8,22    | 9,56    | 6,75    | 10,19   | 9,30    |
| Gesamtertrag  | 14,00 % | 14,22 % | 12,21 % | 12,26 % | 13,85 % | 14,11 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |        |        |        |        |        |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,67 % | 0,60 % | 2,31 % | 2,31 % | 0,77 % | 0,52 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 4,93 % | 5,10 % | 3,38 % | 3,39 % | 4,92 % | 5,16 % |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z<br>US\$ |
|---|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 11,49                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,72                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,88                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,60                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 13,09                                     |
| Gesamtertrag  | 13,93 %                                   |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |
|--------------------------------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,09 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 5,94 % |

**31. Dezember 2023**

|   |         |
|---|---------|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,02   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |         |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,58    |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,89    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,47    |
| Schlussnettoinventarwert  | 11,49   |
| Gesamtertrag  | 14,67 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |
|--------------------------------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,11 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 5,58 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Local Currency

|  | Ausschüttende<br>Klasse<br>AUD B<br>(Monatlich)<br>AUD | Thesaurierende<br>Klasse<br>AUD B<br>AUD | Ausschüttende<br>Klasse<br>AUD E<br>(Monatlich)<br>AUD | Thesaurierende<br>Klasse<br>AUD E<br>AUD | Ausschüttende<br>Klasse<br>AUD T<br>(Monatlich)<br>AUD | Thesaurierende<br>Klasse<br>AUD T<br>AUD |
|--|--|--|--|--|--|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>   |  |  |  |  |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert  | 3,51   | 8,34                                     | 3,52   | 8,33                                     | 3,82   | 9,07                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:  |  |  |  |  |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>  | 0,12   | 0,29                                     | 0,12   | 0,30                                     | 0,17   | 0,42                                     |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | (0,34)   | (0,85)                                   | (0,35)   | (0,85)                                   | (0,37)   | (0,94)                                   |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit   | (0,22)   | (0,56)                                   | (0,23)   | (0,55)                                   | (0,20)   | (0,52)                                   |
| Ausschüttungen   | (0,30)   | –  | (0,30)   | –  | (0,32)   | –  |
| Schlussnettoinventarwert   | 2,99   | 7,78                                     | 2,99   | 7,78                                     | 3,30   | 8,55                                     |
| Gesamtertrag   | (6,64 %)   | (6,71 %)                                 | (6,90 %)   | (6,60 %)                                 | (5,59 %)   | (5,73 %)                                 |

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

|                                |        |        |        |        |        |        |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 3,17 % | 3,16 % | 3,17 % | 3,16 % | 2,10 % | 2,10 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,62 % | 3,65 % | 3,56 % | 3,66 % | 4,74 % | 4,73 % |

**31. Dezember 2023**

|  |        |        |        |        |         |         |
|--|--------|--------|--------|--------|---------|---------|
| Eröffnungsnettoinventarwert  | 3,54   | 7,62   | 3,54   | 7,61   | 3,81    | 8,21    |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:  |        |        |        |        |         |         |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>  | 0,10   | 0,23   | 0,10   | 0,23   | 0,15    | 0,34    |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,22   | 0,49   | 0,23   | 0,49   | 0,23    | 0,52    |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit   | 0,32   | 0,72   | 0,33   | 0,72   | 0,38    | 0,86    |
| Ausschüttungen   | (0,35) | –      | (0,35) | –      | (0,37)  | –       |
| Schlussnettoinventarwert   | 3,51   | 8,34   | 3,52   | 8,33   | 3,82    | 9,07    |
| Gesamtertrag   | 9,48 % | 9,45 % | 9,79 % | 9,46 % | 10,70 % | 10,48 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen**

|                                |        |        |        |        |        |        |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 2,94 % | 2,92 % | 2,93 % | 2,92 % | 1,95 % | 1,94 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 2,93 % | 2,93 % | 2,92 % | 2,92 % | 3,91 % | 3,91 % |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I (nicht<br>währungsgesichert)<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I2 (nicht<br>währungsgesichert)<br>€ | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I4 (nicht<br>währungsgesichert)<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR Y (nicht<br>währungsgesichert)<br>€ |
|--|--|--|---|--|---|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>   |  |  |   |  |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert  | 7,19                                   | 7,76                                   | 10,15   | 11,97  | 7,57  | 10,18   |
| Erträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit:   |  |  |   |  |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>  | 0,34                                   | 0,44                                   | 0,59  | 0,70   | 0,45  | 0,63  |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus<br>Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | (0,77)                                 | (0,85)                                 | (0,28)  | (0,31)   | (0,21)  | (0,27)  |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit  | (0,43)                                 | (0,41)                                 | 0,31  | 0,39   | 0,24  | 0,36  |
| Ausschüttungen   | –                                      | –                                      | –   | –  | (0,39)  | –   |
| Schlussnettoinventarwert   | 6,76                                   | 7,35                                   | 10,46   | 12,36  | 7,42  | 10,54   |
| Gesamtertrag   | (5,98 %)                               | (5,28 %)                               | 3,05 %  | 3,26 %   | 3,33 %  | 3,54 %  |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>   |  |  |   |  |   |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>   | 1,74 %                                 | 0,96 %                                 | 0,96 %  | 0,80 %   | 0,64 %  | 0,55 %  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)   | 4,85 %                                 | 5,76 %                                 | 5,74 %  | 5,84 %   | 6,05 %  | 6,14 %  |
| <b>31. Dezember 2023</b>   |  |  |   |  |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert  | 6,52                                   | 6,99                                   | 9,22  | 10,86  | 7,20  | 9,22  |
| Erträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit:   |  |  |   |  |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>  | 0,28                                   | 0,36                                   | 0,48  | 0,58   | 0,39  | 0,52  |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus<br>Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,39                                   | 0,41                                   | 0,45  | 0,53   | 0,34  | 0,44  |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit  | 0,67                                   | 0,77                                   | 0,93  | 1,11   | 0,73  | 0,96  |
| Ausschüttungen   | –                                      | –                                      | –   | –  | (0,36)  | –   |
| Schlussnettoinventarwert   | 7,19                                   | 7,76                                   | 10,15   | 11,97  | 7,57  | 10,18   |
| Gesamtertrag   | 10,28 %                                | 11,02 %                                | 10,09 %   | 10,22 %  | 10,41 %   | 10,41 %   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>   |  |  |   |  |   |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>   | 1,65 %                                 | 0,93 %                                 | 0,92 %  | 0,78 %   | 0,63 %  | 0,54 %  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)   | 4,16 %                                 | 4,92 %                                 | 4,97 %  | 5,11 %   | 5,26 %  | 5,35 %  |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I4 (nicht<br>währungsgesichert)<br>£ | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP I4 (nicht<br>währungsgesichert)<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP Y (nicht<br>währungs-<br>gesichert)<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>SEK A<br>SEK | Ausschüttende<br>Klasse<br>SGD A<br>(Monatlich)<br>SGD |
|---|--|--|---|--|--|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |  |   |  |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 8,63                                   | 10,42  | 7,40  | 9,95   | 88,68                                    | 11,03  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |   |  |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,47                                   | 0,60   | 0,42  | 0,59   | 4,26                                     | 0,49   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | (0,80)                                 | (0,74)   | (0,52)  | (0,72)   | (9,83)                                   | (1,14)   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | (0,33)                                 | (0,14)   | (0,10)  | (0,13)   | (5,57)                                   | (0,65)   |
| Ausschüttungen  | –                                      | –  | (0,37)  | –  | –  | (0,74)   |
| Schlussnettoinventarwert  | 8,30                                   | 10,28  | 6,93  | 9,82   | 83,11                                    | 9,64   |
| Gesamtertrag  | (3,82 %)                               | (1,34 %)   | (1,29 %)  | (1,31 %)   | (6,28 %)                                 | (6,11 %)   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |   |  |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,93 %                                 | 0,63 %   | 0,64 %  | 0,54 %   | 1,75 %                                   | 1,69 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 5,59 %                                 | 5,89 %   | 5,93 %  | 6,00 %   | 4,95 %                                   | 4,80 %   |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |  |  |   |  |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 7,65                                   | 9,67   | 7,20  | 9,22   | 80,46                                    | 10,66  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |   |  |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,40                                   | 0,52   | 0,38  | 0,51   | 3,49                                     | 0,45   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,58                                   | 0,23   | 0,17  | 0,22   | 4,73                                     | 0,71   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,98                                   | 0,75   | 0,55  | 0,73   | 8,22                                     | 1,16   |
| Ausschüttungen  | –                                      | –  | (0,35)  | –  | –  | (0,79)   |
| Schlussnettoinventarwert  | 8,63                                   | 10,42  | 7,40  | 9,95   | 88,68                                    | 11,03  |
| Gesamtertrag  | 12,81 %                                | 7,76 %   | 7,94 %  | 7,92 %   | 10,22 %                                  | 11,31 %  |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |   |  |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,94 %                                 | 0,63 %   | 0,63 %  | 0,54 %   | 1,61 %                                   | 1,66 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 4,95 %                                 | 5,22 %   | 5,23 %  | 5,34 %   | 4,14 %                                   | 4,20 %   |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

|  | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD A<br>(Monatlich)<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD B<br>(Monatlich)<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD B<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD E<br>(Monatlich)<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD E<br>US\$ |
|--|---|---|---|---|---|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>   |   |   |   |   |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert  | 4,97  | 8,79                                      | 4,02  | 8,91                                      | 4,02  | 8,92                                      |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:  |   |   |   |   |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>  | 0,22  | 0,41                                      | 0,13  | 0,30                                      | 0,13  | 0,29                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | (0,41)  | (0,77)                                    | (0,34)  | (0,78)                                    | (0,34)  | (0,77)                                    |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit   | (0,19)  | (0,36)                                    | (0,21)  | (0,48)                                    | (0,21)  | (0,48)                                    |
| Ausschüttungen   | (0,34)  | –   | (0,34)  | –   | (0,34)  | –   |
| Schlussnettoinventarwert   | 4,44  | 8,43                                      | 3,47  | 8,43                                      | 3,47  | 8,44                                      |
| Gesamtertrag   | (4,03 %)  | (4,10 %)                                  | (5,40 %)  | (5,39 %)                                  | (5,40 %)  | (5,38 %)                                  |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>   |   |   |   |   |   |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>   | 1,67 %  | 1,67 %                                    | 2,97 %  | 2,98 %                                    | 2,96 %  | 2,99 %                                    |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)   | 4,74 %  | 4,73 %                                    | 3,43 %  | 3,45 %                                    | 3,37 %  | 3,40 %                                    |
| <b>31. Dezember 2023</b>   |   |   |   |   |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert  | 4,73  | 7,78                                      | 3,97  | 7,99                                      | 3,97  | 7,99                                      |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:  |   |   |   |   |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>  | 0,21  | 0,36                                      | 0,12  | 0,25                                      | 0,12  | 0,26                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,38  | 0,65                                      | 0,32  | 0,67                                      | 0,32  | 0,67                                      |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit   | 0,59  | 1,01                                      | 0,44  | 0,92                                      | 0,44  | 0,93                                      |
| Ausschüttungen   | (0,35)  | –   | (0,39)  | –   | (0,39)  | –   |
| Schlussnettoinventarwert   | 4,97  | 8,79                                      | 4,02  | 8,91                                      | 4,02  | 8,92                                      |
| Gesamtertrag   | 12,99 %   | 12,98 %                                   | 11,71 %   | 11,51 %                                   | 11,71 %   | 11,64 %                                   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>   |   |   |   |   |   |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>   | 1,69 %  | 1,69 %                                    | 3,00 %  | 3,00 %                                    | 3,01 %  | 2,99 %                                    |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)   | 4,35 %  | 4,33 %                                    | 3,01 %  | 3,00 %                                    | 3,06 %  | 3,07 %                                    |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

|   | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I<br>(Monatlich)<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I2<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I5<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD T<br>(Monatlich)<br>US\$ |
|---|---|---|--|--|--|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |   |  |  |  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 7,97  | 9,52                                      | 7,55                                     | 9,26                                       | 10,20                                      | 4,45  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |   |  |  |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,41  | 0,51                                      | 0,39                                     | 0,51                                       | (1,91)                                     | 0,18  |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | (0,68)  | (0,83)                                    | (0,64)                                   | (0,81)                                     | 1,60                                       | (0,37)  |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | (0,27)  | (0,32)                                    | (0,25)                                   | (0,30)                                     | (0,31)                                     | (0,19)  |
| Ausschüttungen  | (0,54)  | –   | (0,36)                                   | –  | –  | (0,37)  |
| Schlussnettoinventarwert  | 7,16  | 9,20                                      | 6,94                                     | 8,96                                       | 9,89                                       | 3,89  |
| Gesamtertrag  | (3,49 %)  | (3,36 %)                                  | (3,40 %)                                 | (3,24 %)                                   | (3,04 %)                                   | (4,47 %)  |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |   |  |  |  |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,92 %  | 0,92 %                                    | 0,91 %                                   | 0,76 %                                     | 0,53 %                                     | 1,97 %  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 5,47 %  | 5,49 %                                    | 5,44 %                                   | 5,64 %                                     | (18,95 %)                                  | 4,45 %  |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |   |   |  |  |  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 7,52  | 8,36                                      | 6,94                                     | 8,12                                       | 9,08                                       | 4,35  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |   |  |  |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,39  | 0,45                                      | 0,36                                     | 0,45                                       | (2,11)                                     | 0,18  |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,62  | 0,71                                      | 0,58                                     | 0,69                                       | 3,23                                       | 0,35  |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,01  | 1,16                                      | 0,94                                     | 1,14                                       | 1,12                                       | 0,53  |
| Ausschüttungen  | (0,56)  | –   | (0,33)                                   | –  | –  | (0,43)  |
| Schlussnettoinventarwert  | 7,97  | 9,52                                      | 7,55                                     | 9,26                                       | 10,20                                      | 4,45  |
| Gesamtertrag  | 13,97 %   | 13,88 %                                   | 13,94 %                                  | 14,04 %                                    | 12,33 %                                    | 12,86 %   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |   |  |  |  |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,94 %  | 0,95 %                                    | 0,94 %                                   | 0,80 %                                     | 0,56 %                                     | 2,00 %  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 5,08 %  | 5,08 %                                    | 5,04 %                                   | 5,22 %                                     | (22,17 %)                                  | 4,03 %  |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD T<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD X<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Y<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>ZAR B<br>(Monatlich)<br>ZAR | Thesaurierende<br>Klasse<br>ZAR B<br>ZAR | Ausschüttende<br>Klasse<br>ZAR E<br>(Monatlich)<br>ZAR |
|--|---|---|---|--|--|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>   |   |   |   |  |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert  | 9,71                                      | 9,46                                      | 9,18                                      | 36,52  | 123,28                                   | 36,52  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:  |   |   |   |  |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>  | 0,42                                      | 0,55                                      | 0,53                                      | 1,18   | 4,35                                     | 1,19   |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | (0,85)                                    | (0,83)                                    | (0,80)                                    | (2,21)   | (8,05)                                   | (2,22)   |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit   | (0,43)                                    | (0,28)                                    | (0,27)                                    | (1,03)   | (3,70)                                   | (1,03)   |
| Ausschüttungen   | –   | –   | –   | (4,22)   | –  | (4,22)   |
| Schlussnettoinventarwert   | 9,28                                      | 9,18                                      | 8,91                                      | 31,27  | 119,58                                   | 31,27  |
| Gesamtertrag   | (4,43 %)                                  | (2,96 %)                                  | (2,94 %)                                  | (2,99 %)   | (3,00 %)                                 | (2,99 %)   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>   |   |   |   |  |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>   | 1,97 %                                    | 0,49 %                                    | 0,52 %                                    | 3,05 %   | 3,06 %                                   | 3,07 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)   | 4,45 %                                    | 5,91 %                                    | 5,87 %                                    | 3,48 %   | 3,58 %                                   | 3,52 %   |
| <b>31. Dezember 2023</b>   |   |   |   |  |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert  | 8,61                                      | 8,27                                      | 8,03                                      | 36,58  | 107,97                                   | 36,58  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:  |   |   |   |  |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>  | 0,37                                      | 0,49                                      | 0,47                                      | 1,10   | 3,61                                     | 1,09   |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,73                                      | 0,70                                      | 0,68                                      | 3,71   | 11,70                                    | 3,72   |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit   | 1,10                                      | 1,19                                      | 1,15                                      | 4,81   | 15,31                                    | 4,81   |
| Ausschüttungen   | –   | –   | –   | (4,87)   | –  | (4,87)   |
| Schlussnettoinventarwert   | 9,71                                      | 9,46                                      | 9,18                                      | 36,52  | 123,28                                   | 36,52  |
| Gesamtertrag   | 12,78 %                                   | 14,39 %                                   | 14,32 %                                   | 14,22 %  | 14,18 %                                  | 14,22 %  |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>   |   |   |   |  |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>   | 2,00 %                                    | 0,49 %                                    | 0,56 %                                    | 3,00 %   | 2,95 %                                   | 2,99 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)   | 4,02 %                                    | 5,53 %                                    | 5,47 %                                    | 3,03 %   | 3,13 %                                   | 3,01 %   |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>ZAR E<br>ZAR | Ausschüttende<br>Klasse<br>ZAR T<br>(Monatlich)<br>ZAR | Thesaurierende<br>Klasse<br>ZAR T<br>ZAR |
|---|--|--|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 123,23                                   | 39,80  | 134,35                                   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 4,25                                     | 1,69   | 6,08                                     |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | (7,89)                                   | (2,45)   | (8,79)                                   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | (3,64)                                   | (0,76)   | (2,71)                                   |
| Ausschüttungen  | –  | (4,51)   | –  |
| Schlussnettoinventarwert  | 119,59                                   | 34,53  | 131,64                                   |
| Gesamtertrag  | (2,95 %)                                 | (2,02 %)   | (2,02 %)                                 |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 3,00 %                                   | 2,03 %   | 2,02 %                                   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 3,53 %                                   | 4,57 %   | 4,58 %                                   |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |  |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 107,98                                   | 39,47  | 116,49                                   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 3,55                                     | 1,57   | 4,98                                     |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 11,70                                    | 4,04   | 12,88                                    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 15,25                                    | 5,61   | 17,86                                    |
| Ausschüttungen  | –  | (5,28)   | –  |
| Schlussnettoinventarwert  | 123,23                                   | 39,80  | 134,35                                   |
| Gesamtertrag  | 14,12 %                                  | 15,36 %  | 15,33 %                                  |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 2,86 %                                   | 1,98 %   | 1,98 %                                   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 3,06 %                                   | 4,00 %   | 3,99 %                                   |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt Blend

|   | Ausschüttende<br>Klasse<br>AUD I3<br>AUD | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I<br>€ | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I2<br>€ | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I2<br>€ |
|---|--|--|--|---------------------------------------|---|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |  |  |                                       |   |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 7,96                                     | 10,46                                  | 10,81                                  | 7,22                                  | 11,12                                   | 7,03                                   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |  |                                       |   |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,49                                     | 0,54                                   | 0,64                                   | 0,41                                  | 0,67                                    | 0,41                                   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,10                                     | (0,05)                                 | (0,05)                                 | (0,02)                                | (0,05)                                  | (0,02)                                 |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,59                                     | 0,49                                   | 0,59                                   | 0,39                                  | 0,62                                    | 0,39                                   |
| Ausschüttungen  | (0,40)                                   | –                                      | –                                      | (0,35)                                | –                                       | (0,35)                                 |
| Schlussnettoinventarwert  | 8,15                                     | 10,95                                  | 11,40                                  | 7,26                                  | 11,74                                   | 7,07                                   |
| Gesamtertrag  | 7,63 %                                   | 4,68 %                                 | 5,46 %                                 | 5,52 %                                | 5,58 %                                  | 5,68 %                                 |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |  |                                       |   |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,72 %                                   | 1,65 %                                 | 0,92 %                                 | 0,92 %                                | 0,78 %                                  | 0,78 %                                 |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 6,10 %                                   | 5,03 %                                 | 5,77 %                                 | 5,76 %                                | 5,87 %                                  | 5,91 %                                 |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |  |  |  |                                       |   |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 7,49                                     | 9,66                                   | 9,92                                   | 6,93                                  | 10,19                                   | 6,74                                   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |  |                                       |   |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,37                                     | 0,39                                   | 0,47                                   | 0,32                                  | 0,50                                    | 0,32                                   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,46                                     | 0,41                                   | 0,42                                   | 0,28                                  | 0,43                                    | 0,28                                   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,83                                     | 0,80                                   | 0,89                                   | 0,60                                  | 0,93                                    | 0,60                                   |
| Ausschüttungen  | (0,36)                                   | –                                      | –                                      | (0,31)                                | –                                       | (0,31)                                 |
| Schlussnettoinventarwert  | 7,96                                     | 10,46                                  | 10,81                                  | 7,22                                  | 11,12                                   | 7,03                                   |
| Gesamtertrag  | 11,37 %                                  | 8,28 %                                 | 8,97 %                                 | 8,97 %                                | 9,13 %                                  | 9,24 %                                 |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |  |                                       |   |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,58 %                                   | 1,48 %                                 | 0,79 %                                 | 0,79 %                                | 0,66 %                                  | 0,66 %                                 |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 4,82 %                                   | 3,95 %                                 | 4,63 %                                 | 4,64 %                                | 4,77 %                                  | 4,78 %                                 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

|   | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I3<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I4 (nicht<br>währungsgesichert)<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I5<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M<br>€ | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR M<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR Z<br>€ |
|---|--|--|---|--|---------------------------------------|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |  |   |  |                                       |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 7,83                                   | 10,67  | 11,77                                   | 10,02                                  | 5,99                                  | 11,70                                  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |   |  |                                       |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,46                                   | 0,67   | 0,74                                    | 0,43                                   | 0,24                                  | 0,78                                   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | (0,04)                                 | 0,41   | (0,06)                                  | (0,05)                                 | (0,02)                                | (0,06)                                 |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,42                                   | 1,08   | 0,68                                    | 0,38                                   | 0,22                                  | 0,72                                   |
| Ausschüttungen  | (0,39)                                 | –  | –                                       | –                                      | (0,44)                                | –                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 7,86                                   | 11,75  | 12,45                                   | 10,40                                  | 5,77                                  | 12,42                                  |
| Gesamtertrag  | 5,55 %                                 | 10,12 %  | 5,78 %                                  | 3,79 %                                 | 3,93 %                                | 6,15 %                                 |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |   |  |                                       |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,70 %                                 | 0,63 %   | 0,56 %                                  | 2,49 %                                 | 2,48 %                                | 0,19 %                                 |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 5,98 %                                 | 6,06 %   | 6,13 %                                  | 4,19 %                                 | 4,22 %                                | 6,49 %                                 |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |  |  |   |  |                                       |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 7,48                                   | 9,81   | 10,76                                   | 9,32                                   | 6,05                                  | 10,65                                  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |   |  |                                       |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,36                                   | 0,50   | 0,55                                    | 0,30                                   | 0,18                                  | 0,58                                   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,32                                   | 0,36   | 0,46                                    | 0,40                                   | 0,23                                  | 0,47                                   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,68                                   | 0,86   | 1,01                                    | 0,70                                   | 0,41                                  | 1,05                                   |
| Ausschüttungen  | (0,33)                                 | –  | –                                       | –                                      | (0,47)                                | –                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 7,83                                   | 10,67  | 11,77                                   | 10,02                                  | 5,99                                  | 11,70                                  |
| Gesamtertrag  | 9,37 %                                 | 8,77 %   | 9,39 %                                  | 7,51 %                                 | 7,29 %                                | 9,86 %                                 |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |   |  |                                       |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,59 %                                 | 0,52 %   | 0,45 %                                  | 2,26 %                                 | 2,29 %                                | 0,11 %                                 |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 4,75 %                                 | 4,87 %   | 4,98 %                                  | 3,16 %                                 | 3,00 %                                | 5,27 %                                 |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I (nicht<br>währungsgesichert)<br>£ | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP I<br>£ | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP I (nicht<br>währungsgesichert)<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP P<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP P (nicht<br>währungsgesichert)<br>£ |
|--|--|---|---------------------------------------|--|--|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>   |  |   |                                       |  |  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert  | 11,57                                  | 10,53   | 8,05                                  | 8,49   | 10,14                                  | 10,44   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:  |  |   |                                       |  |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>  | 0,66                                   | (2,55)  | 0,44                                  | 0,47   | 0,57                                   | 0,59  |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | (0,23)                                 | 3,06  | (0,15)                                | (0,08)   | (0,20)                                 | (0,10)  |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit   | 0,43                                   | 0,51  | 0,29                                  | 0,39   | 0,37                                   | 0,49  |
| Ausschüttungen   | –                                      | –   | (0,38)                                | (0,40)   | –                                      | –   |
| Schlussnettoinventarwert   | 12,00                                  | 11,04   | 7,96                                  | 8,48   | 10,51                                  | 10,93   |
| Gesamtertrag   | 3,72 %                                 | 4,84 %  | 3,74 %                                | 4,81 %   | 3,65 %                                 | 4,69 %  |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>   |  |   |                                       |  |  |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>   | 0,90 %                                 | 0,84 %  | 0,91 %                                | 0,90 %   | 0,87 %                                 | 0,87 %  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)   | 5,61 %                                 | (23,88 %)   | 5,53 %                                | 5,59 %   | 5,57 %                                 | 5,61 %  |
| <b>31. Dezember 2023</b>   |  |   |                                       |  |  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert  | 10,65                                  | 9,93  | 7,75                                  | 8,39   | 9,33                                   | 9,85  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:  |  |   |                                       |  |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>  | 0,51                                   | (2,57)  | 0,36                                  | 0,38   | 0,45                                   | 0,46  |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,41                                   | 3,17  | 0,28                                  | 0,09   | 0,36                                   | 0,13  |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit   | 0,92                                   | 0,60  | 0,64                                  | 0,47   | 0,81                                   | 0,59  |
| Ausschüttungen   | –                                      | –   | (0,34)                                | (0,37)   | –                                      | –   |
| Schlussnettoinventarwert   | 11,57                                  | 10,53   | 8,05                                  | 8,49   | 10,14                                  | 10,44   |
| Gesamtertrag   | 8,64 %                                 | 6,04 %  | 8,63 %                                | 5,83 %   | 8,68 %                                 | 5,99 %  |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>   |  |   |                                       |  |  |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>   | 0,80 %                                 | 0,73 %  | 0,79 %                                | 0,79 %   | 0,76 %                                 | 0,76 %  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)   | 4,63 %                                 | (25,53 %)   | 4,63 %                                | 4,63 %   | 4,67 %                                 | 4,65 %  |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP Z<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>NOK U<br>NOK | Thesaurierende<br>Klasse<br>SEK A<br>SEK | Ausschüttende<br>Klasse<br>SGD A<br>(Monatlich)<br>SGD | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD A<br>(Monatlich)<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A<br>US\$ |
|---|--|--|--|--|---|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |  |  |  |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 12,62                                  | 112,39                                   | 112,47                                   | 12,67  | 6,55  | 11,69                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |  |  |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,80                                   | 6,34                                     | 5,84                                     | 0,61   | 0,31  | 0,57                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | (0,24)                                 | 2,57                                     | 0,86                                     | (0,25)   | (0,17)  | (0,32)                                    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,56                                   | 8,91                                     | 6,70                                     | 0,36   | 0,14  | 0,25                                      |
| Ausschüttungen  | –                                      | –  | –  | (0,87)   | (0,45)  | –   |
| Schlussnettoinventarwert  | 13,18                                  | 121,30                                   | 119,17                                   | 12,16  | 6,24  | 11,94                                     |
| Gesamtertrag  | 4,44 %                                 | 7,93 %                                   | 5,96 %                                   | 2,96 %   | 2,20 %  | 2,14 %                                    |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |  |  |   |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,20 %                                 | 1,29 %                                   | 1,66 %                                   | 1,62 %   | 1,58 %  | 1,58 %                                    |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 6,30 %                                 | 5,42 %                                   | 5,03 %                                   | 4,92 %   | 4,79 %  | 4,81 %                                    |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |  |  |  |  |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 11,54                                  | 99,75                                    | 103,59                                   | 12,31  | 6,26  | 10,49                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |  |  |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,63                                   | 4,48                                     | 4,17                                     | 0,49   | 0,26  | 0,44                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,45                                   | 8,16                                     | 4,71                                     | 0,66   | 0,43  | 0,76                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,08                                   | 12,64                                    | 8,88                                     | 1,15   | 0,69  | 1,20                                      |
| Ausschüttungen  | –                                      | –  | –  | (0,79)   | (0,40)  | –   |
| Schlussnettoinventarwert  | 12,62                                  | 112,39                                   | 112,47                                   | 12,67  | 6,55  | 11,69                                     |
| Gesamtertrag  | 9,36 %                                 | 12,67 %                                  | 8,57 %                                   | 9,75 %   | 11,56 %   | 11,44 %                                   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |  |  |   |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,11 %                                 | 1,12 %                                   | 1,43 %                                   | 1,48 %   | 1,51 %  | 1,51 %                                    |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 5,30 %                                 | 4,17 %                                   | 3,84 %                                   | 3,97 %   | 4,04 %  | 4,06 %                                    |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD C1<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I2<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I5<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M<br>US\$ |
|---|--|---|--|---|--|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |   |  |   |  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 9,08                                       | 11,06                                     | 8,25                                     | 7,57                                      | 10,40                                      | 9,16                                      |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |   |  |   |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,35                                       | 0,62                                      | 0,45                                     | 0,42                                      | 0,62                                       | 0,37                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | (0,24)                                     | (0,30)                                    | (0,22)                                   | (0,20)                                    | (0,28)                                     | (0,24)                                    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,11                                       | 0,32                                      | 0,23                                     | 0,22                                      | 0,34                                       | 0,13                                      |
| Ausschüttungen  | –  | –   | (0,39)                                   | (0,37)                                    | –  | –   |
| Schlussnettoinventarwert  | 9,19                                       | 11,38                                     | 8,09                                     | 7,42                                      | 10,74                                      | 9,29                                      |
| Gesamtertrag  | 1,21 %                                     | 2,89 %                                    | 2,90 %                                   | 3,00 %                                    | 3,27 %                                     | 1,42 %                                    |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |   |  |   |  |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 2,58 %                                     | 0,88 %                                    | 0,89 %                                   | 0,74 %                                    | 0,53 %                                     | 2,38 %                                    |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 3,81 %                                     | 5,51 %                                    | 5,51 %                                   | 5,65 %                                    | 5,87 %                                     | 4,01 %                                    |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |  |   |  |   |  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 8,23                                       | 9,85                                      | 7,69                                     | 7,05                                      | 10,00                                      | 8,29                                      |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |   |  |   |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,26                                       | 0,49                                      | 0,37                                     | 0,35                                      | 0,22                                       | 0,28                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,59                                       | 0,72                                      | 0,54                                     | 0,50                                      | 0,18                                       | 0,59                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,85                                       | 1,21                                      | 0,91                                     | 0,85                                      | 0,40                                       | 0,87                                      |
| Ausschüttungen  | –  | –   | (0,35)                                   | (0,33)                                    | –  | –   |
| Schlussnettoinventarwert  | 9,08                                       | 11,06                                     | 8,25                                     | 7,57                                      | 10,40                                      | 9,16                                      |
| Gesamtertrag  | 10,33 %                                    | 12,28 %                                   | 12,23 %                                  | 12,49 %                                   | 4,00 %                                     | 10,49 %                                   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |   |  |   |  |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 2,51 %                                     | 0,81 %                                    | 0,81 %                                   | 0,67 %                                    | 0,46 %                                     | 2,31 %                                    |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 3,05 %                                     | 4,75 %                                    | 4,74 %                                   | 4,88 %                                    | 5,05 %                                     | 3,23 %                                    |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

|   | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD M<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z<br>US\$ |
|---|--|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 6,06                                     | 13,23                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,24                                     | 0,84                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | (0,16)                                   | (0,36)                                    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,08                                     | 0,48                                      |
| Ausschüttungen  | (0,45)                                   | –   |
| Schlussnettoinventarwert  | 5,69                                     | 13,71                                     |
| Gesamtertrag  | 1,30 %                                   | 3,63 %                                    |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |        |
|--------------------------------|--------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 2,39 % | 0,18 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 4,04 % | 6,22 % |

**31. Dezember 2023**

|   |         |         |
|---|---------|---------|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 5,94    | 11,70   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |         |         |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,19    | 0,67    |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,40    | 0,86    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,59    | 1,53    |
| Ausschüttungen  | (0,47)  | –       |
| Schlussnettoinventarwert  | 6,06    | 13,23   |
| Gesamtertrag  | 10,60 % | 13,08 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |        |
|--------------------------------|--------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 2,31 % | 0,11 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,23 % | 5,43 % |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>AUD I2<br>AUD | Thesaurierende<br>Klasse<br>NOK I<br>NOK | Thesaurierende<br>Klasse<br>NOK I3<br>NOK | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z<br>US\$ |
|---|---|--|---|---|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |  |   |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 9,29                                      | 111,71                                   | 103,13                                    | 11,20                                     | 11,26                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |   |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,42                                      | 4,78                                     | 4,69                                      | 0,44                                      | 0,52                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | (0,21)                                    | (1,72)                                   | (1,67)                                    | (0,48)                                    | (0,50)                                    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,21                                      | 3,06                                     | 3,02                                      | (0,04)                                    | 0,02                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 9,50                                      | 114,77                                   | 106,15                                    | 11,16                                     | 11,28                                     |
| Gesamtertrag  | 2,26 %                                    | 2,74 %                                   | 2,93 %                                    | (0,36 %)                                  | 0,18 %                                    |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |        |        |        |        |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,71 % | 0,83 % | 0,64 % | 0,79 % | 0,19 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 4,44 % | 4,21 % | 4,46 % | 3,89 % | 4,63 % |

**31. Dezember 2023**

|   |        |        |        |        |        |
|---|--------|--------|--------|--------|--------|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 8,67   | 103,11 | 100,00 | 10,34  | 10,33  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |        |        |        |        |        |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,33   | 3,82   | 1,25   | 0,38   | 0,46   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,29   | 4,78   | 1,88   | 0,48   | 0,47   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,62   | 8,60   | 3,13   | 0,86   | 0,93   |
| Schlussnettoinventarwert  | 9,29   | 111,71 | 103,13 | 11,20  | 11,26  |
| Gesamtertrag  | 7,15 % | 8,34 % | 3,13 % | 8,32 % | 9,00 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |        |        |        |        |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,68 % | 0,78 % | 0,66 % | 0,82 % | 0,22 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,70 % | 3,53 % | 3,86 % | 3,55 % | 4,30 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Markets Equity

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>AUD B<br>AUD | Thesaurierende<br>Klasse<br>AUD E<br>AUD | Thesaurierende<br>Klasse<br>AUD T<br>AUD | Ausschüttende<br>Klasse<br>CAD I (nicht<br>währungs-<br>gesichert)<br>CAD | Ausschüttende<br>Klasse<br>CAD I2<br>CAD | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I<br>€ |
|---|--|--|--|---|--|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |  |  |   |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 9,42                                     | 9,41                                     | 10,11                                    | 8,07  | 7,97                                     | 9,04                                   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |  |   |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,14)                                   | (0,16)                                   | (0,03)                                   | 0,07  | 0,08                                     | 0,09                                   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 1,57                                     | 1,60                                     | 1,68                                     | 2,36  | 1,39                                     | 1,48                                   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,43                                     | 1,44                                     | 1,65                                     | 2,43  | 1,47                                     | 1,57                                   |
| Ausschüttungen  | –  | –  | –  | (0,05)  | (0,06)                                   | –                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 10,85                                    | 10,85                                    | 11,76                                    | 10,45   | 9,38                                     | 10,61                                  |
| Gesamtertrag  | 15,18 %                                  | 15,30 %                                  | 16,32 %                                  | 30,24 %   | 18,59 %                                  | 17,37 %                                |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |  |   |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 3,54 %                                   | 3,56 %                                   | 2,47 %                                   | 1,38 %  | 1,17 %                                   | 1,38 %                                 |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | (1,31 %)                                 | (1,58 %)                                 | (0,28 %)                                 | 0,74 %  | 0,96 %                                   | 0,91 %                                 |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |  |  |  |   |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 9,13                                     | 9,12                                     | 9,69                                     | 7,87  | 7,64                                     | 8,60                                   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |  |   |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,10)                                   | (0,12)                                   | (0,01)                                   | 0,07  | 0,08                                     | 0,07                                   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,39                                     | 0,41                                     | 0,43                                     | 0,31  | 0,44                                     | 0,37                                   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,29                                     | 0,29                                     | 0,42                                     | 0,38  | 0,52                                     | 0,44                                   |
| Ausschüttungen  | –  | –  | –  | (0,18)  | (0,19)                                   | –                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 9,42                                     | 9,41                                     | 10,11                                    | 8,07  | 7,97                                     | 9,04                                   |
| Gesamtertrag  | 3,18 %                                   | 3,18 %                                   | 4,33 %                                   | 4,89 %  | 6,93 %                                   | 5,12 %                                 |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |  |   |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 3,24 %                                   | 3,27 %                                   | 2,27 %                                   | 1,29 %  | 1,10 %                                   | 1,29 %                                 |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | (1,04 %)                                 | (1,26 %)                                 | (0,08 %)                                 | 0,91 %  | 1,10 %                                   | 0,83 %                                 |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Emerging Markets Equity (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR Z<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP Z<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD B<br>US\$ |
|---|--|--|--|--|---|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |  |  |  |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,17                                  | 7,78                                   | 10,43                                  | 12,65                                  | 10,08                                     | 10,52                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |  |  |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,15)                                 | 0,16                                   | 0,11                                   | 0,25                                   | (0,04)                                    | (0,14)                                    |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 1,68                                   | 1,28                                   | 1,85                                   | 2,27                                   | 1,88                                      | 1,94                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,53                                   | 1,44                                   | 1,96                                   | 2,52                                   | 1,84                                      | 1,80                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 11,70                                  | 9,22                                   | 12,39                                  | 15,17                                  | 11,92                                     | 12,32                                     |
| Gesamtertrag  | 15,04 %                                | 18,51 %                                | 18,79 %                                | 19,92 %                                | 18,25 %                                   | 17,11 %                                   |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |          |        |        |        |          |          |
|--------------------------------|----------|--------|--------|--------|----------|----------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 3,47 %   | 0,33 % | 1,35 % | 0,32 % | 2,32 %   | 3,28 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (1,34 %) | 1,78 % | 0,97 % | 1,72 % | (0,39 %) | (1,22 %) |

**31. Dezember 2023**

|   |        |        |        |        |        |        |
|---|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 9,87   | 7,33   | 9,77   | 11,72  | 9,44   | 9,96   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |        |        |        |        |        |        |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,10) | 0,14   | 0,09   | 0,23   | (0,01) | (0,11) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,40   | 0,31   | 0,57   | 0,70   | 0,65   | 0,67   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,30   | 0,45   | 0,66   | 0,93   | 0,64   | 0,56   |
| Schlussnettoinventarwert  | 10,17  | 7,78   | 10,43  | 12,65  | 10,08  | 10,52  |
| Gesamtertrag  | 3,04 % | 6,14 % | 6,76 % | 7,94 % | 6,78 % | 5,62 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |          |        |        |        |          |          |
|--------------------------------|----------|--------|--------|--------|----------|----------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 3,26 %   | 0,31 % | 1,29 % | 0,31 % | 2,32 %   | 3,33 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (1,05 %) | 1,89 % | 0,92 % | 1,89 % | (0,06 %) | (1,10 %) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Markets Equity (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD E<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD T<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>ZAR B<br>ZAR |
|---|---|---|---|---|---|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |   |   |   |   |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,50                                     | 11,48                                     | 11,20                                     | 11,29                                     | 11,91                                     | 131,03                                   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |   |   |   |   |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,14)                                    | 0,10                                      | (0,19)                                    | (0,03)                                    | 0,24                                      | (2,03)                                   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 1,94                                      | 2,14                                      | 2,11                                      | 2,10                                      | 2,23                                      | 27,75                                    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,80                                      | 2,24                                      | 1,92                                      | 2,07                                      | 2,47                                      | 25,72                                    |
| Schlussnettoinventarwert  | 12,30                                     | 13,72                                     | 13,12                                     | 13,36                                     | 14,38                                     | 156,75                                   |
| Gesamtertrag  | 17,14 %                                   | 19,51 %                                   | 17,14 %                                   | 18,33 %                                   | 20,74 %                                   | 19,63 %                                  |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |          |        |          |          |        |          |
|--------------------------------|----------|--------|----------|----------|--------|----------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 3,29 %   | 1,32 % | 3,31 %   | 2,32 %   | 0,32 % | 3,41 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (1,20 %) | 0,76 % | (1,47 %) | (0,23 %) | 1,74 % | (1,37 %) |

**31. Dezember 2023**

|   |        |        |        |        |        |        |
|---|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 9,94   | 10,66  | 10,60  | 10,57  | 10,94  | 121,51 |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |        |        |        |        |        |        |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,08) | 0,08   | (0,11) | (0,03) | 0,22   | (1,19) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,64   | 0,74   | 0,71   | 0,75   | 0,75   | 10,71  |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,56   | 0,82   | 0,60   | 0,72   | 0,97   | 9,52   |
| Schlussnettoinventarwert  | 10,50  | 11,48  | 11,20  | 11,29  | 11,91  | 131,03 |
| Gesamtertrag  | 5,63 % | 7,69 % | 5,66 % | 6,81 % | 8,87 % | 7,83 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |          |        |          |          |        |          |
|--------------------------------|----------|--------|----------|----------|--------|----------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 3,31 %   | 1,33 % | 3,34 %   | 2,33 %   | 0,32 % | 3,31 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,77 %) | 0,75 % | (1,05 %) | (0,29 %) | 1,93 % | (0,95 %) |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Emerging Markets Equity (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>ZAR E<br>ZAR | Thesaurierende<br>Klasse<br>ZAR T<br>ZAR |
|---|--|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 131,02                                   | 140,86                                   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (2,28)                                   | (0,43)                                   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 28,00                                    | 29,79                                    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 25,72                                    | 29,36                                    |
| Schlussnettoinventarwert  | 156,74                                   | 170,22                                   |
| Gesamtertrag  | 19,63 %                                  | 20,84 %                                  |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |          |          |
|--------------------------------|----------|----------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 3,40 %   | 2,39 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (1,56 %) | (0,27 %) |

**31. Dezember 2023**

|   |        |        |
|---|--------|--------|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 121,51 | 129,33 |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |        |        |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (1,34) | (0,14) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 10,85  | 11,67  |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 9,51   | 11,53  |
| Schlussnettoinventarwert  | 131,02 | 140,86 |
| Gesamtertrag  | 7,83 % | 8,92 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |          |          |
|--------------------------------|----------|----------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 3,31 %   | 2,30 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (1,06 %) | (0,10 %) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Euro Bond

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A*<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I<br>€ | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M*<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR Z*<br>€ |
|---|---|--|---------------------------------------|---|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |  |                                       |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,00                                   | 10,95                                  | 10,13                                 | 10,00                                   | 10,00                                   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |                                       |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,07                                    | 0,32                                   | 0,29                                  | 0,00                                    | 0,24                                    |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,02                                    | 0,31                                   | 0,29                                  | (0,01)                                  | 0,26                                    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,09                                    | 0,63                                   | 0,58                                  | (0,01)                                  | 0,50                                    |
| Ausschüttungen  | –                                       | –                                      | (0,25)                                | –                                       | –                                       |
| Schlussnettoinventarwert  | 10,09                                   | 11,58                                  | 10,46                                 | 9,99                                    | 10,50                                   |
| Gesamtertrag  | 0,90 %                                  | 5,75 %                                 | 5,82 %                                | (0,10 %)                                | 5,00 %                                  |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |        |        |        |        |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,97 % | 0,56 % | 0,56 % | 1,50 % | 0,21 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 2,59 % | 2,81 % | 2,85 % | 1,74 % | 3,18 % |

**31. Dezember 2023**

|   |   |        |        |   |   |
|---|---|--------|--------|---|---|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | – | 9,96   | 9,41   | – | – |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |        |        |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | – | 0,27   | 0,24   | – | – |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | – | 0,72   | 0,68   | – | – |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | – | 0,99   | 0,92   | – | – |
| Ausschüttungen  | – | –      | (0,20) | – | – |
| Schlussnettoinventarwert  | – | 10,95  | 10,13  | – | – |
| Gesamtertrag  | – | 9,94 % | 9,96 % | – | – |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |   |        |        |   |   |
|--------------------------------|---|--------|--------|---|---|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | – | 0,57 % | 0,56 % | – | – |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | – | 2,60 % | 2,54 % | – | – |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Euro Bond Absolute Return

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A*<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I<br>€ | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I2*<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I5<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR Z*<br>€ |
|---|---|--|---------------------------------------|--|---|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |  |                                       |  |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,00                                   | 11,38                                  | 10,67                                 | 10,00                                    | 11,43                                   | 10,00                                   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |                                       |  |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,00                                    | 0,36                                   | 0,33                                  | 0,01                                     | 0,39                                    | 0,26                                    |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,00                                    | 0,57                                   | 0,53                                  | (0,01)                                   | 0,57                                    | 0,32                                    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,00                                    | 0,93                                   | 0,86                                  | 0,00                                     | 0,96                                    | 0,58                                    |
| Ausschüttungen  | –                                       | –                                      | (0,26)                                | –  | –                                       | –                                       |
| Schlussnettoinventarwert  | 10,00                                   | 12,31                                  | 11,27                                 | 10,00                                    | 12,39                                   | 10,58                                   |
| Gesamtertrag  | 0,00 %                                  | 8,17 %                                 | 8,19 %                                | 0,00 %                                   | 8,40 %                                  | 5,80 %                                  |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |        |        |        |        |        |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 1,09 % | 0,67 % | 0,67 % | 0,54 % | 0,46 % | 0,22 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 2,21 % | 3,00 % | 3,05 % | 2,75 % | 3,24 % | 3,45 % |

**31. Dezember 2023**

|   |   |        |        |   |        |   |
|---|---|--------|--------|---|--------|---|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | – | 10,52  | 10,04  | – | 10,55  | – |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |        |        |   |        |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | – | 0,26   | 0,24   | – | 0,27   | – |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | – | 0,60   | 0,56   | – | 0,61   | – |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | – | 0,86   | 0,80   | – | 0,88   | – |
| Ausschüttungen  | – | –      | (0,17) | – | –      | – |
| Schlussnettoinventarwert  | – | 11,38  | 10,67  | – | 11,43  | – |
| Gesamtertrag  | – | 8,17 % | 8,10 % | – | 8,34 % | – |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |   |        |        |   |        |   |
|--------------------------------|---|--------|--------|---|--------|---|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | – | 0,67 % | 0,66 % | – | 0,45 % | – |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | – | 2,39 % | 2,38 % | – | 2,54 % | – |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Euro Bond Absolute Return (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z<br>US\$ |
|---|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 12,04                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,42                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,83                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,25                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 13,29                                     |
| Gesamtertrag  | 10,38 %                                   |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |
|--------------------------------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,22 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,34 % |

**31. Dezember 2023**

|   |         |
|---|---------|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,86   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |         |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,33    |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,85    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,18    |
| Schlussnettoinventarwert  | 12,04   |
| Gesamtertrag  | 10,87 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |
|--------------------------------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,23 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 2,89 % |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## European High Yield Bond

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF I<br>CHF | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I2<br>€ | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I5*<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR X<br>€ |
|---|--|--|---|---|--|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |  |   |   |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,75                                    | 14,01                                  | 10,54                                   | 10,00                                   | 12,68                                  | 12,33                                  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |   |   |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,51                                     | 0,69                                   | 0,54                                    | 0,24                                    | 0,46                                   | 0,65                                   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,21                                     | 0,62                                   | 0,47                                    | 0,26                                    | 0,57                                   | 0,56                                   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,72                                     | 1,31                                   | 1,01                                    | 0,50                                    | 1,03                                   | 1,21                                   |
| Ausschüttungen  | –  | –                                      | –                                       | (0,10)                                  | –                                      | –                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 11,47                                    | 15,32                                  | 11,55                                   | 10,40                                   | 13,71                                  | 13,54                                  |
| Gesamtertrag  | 6,70 %                                   | 9,35 %                                 | 9,58 %                                  | 5,07 %                                  | 8,12 %                                 | 9,81 %                                 |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |   |   |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,69 %                                   | 0,70 %                                 | 0,58 %                                  | 0,39 %                                  | 1,90 %                                 | 0,30 %                                 |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 4,61 %                                   | 4,69 %                                 | 4,79 %                                  | 5,04 %                                  | 3,47 %                                 | 5,07 %                                 |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |  |  |   |   |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,00                                    | 12,34                                  | 10,00                                   | –                                       | 11,31                                  | 10,82                                  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |   |   |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,34                                     | 0,58                                   | 0,07                                    | –                                       | 0,37                                   | 0,56                                   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,41                                     | 1,09                                   | 0,47                                    | –                                       | 1,00                                   | 0,95                                   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,75                                     | 1,67                                   | 0,54                                    | –                                       | 1,37                                   | 1,51                                   |
| Schlussnettoinventarwert  | 10,75                                    | 14,01                                  | 10,54                                   | –                                       | 12,68                                  | 12,33                                  |
| Gesamtertrag  | 7,50 %                                   | 13,53 %                                | 5,40 %                                  | –                                       | 12,11 %                                | 13,96 %                                |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |   |   |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,79 %                                   | 0,82 %                                 | 0,72 %                                  | –                                       | 2,01 %                                 | 0,42 %                                 |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 4,15 %                                   | 4,39 %                                 | 4,91 %                                  | –                                       | 3,08 %                                 | 4,81 %                                 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

European High Yield Bond (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR Y<br>€ | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR Y<br>€ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD A<br>(Monatlich)<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD X<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z<br>US\$ |
|---|--|---------------------------------------|---|---|---|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |                                       |   |   |   |   |
| Eröffnungsbilanzwert  | 11,30                                  | 10,74                                 | 9,25  | 16,49                                     | 13,90                                     | 13,11                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |                                       |   |   |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,61                                   | 0,57                                  | 0,36  | 0,85                                      | 0,71                                      | 0,70                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,51                                   | 0,46                                  | 0,56  | 0,99                                      | 0,91                                      | 0,85                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,12                                   | 1,03                                  | 0,92  | 1,84                                      | 1,62                                      | 1,55                                      |
| Ausschüttungen  | –                                      | (0,54)                                | (0,77)  | –   | –   | –   |
| Schlussbilanzwert   | 12,42                                  | 11,23                                 | 9,40  | 18,33                                     | 15,52                                     | 14,66                                     |
| Gesamtertrag  | 9,91 %                                 | 9,89 %                                | 10,44 %   | 11,16 %                                   | 11,65 %                                   | 11,82 %                                   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |                                       |   |   |   |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,20 %                                 | 0,20 %                                | 1,25 %  | 0,72 %                                    | 0,30 %                                    | 0,10 %                                    |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 5,17 %                                 | 5,20 %                                | 3,92 %  | 4,72 %                                    | 4,84 %                                    | 5,05 %                                    |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |  |                                       |   |   |   |   |
| Eröffnungsbilanzwert  | 10,00                                  | 10,00                                 | 8,63  | 14,23                                     | 11,95                                     | 11,25                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |                                       |   |   |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,52                                   | 0,25                                  | 0,33  | 0,66                                      | 0,63                                      | 0,60                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,78                                   | 0,61                                  | 0,93  | 1,60                                      | 1,32                                      | 1,26                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,30                                   | 0,86                                  | 1,26  | 2,26                                      | 1,95                                      | 1,86                                      |
| Ausschüttungen  | –                                      | (0,12)                                | (0,64)  | –   | –   | –   |
| Schlussbilanzwert   | 11,30                                  | 10,74                                 | 9,25  | 16,49                                     | 13,90                                     | 13,11                                     |
| Gesamtertrag  | 13,00 %                                | 8,72 %                                | 15,17 %   | 15,88 %                                   | 16,32 %                                   | 16,53 %                                   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |                                       |   |   |   |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,31 %                                 | 0,31 %                                | 1,44 %  | 0,83 %                                    | 0,43 %                                    | 0,22 %                                    |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 4,92 %                                 | 4,79 %                                | 3,74 %  | 4,36 %                                    | 4,94 %                                    | 4,98 %                                    |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## European Sustainable Equity

|   | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR A<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I<br>€ | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I<br>€ | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I3<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I5<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M<br>€ |
|---|---------------------------------------|--|---------------------------------------|--|---|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |                                       |  |                                       |  |   |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 9,34                                  | 10,84                                  | 10,75                                 | 9,21                                   | 9,49                                    | 10,33                                  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |                                       |  |                                       |  |   |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,03)                                | 0,07                                   | 0,07                                  | 0,09                                   | 0,09                                    | (0,13)                                 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,44                                  | 0,50                                   | 0,49                                  | 0,41                                   | 0,45                                    | 0,49                                   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,41                                  | 0,57                                   | 0,56                                  | 0,50                                   | 0,54                                    | 0,36                                   |
| Ausschüttungen  | –                                     | –                                      | (0,05)                                | (0,06)                                 | –                                       | –                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 9,75                                  | 11,41                                  | 11,26                                 | 9,65                                   | 10,03                                   | 10,69                                  |
| Gesamtertrag  | 4,39 %                                | 5,26 %                                 | 5,30 %                                | 5,48 %                                 | 5,69 %                                  | 3,48 %                                 |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |                                       |  |                                       |  |   |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,62 %                                | 0,73 %                                 | 0,71 %                                | 0,55 %                                 | 0,43 %                                  | 2,44 %                                 |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | (0,28 %)                              | 0,65 %                                 | 0,63 %                                | 0,89 %                                 | 0,87 %                                  | (1,18 %)                               |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |                                       |  |                                       |  |   |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 7,93                                  | 9,11                                   | 9,09                                  | 7,79                                   | 7,96                                    | 8,83                                   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |                                       |  |                                       |  |   |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,04)                                | 0,05                                   | 0,05                                  | 0,06                                   | 0,07                                    | (0,12)                                 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 1,45                                  | 1,68                                   | 1,67                                  | 1,42                                   | 1,46                                    | 1,62                                   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,41                                  | 1,73                                   | 1,72                                  | 1,48                                   | 1,53                                    | 1,50                                   |
| Ausschüttungen  | –                                     | –                                      | (0,06)                                | (0,06)                                 | –                                       | –                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 9,34                                  | 10,84                                  | 10,75                                 | 9,21                                   | 9,49                                    | 10,33                                  |
| Gesamtertrag  | 17,78 %                               | 18,99 %                                | 19,00 %                               | 19,19 %                                | 19,22 %                                 | 16,99 %                                |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |                                       |  |                                       |  |   |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,64 %                                | 0,75 %                                 | 0,72 %                                | 0,57 %                                 | 0,45 %                                  | 2,45 %                                 |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | (0,41 %)                              | 0,52 %                                 | 0,55 %                                | 0,65 %                                 | 0,81 %                                  | (1,24 %)                               |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

European Sustainable Equity (Fortsetzung)

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR Z<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A (nicht<br>währungsgesichert)<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I (nicht<br>währungsgesichert)<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M (nicht<br>währungsgesichert)<br>US\$ |
|--|--|--|--|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>   |  |  |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert  | 10,92                                  | 9,80   | 10,04  | 9,58   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:  |  |  |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>  | 0,14                                   | (0,02)   | 0,06   | (0,10)   |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,51                                   | (0,19)   | (0,19)   | (0,18)   |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit   | 0,65                                   | (0,21)   | (0,13)   | (0,28)   |
| Schlussnettoinventarwert   | 11,57                                  | 9,59   | 9,91   | 9,30   |
| Gesamtertrag   | 5,95 %                                 | (2,14 %)   | (1,29 %)   | (2,92 %)   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>   |  |  |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>   | 0,13 %                                 | 1,52 %   | 0,66 %   | 2,29 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)   | 1,21 %                                 | (0,24 %)   | 0,62 %   | (1,01 %)   |
| <b>31. Dezember 2023</b>   |  |  |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert  | 9,12                                   | 8,03   | 8,15   | 7,91   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:  |  |  |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>  | 0,12                                   | (0,03)   | (0,04)   | (0,10)   |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 1,68                                   | 1,80   | 1,93   | 1,77   |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit   | 1,80                                   | 1,77   | 1,89   | 1,67   |
| Schlussnettoinventarwert   | 10,92                                  | 9,80   | 10,04  | 9,58   |
| Gesamtertrag   | 19,74 %                                | 22,04 %  | 23,19 %  | 21,11 %  |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>   |  |  |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>   | 0,15 %                                 | 1,66 %   | 0,75 %   | 2,48 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)   | 1,17 %                                 | (0,37 %)   | (0,43 %)   | (1,18 %)   |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Event Driven

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I<br>€ | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I5*<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I5<br>£ | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP I5<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP P<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>JPY I*<br>¥ |
|---|--|---|---|--|--|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |   |   |  |  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,31                                  | 10,00                                   | 10,54                                   | 10,55                                  | 10,50                                  | 1.000,00                                |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |   |   |  |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (2,63)                                 | (1,13)                                  | (0,04)                                  | (0,11)                                 | (0,23)                                 | 3,90                                    |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 3,13                                   | 1,65                                    | 0,92                                    | 0,85                                   | 0,95                                   | (7,52)                                  |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,50                                   | 0,52                                    | 0,88                                    | 0,74                                   | 0,72                                   | (3,62)                                  |
| Schlussnettoinventarwert  | 10,81                                  | 10,52                                   | 11,42                                   | 11,29                                  | 11,22                                  | 996,38                                  |
| Gesamtertrag  | 4,85 %                                 | 5,20 %                                  | 8,35 %                                  | 7,01 %                                 | 6,86 %                                 | (0,36 %)                                |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |           |           |          |          |          |        |
|--------------------------------|-----------|-----------|----------|----------|----------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 27,64 %   | 21,38 %   | 2,71 %   | 3,68 %   | 4,45 %   | 1,13 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (24,42 %) | (17,51 %) | (0,38 %) | (1,01 %) | (2,09 %) | 2,12 % |

**31. Dezember 2023**

|   |        |   |        |        |        |   |
|---|--------|---|--------|--------|--------|---|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,00  | – | 10,11  | 10,11  | 10,10  | – |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |        |   |        |        |        |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,05) | – | (0,17) | (0,12) | (0,18) | – |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,36   | – | 0,60   | 0,56   | 0,58   | – |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,31   | – | 0,43   | 0,44   | 0,40   | – |
| Schlussnettoinventarwert  | 10,31  | – | 10,54  | 10,55  | 10,50  | – |
| Gesamtertrag  | 3,10 % | – | 4,25 % | 4,35 % | 3,96 % | – |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |          |   |          |          |          |   |
|--------------------------------|----------|---|----------|----------|----------|---|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 1,23 %   | – | 2,28 %   | 1,78 %   | 2,35 %   | – |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,55 %) | – | (1,65 %) | (1,15 %) | (1,73 %) | – |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Event Driven (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I5<br>US\$ |
|---|---|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,55                                     | 10,61                                      |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,10)                                    | (0,08)                                     |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,96                                      | 0,94                                       |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,86                                      | 0,86                                       |
| Schlussnettoinventarwert  | 11,41                                     | 11,47                                      |
| Gesamtertrag  | 8,15 %                                    | 8,11 %                                     |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |          |          |
|--------------------------------|----------|----------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 3,08 %   | 3,19 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,91 %) | (0,71 %) |

**31. Dezember 2023**

|   |        |        |
|---|--------|--------|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,12  | 10,13  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |        |        |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,31) | (0,16) |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,74   | 0,64   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,43   | 0,48   |
| Schlussnettoinventarwert  | 10,55  | 10,61  |
| Gesamtertrag  | 4,25 % | 4,74 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |          |          |
|--------------------------------|----------|----------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 3,55 %   | 2,22 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (3,06 %) | (1,58 %) |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Global Bond

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I Benchmark<br>Währungs-<br>gesicherte Klasse<br>€ | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP P*<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD C1<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I Benchmark<br>Währungs-<br>gesicherte Klasse<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M<br>US\$ |
|---|--|--|--|---|---|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |  |  |   |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,40  | 10,00                                  | 9,02                                       | 10,98   | 10,26                                     | 9,54                                      |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |  |   |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,39   | 0,14                                   | 0,21                                       | 0,40  | 0,36                                      | 0,28                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | (0,20)   | (0,44)                                 | (0,44)                                     | (0,06)  | (0,50)                                    | (0,47)                                    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,19   | (0,30)                                 | (0,23)                                     | 0,34  | (0,14)                                    | (0,19)                                    |
| Ausschüttungen  | –  | (0,04)                                 | –  | –   | –   | –   |
| Schlussnettoinventarwert  | 10,59  | 9,66                                   | 8,79                                       | 11,32   | 10,12                                     | 9,35                                      |
| Gesamtertrag  | 1,83 %   | (3,00 %)                               | (2,55 %)                                   | 3,10 %  | (1,36 %)                                  | (1,99 %)                                  |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |  |   |   |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,43 %   | 0,42 %                                 | 1,62 %                                     | 0,42 %  | 0,42 %                                    | 1,02 %                                    |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 3,72 %   | 3,63 %                                 | 2,37 %                                     | 3,57 %  | 3,58 %                                    | 2,97 %                                    |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |  |  |  |   |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,00  | –                                      | 8,57                                       | 10,18   | 9,63                                      | 9,00                                      |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |  |   |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,11   | –                                      | 0,18                                       | 0,35  | 0,32                                      | 0,25                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,29   | –                                      | 0,27                                       | 0,45  | 0,31                                      | 0,29                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,40   | –                                      | 0,45                                       | 0,80  | 0,63                                      | 0,54                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 10,40  | –                                      | 9,02                                       | 10,98   | 10,26                                     | 9,54                                      |
| Gesamtertrag  | 4,00 %   | –                                      | 5,25 %                                     | 7,86 %  | 6,54 %                                    | 6,00 %                                    |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |  |   |   |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,41 %   | –                                      | 1,61 %                                     | 0,36 %  | 0,41 %                                    | 1,01 %                                    |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 3,38 %   | –                                      | 2,07 %                                     | 3,33 %  | 3,34 %                                    | 2,73 %                                    |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global Bond (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z<br>US\$ |
|---|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,79                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,40                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | (0,53)                                    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | (0,13)                                    |
| Schlussnettoinventarwert  | 10,66                                     |
| Gesamtertrag  | (1,20 %)                                  |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |
|--------------------------------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,22 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,76 % |

**31. Dezember 2023**

|   |        |
|---|--------|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,10  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |        |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,35   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,34   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,69   |
| Schlussnettoinventarwert  | 10,79  |
| Gesamtertrag  | 6,83 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |
|--------------------------------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,22 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,46 % |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Global Equity Megatrends

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A (nicht<br>währungs-<br>gesichert)*<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M (nicht<br>währungsgesichert)<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I4 (nicht<br>währungs-<br>gesichert)*<br>£ | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP I4 (nicht<br>währungs-<br>gesichert)*<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP P (nicht<br>währungs-<br>gesichert)<br>£ |
|---|---|--|---|--|---|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |  |   |  |   |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,00   | 9,95                                   | 15,99   | 10,00  | 10,00   | 10,63  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |   |  |   |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,02  | 0,03                                   | (0,25)  | 0,04   | 0,04  | 0,08   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 1,34  | 3,12                                   | 4,98  | 0,86   | 1,10  | 2,66   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,36  | 3,15                                   | 4,73  | 0,90   | 1,14  | 2,74   |
| Ausschüttungen  | –   | –                                      | –   | –  | (0,01)  | –  |
| Schlussnettoinventarwert  | 11,36   | 13,10                                  | 20,72   | 10,90  | 11,13   | 13,37  |
| Gesamtertrag  | 13,60 %   | 31,66 %                                | 29,58 %   | 9,00 %   | 11,38 %   | 25,78 %  |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |  |   |  |   |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,87 %  | 1,01 %                                 | 2,68 %  | 0,65 %   | 0,65 %  | 0,95 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 0,35 %  | 0,29 %                                 | (1,34 %)  | 0,66 %   | 0,67 %  | 0,63 %   |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |   |  |   |  |   |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | –   | 10,00                                  | 13,68   | –  | –   | 10,00  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |   |  |   |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | –   | 0,00                                   | (0,23)  | –  | –   | 0,01   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | –   | (0,05)                                 | 2,54  | –  | –   | 0,62   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | –   | (0,05)                                 | 2,31  | –  | –   | 0,63   |
| Schlussnettoinventarwert  | –   | 9,95                                   | 15,99   | –  | –   | 10,63  |
| Gesamtertrag  | –   | (0,50 %)                               | 16,89 %   | –  | –   | 6,30 %   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |  |   |  |   |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | –   | 1,07 %                                 | 2,70 %  | –  | –   | 1,04 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | –   | 0,91 %                                 | (1,56 %)  | –  | –   | 0,14 %   |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global Equity Megatrends (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>HKD A*<br>HKD | Thesaurierende<br>Klasse<br>SGD A<br>SGD | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD C1<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I4*<br>US\$ |
|---|---|--|---|--|---|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |  |   |  |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,00                                     | 20,85                                    | 15,15                                     | 14,33                                      | 15,99                                     | 10,00                                       |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |   |  |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,00                                      | 0,06                                     | (0,09)                                    | (0,25)                                     | 0,06                                      | 0,06  |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,03                                      | 4,19                                     | 3,50                                      | 3,29                                       | 3,70                                      | 1,43  |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,03                                      | 4,25                                     | 3,41                                      | 3,04                                       | 3,76                                      | 1,49  |
| Schlussnettoinventarwert  | 10,03                                     | 25,10                                    | 18,56                                     | 17,37                                      | 19,75                                     | 11,49                                       |
| Gesamtertrag  | 0,30 %                                    | 20,38 %                                  | 22,51 %                                   | 21,21 %                                    | 23,51 %                                   | 14,90 %                                     |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |          |        |          |          |        |        |
|--------------------------------|----------|--------|----------|----------|--------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 1,81 %   | 1,85 % | 1,77 %   | 2,78 %   | 0,97 % | 0,63 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,06 %) | 0,22 % | (0,49 %) | (1,55 %) | 0,30 % | 0,74 % |

**31. Dezember 2023**

|   |   |        |         |         |         |   |
|---|---|--------|---------|---------|---------|---|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | – | 20,00  | 12,43   | 11,87   | 13,01   | – |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |        |         |         |         |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | – | 0,00   | (0,11)  | (0,24)  | 0,02    | – |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | – | 0,85   | 2,83    | 2,70    | 2,96    | – |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | – | 0,85   | 2,72    | 2,46    | 2,98    | – |
| Schlussnettoinventarwert  | – | 20,85  | 15,15   | 14,33   | 15,99   | – |
| Gesamtertrag  | – | 4,25 % | 21,88 % | 20,72 % | 22,91 % | – |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |   |        |          |          |        |   |
|--------------------------------|---|--------|----------|----------|--------|---|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | – | 2,02 % | 1,96 %   | 2,95 %   | 1,11 % | – |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | – | 0,12 % | (0,81 %) | (1,83 %) | 0,14 % | – |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Global Equity Megatrends (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD U*<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z<br>US\$ |
|---|---|--|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 14,39                                     | 10,00                                      | 10,87                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,21)                                    | 0,00                                       | 0,14                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 3,31                                      | (0,16)                                     | 2,52                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 3,10                                      | (0,16)                                     | 2,66                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 17,49                                     | 9,84                                       | 13,53                                     |
| Gesamtertrag  | 21,54 %                                   | (1,60 %)                                   | 24,47 %                                   |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |          |        |        |
|--------------------------------|----------|--------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 2,57 %   | 1,35 % | 0,17 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (1,28 %) | 0,07 % | 1,10 % |

**31. Dezember 2023**

|   |         |   |         |
|---|---------|---|---------|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 11,90   | – | 8,77    |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |         |   |         |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,21)  | – | 0,10    |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 2,70    | – | 2,00    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 2,49    | – | 2,10    |
| Schlussnettoinventarwert  | 14,39   | – | 10,87   |
| Gesamtertrag  | 20,92 % | – | 23,95 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |          |   |        |
|--------------------------------|----------|---|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 2,75 %   | – | 0,26 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (1,62 %) | – | 0,96 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global Flexible Credit Income

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>CAD I5<br>CAD | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I5<br>£ | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP P*<br>£ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD A<br>(Monatlich)*<br>US\$ |
|---|---|--|--|---|--|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |  |  |   |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,47                                     | 10,66                                  | 10,05                                  | 11,76                                   | 10,00                                  | 10,00  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |  |   |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,69                                      | 0,66                                   | 0,47                                   | 0,75                                    | 0,23                                   | 0,48   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,14                                      | 0,04                                   | 0,04                                   | 0,24                                    | (0,03)                                 | 0,25   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,83                                      | 0,70                                   | 0,51                                   | 0,99                                    | 0,20                                   | 0,73   |
| Ausschüttungen  | –   | –                                      | –                                      | –                                       | (0,07)                                 | (0,66)   |
| Schlussnettoinventarwert  | 11,30                                     | 11,36                                  | 10,56                                  | 12,75                                   | 10,13                                  | 10,07  |
| Gesamtertrag  | 7,93 %                                    | 6,57 %                                 | 5,07 %                                 | 8,42 %                                  | 2,00 %                                 | 7,51 %   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |  |  |   |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,43 %                                    | 0,75 %                                 | 2,20 %                                 | 0,42 %                                  | 0,69 %                                 | 1,31 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 6,32 %                                    | 6,00 %                                 | 4,56 %                                 | 6,15 %                                  | 6,04 %                                 | 5,25 %   |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |   |  |  |   |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 9,34                                      | 9,69                                   | 9,25                                   | 10,49                                   | –                                      | –  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |  |   |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,55                                      | 0,54                                   | 0,38                                   | 0,62                                    | –                                      | –  |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,58                                      | 0,43                                   | 0,42                                   | 0,65                                    | –                                      | –  |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,13                                      | 0,97                                   | 0,80                                   | 1,27                                    | –                                      | –  |
| Schlussnettoinventarwert  | 10,47                                     | 10,66                                  | 10,05                                  | 11,76                                   | –                                      | –  |
| Gesamtertrag  | 12,10 %                                   | 10,01 %                                | 8,65 %                                 | 12,11 %                                 | –                                      | –  |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |  |  |   |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,41 %                                    | 0,70 %                                 | 2,08 %                                 | 0,41 %                                  | –                                      | –  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 5,68 %                                    | 5,38 %                                 | 4,03 %                                 | 5,67 %                                  | –                                      | –  |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Global Flexible Credit Income (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD U*<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z<br>US\$ |
|---|---|---|--|---|--|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |   |  |   |  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,89                                     | 11,86                                     | 10,15                                    | 10,60                                     | 10,00                                      | 12,11                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |   |  |   |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,59                                      | 0,71                                      | 0,59                                     | 0,48                                      | 0,13                                       | 0,80                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,26                                      | 0,29                                      | 0,25                                     | 0,26                                      | (0,07)                                     | 0,30                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,85                                      | 1,00                                      | 0,84                                     | 0,74                                      | 0,06                                       | 1,10                                      |
| Ausschüttungen  | –   | –   | (0,56)                                   | –   | –  | –   |
| Schlussnettoinventarwert  | 11,74                                     | 12,86                                     | 10,43                                    | 11,34                                     | 10,06                                      | 13,21                                     |
| Gesamtertrag  | 7,81 %                                    | 8,43 %                                    | 8,53 %                                   | 6,98 %                                    | 0,60 %                                     | 9,08 %                                    |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |   |  |   |  |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,31 %                                    | 0,71 %                                    | 0,71 %                                   | 2,11 %                                    | 1,00 %                                     | 0,11 %                                    |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 5,16 %                                    | 5,73 %                                    | 5,78 %                                   | 4,35 %                                    | 5,59 %                                     | 6,33 %                                    |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |   |   |  |   |  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 9,74                                      | 10,54                                     | 9,53                                     | 9,56                                      | –  | 10,70                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |   |  |   |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,50                                      | 0,61                                      | 0,53                                     | 0,41                                      | –  | 0,69                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,65                                      | 0,71                                      | 0,61                                     | 0,63                                      | –  | 0,72                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,15                                      | 1,32                                      | 1,14                                     | 1,04                                      | –  | 1,41                                      |
| Ausschüttungen  | –   | –   | (0,52)                                   | –   | –  | –   |
| Schlussnettoinventarwert  | 10,89                                     | 11,86                                     | 10,15                                    | 10,60                                     | –  | 12,11                                     |
| Gesamtertrag  | 11,81 %                                   | 12,52 %                                   | 12,43 %                                  | 10,88 %                                   | –  | 13,18 %                                   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |   |  |   |  |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,32 %                                    | 0,72 %                                    | 0,72 %                                   | 2,12 %                                    | –  | 0,12 %                                    |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 4,92 %                                    | 5,52 %                                    | 5,52 %                                   | 4,12 %                                    | –  | 6,11 %                                    |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global High Yield Engagement

|   | Ausschüttende<br>Klasse<br>AUD I<br>AUD | Thesaurierende<br>Klasse<br>AUD I4*<br>AUD | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF I4<br>CHF | Ausschüttende<br>Klasse<br>CHF I4<br>CHF | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF X<br>CHF | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I4<br>€ |
|---|---|--|---|--|--|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |  |   |  |  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 9,65                                    | 10,00                                      | 10,11                                     | 9,36                                     | 10,00                                    | 10,29                                   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |   |  |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,58                                    | 0,57                                       | 0,62                                      | 0,56                                     | 0,54                                     | 0,65                                    |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,10                                    | 0,14                                       | (0,17)                                    | (0,17)                                   | (0,18)                                   | 0,07                                    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,68                                    | 0,71                                       | 0,45                                      | 0,39                                     | 0,36                                     | 0,72                                    |
| Ausschüttungen  | (0,50)                                  | –  | –   | (0,53)                                   | –  | –                                       |
| Schlussnettoinventarwert  | 9,83                                    | 10,71                                      | 10,56                                     | 9,22                                     | 10,36                                    | 11,01                                   |
| Gesamtertrag  | 7,30 %                                  | 7,10 %                                     | 4,45 %                                    | 4,34 %                                   | 3,60 %                                   | 7,00 %                                  |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |        |        |        |        |        |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,74 % | 0,50 % | 0,50 % | 0,50 % | 1,24 % | 0,51 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 6,00 % | 6,16 % | 6,02 % | 6,02 % | 5,28 % | 6,10 % |

**31. Dezember 2023**

|   |        |   |        |        |        |        |
|---|--------|---|--------|--------|--------|--------|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 9,36   | – | 9,53   | 9,32   | 9,49   | 9,51   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |        |   |        |        |        |        |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,48   | – | 0,50   | 0,47   | 0,43   | 0,53   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,29   | – | 0,08   | 0,07   | 0,08   | 0,25   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,77   | – | 0,58   | 0,54   | 0,51   | 0,78   |
| Ausschüttungen  | (0,48) | – | –      | (0,50) | –      | –      |
| Schlussnettoinventarwert  | 9,65   | – | 10,11  | 9,36   | 10,00  | 10,29  |
| Gesamtertrag  | 8,54 % | – | 6,09 % | 6,10 % | 5,37 % | 8,20 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |   |        |        |        |        |
|--------------------------------|--------|---|--------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,70 % | – | 0,45 % | 0,45 % | 1,14 % | 0,47 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 5,12 % | – | 5,18 % | 5,18 % | 4,47 % | 5,39 % |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Global High Yield Engagement (Fortsetzung)

|   | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I4<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR X<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR Z (PF)<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I4<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP X<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A<br>US\$ |
|---|--|--|---|---|--|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |  |   |   |  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 9,52                                   | 10,16                                  | 11,58                                       | 10,59                                   | 10,46                                  | 12,38                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |   |   |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,58                                   | 0,56                                   | 0,77  | 0,66                                    | 0,57                                   | 0,64                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,07                                   | 0,07                                   | 0,08  | 0,24                                    | 0,24                                   | 0,34                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,65                                   | 0,63                                   | 0,85  | 0,90                                    | 0,81                                   | 0,98                                      |
| Ausschüttungen  | (0,55)                                 | –                                      | –   | –                                       | –                                      | –   |
| Schlussnettoinventarwert  | 9,62                                   | 10,79                                  | 12,43                                       | 11,49                                   | 11,27                                  | 13,36                                     |
| Gesamtertrag  | 7,04 %                                 | 6,20 %                                 | 7,34 %                                      | 8,50 %                                  | 7,74 %                                 | 7,92 %                                    |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |   |   |  |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,51 %                                 | 1,25 %                                 | 0,22 %                                      | 0,49 %                                  | 1,22 %                                 | 1,31 %                                    |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 6,11 %                                 | 5,32 %                                 | 6,37 %                                      | 5,96 %                                  | 5,23 %                                 | 4,95 %                                    |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |  |  |   |   |  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 9,30                                   | 9,46                                   | 10,68                                       | 9,63                                    | 9,59                                   | 11,29                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |   |   |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,50                                   | 0,45                                   | 0,62  | 0,54                                    | 0,46                                   | 0,54                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,22                                   | 0,25                                   | 0,28  | 0,42                                    | 0,41                                   | 0,55                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,72                                   | 0,70                                   | 0,90  | 0,96                                    | 0,87                                   | 1,09                                      |
| Ausschüttungen  | (0,50)                                 | –                                      | –   | –                                       | –                                      | –   |
| Schlussnettoinventarwert  | 9,52                                   | 10,16                                  | 11,58                                       | 10,59                                   | 10,46                                  | 12,38                                     |
| Gesamtertrag  | 8,10 %                                 | 7,40 %                                 | 8,43 %                                      | 9,97 %                                  | 9,07 %                                 | 9,65 %                                    |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |   |   |  |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,47 %                                 | 1,19 %                                 | 0,21 %                                      | 0,47 %                                  | 1,18 %                                 | 1,31 %                                    |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 5,39 %                                 | 4,66 %                                 | 5,64 %                                      | 5,40 %                                  | 4,65 %                                 | 4,61 %                                    |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global High Yield Engagement (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I4<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD M<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD X<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z<br>US\$ |
|---|---|--|--|---|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |  |  |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 13,08                                     | 10,73                                      | 7,92                                     | 10,46                                     | 13,68                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |  |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,76                                      | 0,65                                       | 0,35                                     | 0,56                                      | 0,89                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,36                                      | 0,29                                       | 0,21                                     | 0,28                                      | 0,37                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,12                                      | 0,94                                       | 0,56                                     | 0,84                                      | 1,26                                      |
| Ausschüttungen  | –   | –  | (0,49)                                   | –   | –   |
| Schlussnettoinventarwert  | 14,20                                     | 11,67                                      | 7,99                                     | 11,30                                     | 14,94                                     |
| Gesamtertrag  | 8,56 %                                    | 8,76 %                                     | 7,41 %                                   | 8,03 %                                    | 9,21 %                                    |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |        |        |        |        |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,71 % | 0,48 % | 1,91 % | 1,20 % | 0,11 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 5,59 % | 5,83 % | 4,41 % | 5,13 % | 6,20 % |

**31. Dezember 2023**

|   |         |         |        |        |         |
|---|---------|---------|--------|--------|---------|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 11,86   | 9,70    | 7,72   | 9,53   | 12,32   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |         |         |        |        |         |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,66    | 0,55    | 0,31   | 0,47   | 0,75    |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,56    | 0,48    | 0,35   | 0,46   | 0,61    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,22    | 1,03    | 0,66   | 0,93   | 1,36    |
| Ausschüttungen  | –       | –       | (0,46) | –      | –       |
| Schlussnettoinventarwert  | 13,08   | 10,73   | 7,92   | 10,46  | 13,68   |
| Gesamtertrag  | 10,29 % | 10,62 % | 8,93 % | 9,76 % | 11,04 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |        |        |        |        |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,71 % | 0,48 % | 1,91 % | 1,21 % | 0,11 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 5,35 % | 5,51 % | 4,06 % | 4,76 % | 5,86 % |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Global Investment Grade Credit

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I<br>€ | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP P*<br>£ | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP X*<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD X<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z<br>US\$ |
|---|--|--|--|---|---|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |  |  |   |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,51                                  | 10,00                                  | 10,00                                  | 9,25                                      | 9,29                                      | 9,31                                      |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |  |   |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,46                                   | 0,19                                   | 0,14                                   | 0,40                                      | 0,41                                      | 0,42                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | (0,17)                                 | 0,06                                   | (0,22)                                 | 0,02                                      | 0,04                                      | 0,04                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,29                                   | 0,25                                   | (0,08)                                 | 0,42                                      | 0,45                                      | 0,46                                      |
| Ausschüttungen  | –                                      | (0,08)                                 | (0,03)                                 | –   | –   | –   |
| Schlussnettoinventarwert  | 10,80                                  | 10,17                                  | 9,89                                   | 9,67                                      | 9,74                                      | 9,77                                      |
| Gesamtertrag  | 2,76 %                                 | 2,45 %                                 | (0,83 %)                               | 4,54 %                                    | 4,84 %                                    | 4,94 %                                    |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |  |   |   |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,44 %                                 | 0,47 %                                 | 0,21 %                                 | 0,47 %                                    | 0,25 %                                    | 0,16 %                                    |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 4,36 %                                 | 4,27 %                                 | 4,60 %                                 | 4,21 %                                    | 4,35 %                                    | 4,42 %                                    |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |  |  |  |   |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,00                                  | –                                      | –                                      | 8,44                                      | 8,46                                      | 8,47                                      |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |  |   |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,17                                   | –                                      | –                                      | 0,32                                      | 0,34                                      | 0,35                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,34                                   | –                                      | –                                      | 0,49                                      | 0,49                                      | 0,49                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,51                                   | –                                      | –                                      | 0,81                                      | 0,83                                      | 0,84                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 10,51                                  | –                                      | –                                      | 9,25                                      | 9,29                                      | 9,31                                      |
| Gesamtertrag  | 5,10 %                                 | –                                      | –                                      | 9,60 %                                    | 9,81 %                                    | 9,92 %                                    |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |  |   |   |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,45 %                                 | –                                      | –                                      | 0,47 %                                    | 0,27 %                                    | 0,17 %                                    |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 3,94 %                                 | –                                      | –                                      | 3,72 %                                    | 3,90 %                                    | 4,01 %                                    |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global Opportunistic Bond

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP P<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I2<br>US\$ |
|---|--|--|---|---|--|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |  |   |   |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 9,68                                   | 9,83                                   | 10,83                                     | 11,59                                     | 9,80                                     | 10,97                                      |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |   |   |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,33                                   | 0,42                                   | 0,40                                      | 0,48                                      | 0,40                                     | 0,45                                       |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | (0,25)                                 | (0,18)                                 | (0,14)                                    | (0,18)                                    | (0,15)                                   | (0,16)                                     |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,08                                   | 0,24                                   | 0,26                                      | 0,30                                      | 0,25                                     | 0,29                                       |
| Ausschüttungen  | –                                      | –                                      | –   | –   | (0,29)                                   | –  |
| Schlussnettoinventarwert  | 9,76                                   | 10,07                                  | 11,09                                     | 11,89                                     | 9,76                                     | 11,26                                      |
| Gesamtertrag  | 0,83 %                                 | 2,44 %                                 | 2,40 %                                    | 2,59 %                                    | 2,60 %                                   | 2,64 %                                     |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |   |   |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,54 %                                 | 0,51 %                                 | 0,82 %                                    | 0,51 %                                    | 0,52 %                                   | 0,45 %                                     |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 3,43 %                                 | 4,19 %                                 | 3,71 %                                    | 4,13 %                                    | 4,08 %                                   | 4,09 %                                     |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |  |  |   |   |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 8,72                                   | 9,31                                   | 10,22                                     | 10,91                                     | 9,50                                     | 10,32                                      |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |   |   |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,31                                   | 0,36                                   | 0,38                                      | 0,43                                      | 0,36                                     | 0,41                                       |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,65                                   | 0,16                                   | 0,23                                      | 0,25                                      | 0,22                                     | 0,24                                       |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,96                                   | 0,52                                   | 0,61                                      | 0,68                                      | 0,58                                     | 0,65                                       |
| Ausschüttungen  | –                                      | –                                      | –   | –   | (0,28)                                   | –  |
| Schlussnettoinventarwert  | 9,68                                   | 9,83                                   | 10,83                                     | 11,59                                     | 9,80                                     | 10,97                                      |
| Gesamtertrag  | 11,01 %                                | 5,59 %                                 | 5,97 %                                    | 6,23 %                                    | 6,30 %                                   | 6,30 %                                     |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |   |   |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,51 %                                 | 0,49 %                                 | 0,82 %                                    | 0,51 %                                    | 0,51 %                                   | 0,45 %                                     |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 3,47 %                                 | 3,76 %                                 | 3,63 %                                    | 3,83 %                                    | 3,81 %                                   | 3,91 %                                     |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Global Opportunistic Bond (Fortsetzung)

|   | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I2*<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z<br>US\$ |
|---|--|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,00                                      | 10,70                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,08                                       | 0,47                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | (0,07)                                     | (0,15)                                    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,01                                       | 0,32                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 10,01                                      | 11,02                                     |
| Gesamtertrag  | 0,10 %                                     | 2,99 %                                    |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |        |
|--------------------------------|--------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,45 % | 0,22 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 4,36 % | 4,37 % |

**31. Dezember 2023**

|   |   |        |
|---|---|--------|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | – | 10,04  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |        |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | – | 0,42   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | – | 0,24   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | – | 0,66   |
| Ausschüttungen  | – | –      |
| Schlussnettoinventarwert  | – | 10,70  |
| Gesamtertrag  | – | 6,57 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |   |        |
|--------------------------------|---|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | – | 0,21 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | – | 4,14 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global Sustainable Equity

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I5 (nicht<br>währungsgesichert)<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M (nicht<br>währungs-<br>gesichert)<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR Z (nicht<br>währungsgesichert)<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I (nicht<br>währungsgesichert)<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I5 (nicht<br>währungsgesichert)<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A<br>US\$ |
|--|--|--|---|---|--|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>   |  |  |   |   |  |   |
| Eröffnungsinventarwert   | 12,11  | 11,43  | 11,72   | 11,49   | 11,59  | 8,92                                      |
| Erträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit:   |  |  |   |   |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>  | 0,04   | (0,22)   | 0,08  | 0,00  | 0,04   | (0,08)                                    |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus<br>Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 1,79   | 1,69   | 1,73  | 1,10  | 1,10   | 0,66                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit  | 1,83   | 1,47   | 1,81  | 1,10  | 1,14   | 0,58                                      |
| Schlussinventarwert  | 13,94  | 12,90  | 13,53   | 12,59   | 12,73  | 9,50                                      |
| Gesamtertrag   | 15,11 %  | 12,86 %  | 15,44 %   | 9,57 %  | 9,84 %   | 6,50 %                                    |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>   |  |  |   |   |  |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>   | 0,46 %   | 2,55 %   | 0,15 %  | 0,76 %  | 0,45 %   | 1,62 %                                    |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)   | 0,30 %   | (1,79 %)   | 0,62 %  | (0,04 %)  | 0,29 %   | (0,88 %)                                  |
| <b>31. Dezember 2023</b>   |  |  |   |   |  |   |
| Eröffnungsinventarwert   | 10,10  | 9,73   | 9,75  | 9,85  | 9,90   | 7,28                                      |
| Erträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit:   |  |  |   |   |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>  | 0,02   | (0,18)   | 0,05  | (0,01)  | 0,02   | (0,08)                                    |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus<br>Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 1,99   | 1,88   | 1,92  | 1,65  | 1,67   | 1,72                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit  | 2,01   | 1,70   | 1,97  | 1,64  | 1,69   | 1,64                                      |
| Schlussinventarwert  | 12,11  | 11,43  | 11,72   | 11,49   | 11,59  | 8,92                                      |
| Gesamtertrag   | 19,90 %  | 17,47 %  | 20,21 %   | 16,65 %   | 17,07 %  | 22,53 %                                   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>   |  |  |   |   |  |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>   | 0,47 %   | 2,43 %   | 0,17 %  | 0,76 %  | 0,47 %   | 1,67 %                                    |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)   | 0,22 %   | (1,75 %)   | 0,51 %  | (0,08 %)  | 0,21 %   | (0,97 %)                                  |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Global Sustainable Equity (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z<br>US\$ |
|---|---|--|---|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |  |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,93                                     | 10,94                                    | 10,38                                     | 10,35                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,00                                      | 0,00                                     | (0,19)                                    | 0,07                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,84                                      | 0,83                                     | 0,79                                      | 0,79                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,84                                      | 0,83                                     | 0,60                                      | 0,86                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 11,77                                     | 11,77                                    | 10,98                                     | 11,21                                     |
| Gesamtertrag  | 7,69 %                                    | 7,59 %                                   | 5,78 %                                    | 8,31 %                                    |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |  |   |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,73 %                                    | 0,74 %                                   | 2,43 %                                    | 0,14 %                                    |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 0,04 %                                    | 0,00 %                                   | (1,77 %)                                  | 0,61 %                                    |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |   |  |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 8,83                                      | 8,84                                     | 8,54                                      | 8,32                                      |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,01)                                    | (0,01)                                   | (0,17)                                    | 0,05                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 2,11                                      | 2,11                                     | 2,01                                      | 1,98                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 2,10                                      | 2,10                                     | 1,84                                      | 2,03                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 10,93                                     | 10,94                                    | 10,38                                     | 10,35                                     |
| Gesamtertrag  | 23,78 %                                   | 23,76 %                                  | 21,55 %                                   | 24,40 %                                   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |  |   |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,78 %                                    | 0,75 %                                   | 2,48 %                                    | 0,18 %                                    |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | (0,08 %)                                  | (0,06 %)                                 | (1,78 %)                                  | 0,51 %                                    |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global Value

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I5 (nicht<br>währungsgesichert)<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP P (nicht<br>währungsgesichert)<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z<br>US\$ |
|--|--|--|---|---|---|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>   |  |  |   |   |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert  | 15,76                                  | 11,12  | 10,70   | 18,39                                     | 19,50                                     | 21,28                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:  |  |  |   |   |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>  | 0,10                                   | 0,24   | 0,21  | 0,26                                      | 0,38                                      | 0,51                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,95                                   | 1,12   | 1,08  | 1,48                                      | 1,56                                      | 1,71                                      |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit   | 1,05                                   | 1,36   | 1,29  | 1,74                                      | 1,94                                      | 2,22                                      |
| Schlussnettoinventarwert   | 16,81                                  | 12,48  | 11,99   | 20,13                                     | 21,44                                     | 23,50                                     |
| Gesamtertrag   | 6,66 %                                 | 12,23 %  | 12,06 %   | 9,46 %                                    | 9,95 %                                    | 10,43 %                                   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>   |  |  |   |   |   |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>   | 2,04 %                                 | 0,46 %   | 0,67 %  | 1,14 %                                    | 0,70 %                                    | 0,24 %                                    |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)   | 0,57 %                                 | 1,97 %   | 1,78 %  | 1,28 %                                    | 1,79 %                                    | 2,22 %                                    |
| <b>31. Dezember 2023</b>   |  |  |   |   |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert  | 14,02                                  | 10,08  | 10,00   | 15,83                                     | 16,71                                     | 18,15                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:  |  |  |   |   |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>  | 0,08                                   | 0,21   | 0,02  | 0,23                                      | 0,32                                      | 0,44                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 1,66                                   | 0,83   | 0,68  | 2,33                                      | 2,47                                      | 2,69                                      |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit   | 1,74                                   | 1,04   | 0,70  | 2,56                                      | 2,79                                      | 3,13                                      |
| Schlussnettoinventarwert   | 15,76                                  | 11,12  | 10,70   | 18,39                                     | 19,50                                     | 21,28                                     |
| Gesamtertrag   | 12,41 %                                | 10,32 %  | 7,00 %  | 16,17 %                                   | 16,70 %                                   | 17,25 %                                   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>   |  |  |   |   |   |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>   | 1,97 %                                 | 0,51 %   | 0,72 %  | 1,21 %                                    | 0,77 %                                    | 0,31 %                                    |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)   | 0,53 %                                 | 1,98 %   | 1,06 %  | 1,37 %                                    | 1,77 %                                    | 2,29 %                                    |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## High Yield Bond

|   | Ausschüttende<br>Klasse<br>AUD A<br>(Monatlich)<br>AUD | Thesaurierende<br>Klasse<br>AUD A<br>AUD | Ausschüttende<br>Klasse<br>AUD B<br>(Monatlich)<br>AUD | Thesaurierende<br>Klasse<br>AUD B<br>AUD | Ausschüttende<br>Klasse<br>AUD E<br>(Monatlich)<br>AUD | Thesaurierende<br>Klasse<br>AUD E<br>AUD |
|---|--|--|--|--|--|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |  |  |  |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 6,50   | 15,00                                    | 4,93   | 9,33                                     | 4,97   | 10,52                                    |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |  |  |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,37   | 0,90                                     | 0,20   | 0,40                                     | 0,20   | 0,44                                     |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,01   | 0,02                                     | 0,00   | 0,02                                     | 0,02   | 0,03                                     |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,38   | 0,92                                     | 0,20   | 0,42                                     | 0,22   | 0,47                                     |
| Ausschüttungen  | (0,55)   | –  | (0,43)   | –  | (0,44)   | –  |
| Schlussnettoinventarwert  | 6,33   | 15,92                                    | 4,70   | 9,75                                     | 4,75   | 10,99                                    |
| Gesamtertrag  | 6,15 %   | 6,13 %                                   | 4,38 %   | 4,50 %                                   | 4,64 %   | 4,47 %                                   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |  |  |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,40 %   | 1,40 %                                   | 3,10 %   | 3,11 %                                   | 3,10 %   | 3,10 %                                   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 5,84 %   | 5,84 %                                   | 4,13 %   | 4,16 %                                   | 4,14 %   | 4,13 %                                   |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |  |  |  |  |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 6,43   | 13,78                                    | 4,95   | 8,71                                     | 5,00   | 9,82                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |  |  |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,34   | 0,76                                     | 0,18   | 0,34                                     | 0,19   | 0,38                                     |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,20   | 0,46                                     | 0,16   | 0,28                                     | 0,15   | 0,32                                     |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,54   | 1,22                                     | 0,34   | 0,62                                     | 0,34   | 0,70                                     |
| Ausschüttungen  | (0,47)   | –  | (0,36)   | –  | (0,37)   | –  |
| Schlussnettoinventarwert  | 6,50   | 15,00                                    | 4,93   | 9,33                                     | 4,97   | 10,52                                    |
| Gesamtertrag  | 8,87 %   | 8,85 %                                   | 7,27 %   | 7,12 %                                   | 7,06 %   | 7,13 %                                   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |  |  |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,29 %   | 1,29 %                                   | 2,86 %   | 2,84 %                                   | 2,86 %   | 2,86 %                                   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 5,33 %   | 5,33 %                                   | 3,77 %   | 3,76 %                                   | 3,77 %   | 3,77 %                                   |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

|   | Ausschüttende<br>Klasse<br>AUD I<br>AUD | Ausschüttende<br>Klasse<br>AUD T<br>(Monatlich)<br>AUD | Ausschüttende<br>Klasse<br>AUD T<br>(Wöchentlich)<br>AUD | Thesaurierende<br>Klasse<br>AUD T<br>AUD | Ausschüttende<br>Klasse<br>CAD A<br>(Monatlich)<br>CAD | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF A<br>CHF |
|---|---|--|--|--|--|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |  |  |  |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 9,44                                    | 5,74   | 5,55   | 12,80                                    | 6,74   | 12,18                                    |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |  |  |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,61                                    | 0,29   | 0,28   | 0,68                                     | 0,38   | 0,70                                     |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,01                                    | 0,02   | 0,02   | 0,03                                     | 0,04   | (0,34)                                   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,62                                    | 0,31   | 0,30   | 0,71                                     | 0,42   | 0,36                                     |
| Ausschüttungen  | (0,55)                                  | (0,50)   | (0,50)   | –  | (0,57)   | –  |
| Schlussnettoinventarwert  | 9,51                                    | 5,55   | 5,35   | 13,51                                    | 6,59   | 12,54                                    |
| Gesamtertrag  | 6,88 %                                  | 5,66 %   | 5,61 %   | 5,55 %                                   | 6,57 %   | 2,96 %                                   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |  |  |  |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,76 %                                  | 2,04 %   | 2,04 %   | 2,03 %                                   | 1,38 %   | 1,35 %                                   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 6,48 %                                  | 5,20 %   | 5,20 %   | 5,20 %                                   | 5,75 %   | 5,64 %                                   |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |   |  |  |  |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 9,15                                    | 5,71   | 5,52   | 11,83                                    | 6,61   | 11,47                                    |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |  |  |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,54                                    | 0,27   | 0,26   | 0,57                                     | 0,35   | 0,60                                     |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,29                                    | 0,18   | 0,17   | 0,40                                     | 0,27   | 0,11                                     |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,83                                    | 0,45   | 0,43   | 0,97                                     | 0,62   | 0,71                                     |
| Ausschüttungen  | (0,54)                                  | (0,42)   | (0,40)   | –  | (0,49)   | –  |
| Schlussnettoinventarwert  | 9,44                                    | 5,74   | 5,55   | 12,80                                    | 6,74   | 12,18                                    |
| Gesamtertrag  | 9,56 %                                  | 8,27 %   | 8,16 %   | 8,20 %                                   | 9,80 %   | 6,19 %                                   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |  |  |  |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,70 %                                  | 1,87 %   | 1,87 %   | 1,87 %                                   | 1,29 %   | 1,24 %                                   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 5,92 %                                  | 4,74 %   | 4,74 %   | 4,73 %                                   | 5,34 %   | 5,12 %                                   |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## High Yield Bond (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF I<br>CHF | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF I2<br>CHF | Ausschüttende<br>Klasse<br>CNY A<br>(Monatlich)<br>CNY | Ausschüttende<br>Klasse<br>CNY I<br>(Monatlich)<br>CNY | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR A<br>(Monatlich)<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A<br>€ |
|---|--|---|--|--|--|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |   |  |  |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 13,06                                    | 11,20                                     | 73,18  | 77,78  | 6,06   | 19,94                                  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |   |  |  |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,83                                     | 0,72                                      | 3,96   | 4,67   | 0,34   | 1,17                                   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | (0,37)                                   | (0,31)                                    | (0,66)   | (0,68)   | (0,02)   | (0,06)                                 |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,46                                     | 0,41                                      | 3,30   | 3,99   | 0,32   | 1,11                                   |
| Ausschüttungen  | –  | –   | (6,16)   | (6,57)   | (0,51)   | –                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 13,52                                    | 11,61                                     | 70,32  | 75,20  | 5,87   | 21,05                                  |
| Gesamtertrag  | 3,52 %                                   | 3,66 %                                    | 4,74 %   | 5,38 %   | 5,58 %   | 5,57 %                                 |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |   |  |  |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,73 %                                   | 0,63 %                                    | 1,33 %   | 0,71 %   | 1,37 %   | 1,37 %                                 |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 6,26 %                                   | 6,36 %                                    | 5,55 %   | 6,14 %   | 5,73 %   | 5,72 %                                 |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |  |   |  |  |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 12,22                                    | 10,47                                     | 73,25  | 77,39  | 6,03   | 18,42                                  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |   |  |  |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,67                                     | 0,62                                      | 3,96   | 4,63   | 0,32   | 1,01                                   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,17                                     | 0,11                                      | 1,31   | 1,41   | 0,15   | 0,51                                   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,84                                     | 0,73                                      | 5,27   | 6,04   | 0,47   | 1,52                                   |
| Ausschüttungen  | –  | –   | (5,34)   | (5,65)   | (0,44)   | –                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 13,06                                    | 11,20                                     | 73,18  | 77,78  | 6,06   | 19,94                                  |
| Gesamtertrag  | 6,87 %                                   | 6,97 %                                    | 7,57 %   | 8,22 %   | 8,22 %   | 8,25 %                                 |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |   |  |  |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,65 %                                   | 0,58 %                                    | 1,32 %   | 0,71 %   | 1,29 %   | 1,28 %                                 |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 5,35 %                                   | 5,80 %                                    | 5,48 %   | 6,06 %   | 5,36 %   | 5,34 %                                 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

|   | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR A<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I<br>€ | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I2<br>€ | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I2<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M<br>€ |
|---|---------------------------------------|--|---------------------------------------|---|--|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |                                       |  |                                       |   |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 7,19                                  | 17,76                                  | 6,92                                  | 12,47                                   | 6,82                                   | 11,15                                  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |                                       |  |                                       |   |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,41                                  | 1,16                                   | 0,44                                  | 0,83                                    | 0,44                                   | 0,58                                   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | (0,02)                                | (0,06)                                 | (0,03)                                | (0,04)                                  | (0,02)                                 | (0,03)                                 |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,39                                  | 1,10                                   | 0,41                                  | 0,79                                    | 0,42                                   | 0,55                                   |
| Ausschüttungen  | (0,39)                                | –                                      | (0,41)                                | –                                       | (0,41)                                 | –                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 7,19                                  | 18,86                                  | 6,92                                  | 13,26                                   | 6,83                                   | 11,70                                  |
| Gesamtertrag  | 5,55 %                                | 6,19 %                                 | 6,18 %                                | 6,34 %                                  | 6,44 %                                 | 4,93 %                                 |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |                                       |  |                                       |   |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,37 %                                | 0,74 %                                 | 0,74 %                                | 0,64 %                                  | 0,64 %                                 | 1,99 %                                 |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 5,72 %                                | 6,36 %                                 | 6,35 %                                | 6,45 %                                  | 6,45 %                                 | 5,09 %                                 |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |                                       |  |                                       |   |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 7,01                                  | 16,30                                  | 6,74                                  | 11,44                                   | 6,65                                   | 10,36                                  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |                                       |  |                                       |   |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,37                                  | 1,00                                   | 0,40                                  | 0,72                                    | 0,40                                   | 0,51                                   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,18                                  | 0,46                                   | 0,18                                  | 0,31                                    | 0,17                                   | 0,28                                   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,55                                  | 1,46                                   | 0,58                                  | 1,03                                    | 0,57                                   | 0,79                                   |
| Ausschüttungen  | (0,37)                                | –                                      | (0,40)                                | –                                       | (0,40)                                 | –                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 7,19                                  | 17,76                                  | 6,92                                  | 12,47                                   | 6,82                                   | 11,15                                  |
| Gesamtertrag  | 8,25 %                                | 8,96 %                                 | 9,01 %                                | 9,00 %                                  | 9,00 %                                 | 7,63 %                                 |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |                                       |  |                                       |   |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,29 %                                | 0,70 %                                 | 0,71 %                                | 0,61 %                                  | 0,61 %                                 | 1,88 %                                 |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 5,35 %                                | 5,93 %                                 | 5,94 %                                | 6,07 %                                  | 6,06 %                                 | 4,77 %                                 |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## High Yield Bond (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR Z<br>€ | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP A<br>(Monatlich)<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP A<br>£ | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP A<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I<br>£ | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP I<br>£ |
|---|--|--|--|---------------------------------------|--|---------------------------------------|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |  |  |                                       |  |                                       |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 11,90                                  | 6,34   | 14,20                                  | 7,91                                  | 17,29                                  | 8,55                                  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |  |                                       |  |                                       |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,86                                   | 0,35   | 0,82                                   | 0,44                                  | 1,11                                   | 0,53                                  |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | (0,04)                                 | 0,07   | 0,19                                   | 0,10                                  | 0,22                                   | 0,11                                  |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,82                                   | 0,42   | 1,01                                   | 0,54                                  | 1,33                                   | 0,64                                  |
| Ausschüttungen  | –                                      | (0,54)   | –                                      | (0,42)                                | –                                      | (0,51)                                |
| Schlussnettoinventarwert  | 12,72                                  | 6,22   | 15,21                                  | 8,03                                  | 18,62                                  | 8,68                                  |
| Gesamtertrag  | 6,89 %                                 | 6,94 %   | 7,11 %                                 | 7,11 %                                | 7,69 %                                 | 7,74 %                                |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |  |                                       |  |                                       |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,11 %                                 | 1,34 %   | 1,34 %                                 | 1,34 %                                | 0,72 %                                 | 0,73 %                                |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 6,98 %                                 | 5,60 %   | 5,59 %                                 | 5,59 %                                | 6,20 %                                 | 6,25 %                                |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |  |  |  |                                       |  |                                       |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,87                                  | 6,20   | 12,91                                  | 7,59                                  | 15,62                                  | 8,21                                  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |  |                                       |  |                                       |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,73                                   | 0,33   | 0,71                                   | 0,41                                  | 0,96                                   | 0,49                                  |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,30                                   | 0,27   | 0,58                                   | 0,32                                  | 0,71                                   | 0,34                                  |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,03                                   | 0,60   | 1,29                                   | 0,73                                  | 1,67                                   | 0,83                                  |
| Ausschüttungen  | –                                      | (0,46)   | –                                      | (0,41)                                | –                                      | (0,49)                                |
| Schlussnettoinventarwert  | 11,90                                  | 6,34   | 14,20                                  | 7,91                                  | 17,29                                  | 8,55                                  |
| Gesamtertrag  | 9,48 %                                 | 10,12 %  | 9,99 %                                 | 9,98 %                                | 10,69 %                                | 10,56 %                               |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |  |                                       |  |                                       |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,12 %                                 | 1,29 %   | 1,29 %                                 | 1,29 %                                | 0,70 %                                 | 0,70 %                                |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 6,53 %                                 | 5,34 %   | 5,32 %                                 | 5,34 %                                | 5,92 %                                 | 5,90 %                                |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I2<br>£ | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP I2<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP Z<br>£ | Ausschüttende<br>Klasse<br>HKD A<br>(Monatlich)<br>HKD | Ausschüttende<br>Klasse<br>JPY A<br>(Monatlich) (nicht<br>währungs-<br>gesichert)*<br>¥ | Thesaurierende<br>Klasse<br>SEK A<br>SEK |
|---|---|--|--|--|---|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |  |  |  |   |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 13,84                                   | 7,57                                   | 13,42                                  | 6,65   | 1.000,00  | 136,03                                   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |  |  |   |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,91                                    | 0,48                                   | 0,94                                   | 0,36   | 21,39   | 7,96                                     |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,17                                    | 0,10                                   | 0,17                                   | 0,04   | 77,82   | (0,66)                                   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,08                                    | 0,58                                   | 1,11                                   | 0,40   | 99,21   | 7,30                                     |
| Ausschüttungen  | –                                       | (0,46)                                 | –                                      | (0,56)   | (22,90)   | –  |
| Schlussnettoinventarwert  | 14,92                                   | 7,69                                   | 14,53                                  | 6,49   | 1.076,31  | 143,33                                   |
| Gesamtertrag  | 7,80 %                                  | 7,92 %                                 | 8,27 %                                 | 6,38 %   | 10,05 %   | 5,37 %                                   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |  |  |  |   |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,62 %                                  | 0,62 %                                 | 0,11 %                                 | 1,30 %   | 1,35 %  | 1,37 %                                   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 6,30 %                                  | 6,29 %                                 | 6,86 %                                 | 5,45 %   | 5,70 %  | 5,72 %                                   |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |   |  |  |  |   |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 12,49                                   | 7,27                                   | 12,06                                  | 6,53   | –   | 125,59                                   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |  |  |   |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,79                                    | 0,44                                   | 0,82                                   | 0,35   | –   | 7,44                                     |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,56                                    | 0,30                                   | 0,54                                   | 0,25   | –   | 3,00                                     |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,35                                    | 0,74                                   | 1,36                                   | 0,60   | –   | 10,44                                    |
| Ausschüttungen  | –                                       | (0,44)                                 | –                                      | (0,48)   | –   | –  |
| Schlussnettoinventarwert  | 13,84                                   | 7,57                                   | 13,42                                  | 6,65   | –   | 136,03                                   |
| Gesamtertrag  | 10,81 %                                 | 10,66 %                                | 11,28 %                                | 9,62 %   | –   | 8,31 %                                   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |  |  |  |   |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,61 %                                  | 0,61 %                                 | 0,12 %                                 | 1,32 %   | –   | 1,34 %                                   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 6,05 %                                  | 6,04 %                                 | 6,50 %                                 | 5,46 %   | –   | 5,74 %                                   |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## High Yield Bond (Fortsetzung)

|   | Ausschüttende<br>Klasse<br>SGD A<br>(Monatlich)<br>SGD | Thesaurierende<br>Klasse<br>SGD A<br>SGD | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD A<br>(Monatlich)<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD A<br>(Wöchentlich)<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD A<br>US\$ |
|---|--|--|---|---|---|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |  |   |   |   |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 13,83  | 29,01                                    | 7,13  | 6,84  | 18,07                                     | 8,60                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |   |   |   |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,76   | 1,66                                     | 0,39  | 0,37  | 1,03                                      | 0,47                                     |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | (0,03)   | (0,06)                                   | 0,12  | 0,12  | 0,31                                      | 0,14                                     |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,73   | 1,60                                     | 0,51  | 0,49  | 1,34                                      | 0,61                                     |
| Ausschüttungen  | (1,17)   | –  | (0,61)  | (0,59)  | –   | (0,46)                                   |
| Schlussnettoinventarwert  | 13,39  | 30,61                                    | 7,03  | 6,74  | 19,41                                     | 8,75                                     |
| Gesamtertrag  | 5,53 %   | 5,52 %                                   | 7,47 %  | 7,50 %  | 7,42 %                                    | 7,41 %                                   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |   |   |   |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,34 %   | 1,34 %                                   | 1,31 %  | 1,31 %  | 1,31 %                                    | 1,31 %                                   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 5,58 %   | 5,60 %                                   | 5,47 %  | 5,49 %  | 5,48 %                                    | 5,48 %                                   |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |  |  |   |   |   |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 13,65  | 26,58                                    | 6,93  | 6,65  | 16,32                                     | 8,20                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |   |   |   |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,73   | 1,48                                     | 0,38  | 0,36  | 0,93                                      | 0,45                                     |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,45   | 0,95                                     | 0,33  | 0,32  | 0,82                                      | 0,39                                     |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,18   | 2,43                                     | 0,71  | 0,68  | 1,75                                      | 0,84                                     |
| Ausschüttungen  | (1,00)   | –  | (0,51)  | (0,49)  | –   | (0,44)                                   |
| Schlussnettoinventarwert  | 13,83  | 29,01                                    | 7,13  | 6,84  | 18,07                                     | 8,60                                     |
| Gesamtertrag  | 9,09 %   | 9,14 %                                   | 10,74 %   | 10,65 %   | 10,72 %                                   | 10,72 %                                  |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |   |   |   |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,30 %   | 1,30 %                                   | 1,32 %  | 1,32 %  | 1,32 %                                    | 1,32 %                                   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 5,37 %   | 5,37 %                                   | 5,47 %  | 5,47 %  | 5,47 %                                    | 5,47 %                                   |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

|   | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD B<br>(Monatlich)<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD B<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD C<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD C1<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD C1<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD E<br>(Monatlich)<br>US\$ |
|---|---|---|---|--|---|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |   |   |  |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 5,45  | 11,85                                     | 13,28                                     | 10,80                                      | 8,69                                      | 5,53  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |   |   |  |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,21  | 0,47                                      | 0,67                                      | 0,50                                       | 0,39                                      | 0,21  |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,08  | 0,20                                      | 0,23                                      | 0,18                                       | 0,14                                      | 0,08  |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,29  | 0,67                                      | 0,90                                      | 0,68                                       | 0,53                                      | 0,29  |
| Ausschüttungen  | (0,48)  | –   | –   | –  | (0,38)                                    | (0,49)  |
| Schlussnettoinventarwert  | 5,26  | 12,52                                     | 14,18                                     | 11,48                                      | 8,84                                      | 5,33  |
| Gesamtertrag  | 5,67 %  | 5,65 %                                    | 6,78 %                                    | 6,30 %                                     | 6,34 %                                    | 5,53 %  |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |   |   |  |   |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 2,91 %  | 2,91 %                                    | 1,91 %                                    | 2,31 %                                     | 2,31 %                                    | 2,91 %  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 3,88 %  | 3,88 %                                    | 4,88 %                                    | 4,48 %                                     | 4,48 %                                    | 3,87 %  |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |   |   |   |  |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 5,38  | 10,88                                     | 12,07                                     | 9,85                                       | 8,29                                      | 5,46  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |   |   |  |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,21  | 0,43                                      | 0,61                                      | 0,45                                       | 0,37                                      | 0,21  |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,25  | 0,54                                      | 0,60                                      | 0,50                                       | 0,39                                      | 0,26  |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,46  | 0,97                                      | 1,21                                      | 0,95                                       | 0,76                                      | 0,47  |
| Ausschüttungen  | (0,39)  | –   | –   | –  | (0,36)                                    | (0,40)  |
| Schlussnettoinventarwert  | 5,45  | 11,85                                     | 13,28                                     | 10,80                                      | 8,69                                      | 5,53  |
| Gesamtertrag  | 9,04 %  | 8,92 %                                    | 10,02 %                                   | 9,64 %                                     | 9,55 %                                    | 9,02 %  |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |   |   |  |   |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 2,92 %  | 2,92 %                                    | 1,92 %                                    | 2,32 %                                     | 2,32 %                                    | 2,92 %  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 3,87 %  | 3,86 %                                    | 4,87 %                                    | 4,47 %                                     | 4,47 %                                    | 3,87 %  |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## High Yield Bond (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD E<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I<br>(Monatlich)<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I2<br>(Monatlich)<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I2<br>US\$ |
|---|---|---|---|--|--|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |   |   |  |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,69                                     | 7,45  | 27,54                                     | 9,94                                     | 8,38   | 15,08                                      |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |   |   |  |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,43                                      | 0,45  | 1,73                                      | 0,60                                     | 0,51   | 0,97                                       |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,17                                      | 0,13  | 0,48                                      | 0,17                                     | 0,13   | 0,25                                       |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,60                                      | 0,58  | 2,21                                      | 0,77                                     | 0,64   | 1,22                                       |
| Ausschüttungen  | –   | (0,64)  | –   | (0,60)                                   | (0,71)   | –  |
| Schlussnettoinventarwert  | 11,29                                     | 7,39  | 29,75                                     | 10,11                                    | 8,31   | 16,30                                      |
| Gesamtertrag  | 5,61 %                                    | 8,12 %  | 8,02 %                                    | 8,01 %                                   | 8,09 %   | 8,09 %                                     |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |   |   |  |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 2,91 %                                    | 0,71 %  | 0,71 %                                    | 0,71 %                                   | 0,61 %   | 0,61 %                                     |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 3,85 %                                    | 6,08 %  | 6,09 %                                    | 6,04 %                                   | 6,18 %   | 6,18 %                                     |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |   |   |   |  |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 9,81                                      | 7,20  | 24,73                                     | 9,48                                     | 8,09   | 13,53                                      |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |   |   |  |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,39                                      | 0,44  | 1,56                                      | 0,58                                     | 0,50   | 0,87                                       |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,49                                      | 0,34  | 1,25                                      | 0,45                                     | 0,39   | 0,68                                       |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,88                                      | 0,78  | 2,81                                      | 1,03                                     | 0,89   | 1,55                                       |
| Ausschüttungen  | –   | (0,53)  | –   | (0,57)                                   | (0,60)   | –  |
| Schlussnettoinventarwert  | 10,69                                     | 7,45  | 27,54                                     | 9,94                                     | 8,38   | 15,08                                      |
| Gesamtertrag  | 8,97 %                                    | 11,37 %   | 11,36 %                                   | 11,36 %                                  | 11,49 %  | 11,46 %                                    |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |   |   |  |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 2,93 %                                    | 0,72 %  | 0,72 %                                    | 0,72 %                                   | 0,62 %   | 0,62 %                                     |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 3,85 %                                    | 6,06 %  | 6,06 %                                    | 6,06 %                                   | 6,17 %   | 6,17 %                                     |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

|   | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I2<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I4<br>(Monatlich)<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD M<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD P<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD T<br>(Monatlich)<br>US\$ |
|---|---|--|---|--|---|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |  |   |  |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 8,30                                      | 9,42   | 13,34                                     | 8,01                                     | 11,89                                     | 6,08  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |   |  |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,51                                      | 0,60   | 0,67                                      | 0,39                                     | 0,74                                      | 0,29  |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,14                                      | 0,16   | 0,23                                      | 0,13                                     | 0,23                                      | 0,10  |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,65                                      | 0,76   | 0,90                                      | 0,52                                     | 0,97                                      | 0,39  |
| Ausschüttungen  | (0,51)                                    | (0,62)   | –   | (0,54)                                   | –   | (0,53)  |
| Schlussnettoinventarwert  | 8,44                                      | 9,56   | 14,24                                     | 7,99                                     | 12,86                                     | 5,94  |
| Gesamtertrag  | 8,09 %                                    | 8,32 %   | 6,75 %                                    | 6,76 %                                   | 8,16 %                                    | 6,76 %  |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |  |   |  |   |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,61 %                                    | 0,47 %   | 1,91 %                                    | 1,91 %                                   | 0,67 %                                    | 1,91 %  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 6,17 %                                    | 6,30 %   | 4,86 %                                    | 4,89 %                                   | 5,95 %                                    | 4,88 %  |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |   |  |   |  |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 7,91                                      | 8,88   | 12,12                                     | 7,79                                     | 10,67                                     | 5,95  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |   |  |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,49                                      | 0,57   | 0,61                                      | 0,38                                     | 0,67                                      | 0,29  |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,38                                      | 0,43   | 0,61                                      | 0,36                                     | 0,55                                      | 0,28  |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,87                                      | 1,00   | 1,22                                      | 0,74                                     | 1,22                                      | 0,57  |
| Ausschüttungen  | (0,48)                                    | (0,46)   | –   | (0,52)                                   | –   | (0,44)  |
| Schlussnettoinventarwert  | 8,30                                      | 9,42   | 13,34                                     | 8,01                                     | 11,89                                     | 6,08  |
| Gesamtertrag  | 11,55 %                                   | 11,63 %  | 10,07 %                                   | 10,05 %                                  | 11,43 %                                   | 9,99 %  |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |  |   |  |   |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,62 %                                    | 0,48 %   | 1,92 %                                    | 1,92 %                                   | 0,69 %                                    | 1,92 %  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 6,19 %                                    | 6,31 %   | 4,87 %                                    | 4,89 %                                   | 6,05 %                                    | 4,87 %  |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## High Yield Bond (Fortsetzung)

|   | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD T<br>(Wöchentlich)<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD T<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD U<br>(Monatlich)<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD U<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>ZAR B<br>(Monatlich)<br>ZAR |
|---|---|---|---|---|---|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |   |   |   |   |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 6,12  | 13,23                                     | 6,98  | 14,68                                     | 14,17                                     | 53,93  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |   |   |   |   |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,29  | 0,66                                      | 0,40  | 0,88                                      | 0,98                                      | 2,10   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,11  | 0,23                                      | 0,11  | 0,25                                      | 0,25                                      | 2,28   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,40  | 0,89                                      | 0,51  | 1,13                                      | 1,23                                      | 4,38   |
| Ausschüttungen  | (0,55)  | –   | (0,59)  | –   | –   | (6,50)   |
| Schlussnettoinventarwert  | 5,97  | 14,12                                     | 6,90  | 15,81                                     | 15,40                                     | 51,81  |
| Gesamtertrag  | 6,87 %  | 6,73 %                                    | 7,75 %  | 7,70 %                                    | 8,68 %                                    | 8,69 %   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |   |   |   |   |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,91 %  | 1,90 %                                    | 1,01 %  | 1,01 %                                    | 0,11 %                                    | 3,00 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 4,87 %  | 4,86 %                                    | 5,78 %  | 5,78 %                                    | 6,69 %                                    | 4,00 %   |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |   |   |   |   |   |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 5,99  | 12,02                                     | 6,77  | 13,22                                     | 12,65                                     | 53,76  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |   |   |   |   |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,29  | 0,61                                      | 0,39  | 0,79                                      | 0,88                                      | 2,04   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,28  | 0,60                                      | 0,32  | 0,67                                      | 0,64                                      | 3,93   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,57  | 1,21                                      | 0,71  | 1,46                                      | 1,52                                      | 5,97   |
| Ausschüttungen  | (0,44)  | –   | (0,50)  | –   | –   | (5,80)   |
| Schlussnettoinventarwert  | 6,12  | 13,23                                     | 6,98  | 14,68                                     | 14,17                                     | 53,93  |
| Gesamtertrag  | 9,91 %  | 10,07 %                                   | 10,97 %   | 11,04 %                                   | 12,02 %                                   | 11,90 %  |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |   |   |   |   |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,92 %  | 1,92 %                                    | 1,02 %  | 1,02 %                                    | 0,12 %                                    | 2,90 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 4,87 %  | 4,88 %                                    | 5,77 %  | 5,75 %                                    | 6,65 %                                    | 3,84 %   |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

|   | Ausschüttende<br>Klasse<br>ZAR E<br>(Monatlich)<br>ZAR | Thesaurierende<br>Klasse<br>ZAR E<br>ZAR | Ausschüttende<br>Klasse<br>ZAR T<br>(Monatlich)<br>ZAR | Thesaurierende<br>Klasse<br>ZAR T<br>ZAR |
|---|--|--|--|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |  |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 53,32  | 166,67                                   | 60,27  | 155,44                                   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 2,08   | 6,97                                     | 2,97   | 8,20                                     |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 2,26   | 7,55                                     | 2,55   | 7,04                                     |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 4,34   | 14,52                                    | 5,52   | 15,24                                    |
| Ausschüttungen  | (6,43)   | –  | (7,18)   | –  |
| Schlussnettoinventarwert  | 51,23  | 181,19                                   | 58,61  | 170,68                                   |
| Gesamtertrag  | 8,71 %   | 8,71 %                                   | 9,81 %   | 9,80 %                                   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 3,00 %   | 3,01 %                                   | 1,97 %   | 1,97 %                                   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 4,01 %   | 4,00 %                                   | 5,03 %   | 5,03 %                                   |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |  |  |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 53,15  | 148,94                                   | 59,48  | 137,52                                   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 2,02   | 5,96                                     | 2,85   | 6,98                                     |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 3,88   | 11,77                                    | 4,38   | 10,94                                    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 5,90   | 17,73                                    | 7,23   | 17,92                                    |
| Ausschüttungen  | (5,73)   | –  | (6,44)   | –  |
| Schlussnettoinventarwert  | 53,32  | 166,67                                   | 60,27  | 155,44                                   |
| Gesamtertrag  | 11,90 %  | 11,90 %                                  | 13,02 %  | 13,03 %                                  |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 2,91 %   | 2,91 %                                   | 1,91 %   | 1,90 %                                   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 3,85 %   | 3,84 %                                   | 4,83 %   | 4,83 %                                   |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## InnovAsia

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF I4<br>CHF | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I4<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M (nicht<br>währungs-<br>gesichert)<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR X<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>SGD A<br>SGD |
|---|---|--|---|--|--|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |  |   |  |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 8,10                                      | 8,07                                   | 8,30                                    | 9,50   | 8,11                                   | 16,68                                    |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |   |  |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,02                                      | (0,08)                                 | 0,02                                    | (0,18)   | (0,06)                                 | (0,11)                                   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,48                                      | 0,66                                   | 0,69                                    | 1,66   | 0,67                                   | 1,30                                     |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,50                                      | 0,58                                   | 0,71                                    | 1,48   | 0,61                                   | 1,19                                     |
| Schlussnettoinventarwert  | 8,60                                      | 8,65                                   | 9,01                                    | 10,98  | 8,72                                   | 17,87                                    |
| Gesamtertrag  | 6,17 %                                    | 7,19 %                                 | 8,55 %                                  | 15,58 %  | 7,52 %                                 | 7,13 %                                   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |  |   |  |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,75 %                                    | 2,00 %                                 | 0,76 %                                  | 2,80 %   | 1,74 %                                 | 1,94 %                                   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 0,22 %                                    | (1,01 %)                               | 0,21 %                                  | (1,81 %)   | (0,75 %)                               | (0,65 %)                                 |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |   |  |   |  |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 6,39                                      | 6,32                                   | 6,42                                    | 7,58   | 6,33                                   | 12,97                                    |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |   |  |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,04                                      | (0,04)                                 | 0,04                                    | (0,12)   | (0,03)                                 | (0,10)                                   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 1,67                                      | 1,79                                   | 1,84                                    | 2,04   | 1,81                                   | 3,81                                     |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,71                                      | 1,75                                   | 1,88                                    | 1,92   | 1,78                                   | 3,71                                     |
| Schlussnettoinventarwert  | 8,10                                      | 8,07                                   | 8,30                                    | 9,50   | 8,11                                   | 16,68                                    |
| Gesamtertrag  | 26,76 %                                   | 27,69 %                                | 29,28 %                                 | 25,33 %  | 28,12 %                                | 28,60 %                                  |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |  |   |  |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,68 %                                    | 1,88 %                                 | 0,71 %                                  | 2,66 %   | 1,63 %                                 | 1,88 %                                   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 0,50 %                                    | (0,54 %)                               | 0,53 %                                  | (1,43 %)   | (0,40 %)                               | (0,65 %)                                 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

InnovAsia (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>SGD I4<br>SGD | Thesaurierende<br>Klasse<br>SGD X<br>SGD | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I4<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M<br>US\$ |
|---|---|--|---|---|--|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |  |   |   |  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 17,18                                     | 16,78                                    | 8,57                                      | 8,76                                      | 8,83                                       | 8,13                                      |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |   |   |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,03                                      | (0,13)                                   | (0,09)                                    | (0,01)                                    | 0,02                                       | (0,15)                                    |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 1,42                                      | 1,38                                     | 0,87                                      | 0,88                                      | 0,90                                       | 0,83                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,45                                      | 1,25                                     | 0,78                                      | 0,87                                      | 0,92                                       | 0,68                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 18,63                                     | 18,03                                    | 9,35                                      | 9,63                                      | 9,75                                       | 8,81                                      |
| Gesamtertrag  | 8,44 %                                    | 7,45 %                                   | 9,10 %                                    | 9,93 %                                    | 10,42 %                                    | 8,36 %                                    |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |          |          |          |        |          |
|--------------------------------|--------|----------|----------|----------|--------|----------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,74 % | 1,70 %   | 1,92 %   | 1,07 %   | 0,73 % | 2,73 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,20 % | (0,74 %) | (0,99 %) | (0,16 %) | 0,21 % | (1,77 %) |

**31. Dezember 2023**

|   |         |         |         |         |         |         |
|---|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 13,20   | 13,02   | 6,55    | 6,64    | 6,67    | 6,26    |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |         |         |         |         |         |         |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,08    | (0,06)  | (0,05)  | 0,02    | 0,04    | (0,11)  |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 3,90    | 3,82    | 2,07    | 2,10    | 2,12    | 1,98    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 3,98    | 3,76    | 2,02    | 2,12    | 2,16    | 1,87    |
| Schlussnettoinventarwert  | 17,18   | 16,78   | 8,57    | 8,76    | 8,83    | 8,13    |
| Gesamtertrag  | 30,15 % | 28,88 % | 30,84 % | 31,93 % | 32,38 % | 29,87 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |          |          |        |        |          |
|--------------------------------|--------|----------|----------|--------|--------|----------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,71 % | 1,64 %   | 1,90 %   | 1,07 % | 0,73 % | 2,71 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,53 % | (0,41 %) | (0,67 %) | 0,21 % | 0,52 % | (1,46 %) |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## InnovAsia (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD X<br>US\$ |
|---|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 8,63                                      |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,06)                                    |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,88                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,82                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 9,45                                      |
| Gesamtertrag  | 9,50 %                                    |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,67 %                                    |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | (0,71 %)                                  |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 6,58                                      |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,03)                                    |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 2,08                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 2,05                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 8,63                                      |
| Gesamtertrag  | 31,16 %                                   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,67 %                                    |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | (0,41 %)                                  |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Japan Equity Engagement

|  | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I5<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I5 (nicht<br>währungsgesichert)<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP P (nicht<br>währungsgesichert)<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>JPY A*<br>¥ | Thesaurierende<br>Klasse<br>JPY I<br>¥ | Ausschüttende<br>Klasse<br>JPY I<br>¥ |
|--|--|--|---|---|--|---------------------------------------|
| <b>31. Dezember 2024</b>   |  |  |   |   |  |                                       |
| Eröffnungsnettoinventarwert  | 11,98                                  | 10,78  | 8,39  | 1.000,00                                | 1.742,53                               | 1.729,24                              |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:  |  |  |   |   |  |                                       |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>  | 0,16                                   | 0,14   | 0,07  | (0,53)                                  | 24,44                                  | 14,38                                 |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 2,11                                   | 0,45   | 0,35  | 75,42                                   | 235,77                                 | 240,81                                |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit   | 2,27                                   | 0,59   | 0,42  | 74,89                                   | 260,21                                 | 255,19                                |
| Ausschüttungen   | (0,12)                                 | –  | –   | –                                       | –                                      | (12,48)                               |
| Schlussnettoinventarwert   | 14,13                                  | 11,37  | 8,81  | 1.074,89                                | 2.002,74                               | 1.971,95                              |
| Gesamtertrag   | 19,17 %                                | 5,47 %   | 5,01 %  | 7,49 %                                  | 14,93 %                                | 14,85 %                               |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>   |  |  |   |   |  |                                       |
| Aufwendungen <sup>++</sup>   | 0,74 %                                 | 0,66 %   | 1,03 %  | 1,95 %                                  | 1,12 %                                 | 1,16 %                                |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)   | 1,19 %                                 | 1,27 %   | 0,84 %  | (0,08 %)                                | 1,28 %                                 | 0,77 %                                |
| <b>31. Dezember 2023</b>   |  |  |   |   |  |                                       |
| Eröffnungsnettoinventarwert  | 9,46                                   | 10,00  | 7,89  | –                                       | 1.450,08                               | 1.450,06                              |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:  |  |  |   |   |  |                                       |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>  | 0,13                                   | 0,07   | 0,10  | –                                       | 7,38                                   | (8,31)                                |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 2,51                                   | 0,71   | 0,40  | –                                       | 285,07                                 | 298,39                                |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit   | 2,64                                   | 0,78   | 0,50  | –                                       | 292,45                                 | 290,08                                |
| Ausschüttungen   | (0,12)                                 | –  | –   | –                                       | –                                      | (10,90)                               |
| Schlussnettoinventarwert   | 11,98                                  | 10,78  | 8,39  | –                                       | 1.742,53                               | 1.729,24                              |
| Gesamtertrag   | 28,28 %                                | 7,80 %   | 6,34 %  | –                                       | 20,17 %                                | 20,17 %                               |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>   |  |  |   |   |  |                                       |
| Aufwendungen <sup>++</sup>   | 0,55 %                                 | 0,70 %   | 1,10 %  | –                                       | 1,06 %                                 | 0,98 %                                |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)   | 1,27 %                                 | 1,40 %   | 1,29 %  | –                                       | 0,46 %                                 | (0,55 %)                              |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Japan Equity Engagement (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>JPY I5<br>¥ | Thesaurierende<br>Klasse<br>JPY Z<br>¥ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A*<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I*<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I5 (nicht<br>währungs-<br>gesichert)*<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD X (nicht<br>währungs-<br>gesichert)*<br>US\$ |
|---|---|--|--|--|---|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |  |  |  |   |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 11.320,64                               | 1.117,91                               | 10,00                                      | 10,00                                      | 10,00   | 10,00  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |  |  |   |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 151,88                                  | 19,99                                  | (0,01)                                     | 0,09                                       | 0,05  | 0,01   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 1.593,97                                | 157,91                                 | 1,04                                       | 1,31                                       | (0,33)  | (0,52)   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1.745,85                                | 177,90                                 | 1,03                                       | 1,40                                       | (0,28)  | (0,51)   |
| Schlussnettoinventarwert  | 13.066,49                               | 1.295,81                               | 11,03                                      | 11,40                                      | 9,72  | 9,49   |
| Gesamtertrag  | 15,42 %                                 | 15,91 %                                | 10,30 %                                    | 14,00 %                                    | (2,80 %)  | (5,10 %)   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |  |  |  |   |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,66 %                                  | 0,22 %                                 | 1,89 %                                     | 1,06 %                                     | 0,72 %  | 0,49 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 1,24 %                                  | 1,65 %                                 | (0,12 %)                                   | 0,99 %                                     | 1,84 %  | 1,82 %   |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |   |  |  |  |   |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 9.380,86                                | 922,43                                 | –  | –  | –   | –  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |  |  |   |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 133,80                                  | 15,96                                  | –  | –  | –   | –  |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 1.805,98                                | 179,52                                 | –  | –  | –   | –  |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1.939,78                                | 195,48                                 | –  | –  | –   | –  |
| Schlussnettoinventarwert  | 11.320,64                               | 1.117,91                               | –  | –  | –   | –  |
| Gesamtertrag  | 20,68 %                                 | 21,19 %                                | –  | –  | –   | –  |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |  |  |  |   |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,62 %                                  | 0,17 %                                 | –  | –  | –   | –  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 1,28 %                                  | 1,56 %                                 | –  | –  | –   | –  |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Next Generation Connectivity

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>AUD A<br>AUD | Thesaurierende<br>Klasse<br>AUD E*<br>AUD | Thesaurierende<br>Klasse<br>AUD I2<br>AUD | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF A<br>CHF | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF I<br>CHF | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF I2<br>CHF |
|---|--|---|---|--|--|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |   |   |  |  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,77                                    | 10,00                                     | 11,32                                     | 10,62                                    | 10,65                                    | 11,37                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |   |   |  |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,15)                                   | (0,22)                                    | (0,01)                                    | (0,14)                                   | (0,03)                                   | (0,01)                                    |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 3,53                                     | 1,87                                      | 3,72                                      | 3,18                                     | 3,21                                     | 3,43                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 3,38                                     | 1,65                                      | 3,71                                      | 3,04                                     | 3,18                                     | 3,42                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 14,15                                    | 11,65                                     | 15,03                                     | 13,66                                    | 13,83                                    | 14,79                                     |
| Gesamtertrag  | 31,38 %                                  | 16,50 %                                   | 32,77 %                                   | 28,63 %                                  | 29,86 %                                  | 30,08 %                                   |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |          |          |          |          |          |          |
|--------------------------------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 1,95 %   | 2,99 %   | 0,86 %   | 1,87 %   | 1,00 %   | 0,82 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (1,18 %) | (2,28 %) | (0,10 %) | (1,14 %) | (0,27 %) | (0,05 %) |

**31. Dezember 2023**

|   |         |   |         |        |        |         |
|---|---------|---|---------|--------|--------|---------|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 7,98    | – | 10,00   | 10,00  | 10,00  | 10,00   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |         |   |         |        |        |         |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,11)  | – | 0,00    | (0,05) | (0,02) | 0,00    |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 2,90    | – | 1,32    | 0,67   | 0,67   | 1,37    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 2,79    | – | 1,32    | 0,62   | 0,65   | 1,37    |
| Schlussnettoinventarwert  | 10,77   | – | 11,32   | 10,62  | 10,65  | 11,37   |
| Gesamtertrag  | 34,96 % | – | 13,20 % | 6,20 % | 6,50 % | 13,70 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |          |   |          |          |          |          |
|--------------------------------|----------|---|----------|----------|----------|----------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 1,79 %   | – | 0,80 %   | 1,76 %   | 0,95 %   | 0,79 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (1,18 %) | – | (0,15 %) | (1,20 %) | (0,39 %) | (0,15 %) |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Next Generation Connectivity (Fortsetzung)

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>CNY A<br>CNY | Thesaurierende<br>Klasse<br>CNY I2<br>CNY | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A (nicht<br>währungsgesichert)<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I (nicht<br>währungsgesichert)<br>€ |
|--|--|---|--|---|--|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>   |  |   |  |   |  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert  | 76,51                                    | 113,42                                    | 11,22                                  | 12,48   | 10,50                                  | 12,14   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:  |  |   |  |   |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>  | (1,04)                                   | (0,13)                                    | (0,16)                                 | (0,18)  | (0,03)                                 | (0,04)  |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 24,44                                    | 36,34                                     | 3,68                                   | 5,49  | 3,44                                   | 5,36  |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit   | 23,40                                    | 36,21                                     | 3,52                                   | 5,31  | 3,41                                   | 5,32  |
| Schlussnettoinventarwert   | 99,91                                    | 149,63                                    | 14,74                                  | 17,79   | 13,91                                  | 17,46   |
| Gesamtertrag   | 30,58 %                                  | 31,93 %                                   | 31,37 %                                | 42,55 %   | 32,48 %                                | 43,82 %   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>   |  |   |  |   |  |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>   | 1,86 %                                   | 0,82 %                                    | 1,90 %                                 | 1,91 %  | 1,02 %                                 | 1,02 %  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)   | (1,14 %)                                 | (0,09 %)                                  | (1,16 %)                               | (1,16 %)  | (0,27 %)                               | (0,27 %)  |
| <b>31. Dezember 2023</b>   |  |   |  |   |  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert  | 57,01                                    | 100,00                                    | 8,32                                   | 9,34  | 7,73                                   | 9,01  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:  |  |   |  |   |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>  | (0,80)                                   | (0,05)                                    | (0,11)                                 | (0,13)  | (0,03)                                 | (0,04)  |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 20,30                                    | 13,47                                     | 3,01                                   | 3,27  | 2,80                                   | 3,17  |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit   | 19,50                                    | 13,42                                     | 2,90                                   | 3,14  | 2,77                                   | 3,13  |
| Schlussnettoinventarwert   | 76,51                                    | 113,42                                    | 11,22                                  | 12,48   | 10,50                                  | 12,14   |
| Gesamtertrag   | 34,20 %                                  | 13,42 %                                   | 34,86 %                                | 33,62 %   | 35,83 %                                | 34,74 %   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>   |  |   |  |   |  |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>   | 1,84 %                                   | 0,82 %                                    | 1,80 %                                 | 1,80 %  | 0,97 %                                 | 0,96 %  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)   | (1,23 %)                                 | (0,16 %)                                  | (1,20 %)                               | (1,19 %)  | (0,36 %)                               | (0,37 %)  |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Next Generation Connectivity (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I2<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I5<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M (nicht<br>währungsgesichert)<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP A<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I (nicht<br>währungs-<br>gesichert)<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I2<br>£ |
|---|---|---|---|--|--|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |   |   |  |  |   |
| Eröffnungnettoinventarwert  | 11,32                                   | 9,51                                    | 12,11   | 11,57                                  | 10,28  | 11,37                                   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |   |   |  |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,01)                                  | 0,02                                    | (0,30)  | (0,16)                                 | (0,03)   | (0,01)                                  |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 3,72                                    | 3,13                                    | 5,32  | 3,96                                   | 3,86   | 3,90                                    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 3,71                                    | 3,15                                    | 5,02  | 3,80                                   | 3,83   | 3,89                                    |
| Schlussnettoinventarwert  | 15,03                                   | 12,66                                   | 17,13   | 15,37                                  | 14,11  | 15,26                                   |
| Gesamtertrag  | 32,77 %                                 | 33,12 %                                 | 41,45 %   | 32,84 %                                | 37,26 %  | 34,21 %                                 |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |   |   |  |  |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,84 %                                  | 0,57 %                                  | 2,74 %  | 1,86 %                                 | 1,00 %   | 0,82 %                                  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | (0,10 %)                                | 0,17 %                                  | (2,00 %)  | (1,13 %)                               | (0,27 %)   | (0,10 %)                                |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |   |   |   |  |  |   |
| Eröffnungnettoinventarwert  | 10,00                                   | 6,97                                    | 9,14  | 8,45                                   | 7,81   | 10,00                                   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |   |   |  |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,00                                    | (0,02)                                  | (0,21)  | (0,12)                                 | (0,03)   | 0,00                                    |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 1,32                                    | 2,56                                    | 3,18  | 3,24                                   | 2,50   | 1,37                                    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,32                                    | 2,54                                    | 2,97  | 3,12                                   | 2,47   | 1,37                                    |
| Schlussnettoinventarwert  | 11,32                                   | 9,51                                    | 12,11   | 11,57                                  | 10,28  | 11,37                                   |
| Gesamtertrag  | 13,20 %                                 | 36,44 %                                 | 32,49 %   | 36,92 %                                | 31,63 %  | 13,70 %                                 |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |   |   |  |  |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,81 %                                  | 0,57 %                                  | 2,58 %  | 1,79 %                                 | 0,96 %   | 0,81 %                                  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | (0,15 %)                                | (0,32 %)                                | (1,97 %)  | (1,19 %)                               | (0,39 %)   | (0,15 %)                                |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Next Generation Connectivity (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>HKD A<br>HKD | Thesaurierende<br>Klasse<br>HKD I2<br>HKD | Thesaurierende<br>Klasse<br>SGD A<br>SGD | Thesaurierende<br>Klasse<br>SGD I2<br>SGD | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD E<br>US\$ |
|---|--|---|--|---|---|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |   |  |   |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 12,04                                    | 11,39                                     | 23,47                                    | 22,67                                     | 12,60                                     | 11,92                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |   |  |   |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,16)                                   | (0,01)                                    | (0,32)                                   | (0,03)                                    | (0,17)                                    | (0,33)                                    |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 4,07                                     | 3,86                                      | 7,65                                     | 7,41                                      | 4,42                                      | 4,18                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 3,91                                     | 3,85                                      | 7,33                                     | 7,38                                      | 4,25                                      | 3,85                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 15,95                                    | 15,24                                     | 30,80                                    | 30,05                                     | 16,85                                     | 15,77                                     |
| Gesamtertrag  | 32,48 %                                  | 33,80 %                                   | 31,23 %                                  | 32,55 %                                   | 33,73 %                                   | 32,30 %                                   |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |          |          |          |          |          |          |
|--------------------------------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 1,82 %   | 0,80 %   | 1,86 %   | 0,82 %   | 1,82 %   | 2,92 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (1,10 %) | (0,08 %) | (1,14 %) | (0,10 %) | (1,11 %) | (2,23 %) |

**31. Dezember 2023**

|   |         |         |         |         |         |         |
|---|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 8,80    | 10,00   | 17,27   | 20,00   | 9,12    | 10,00   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |         |         |         |         |         |         |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,13)  | 0,00    | (0,24)  | (0,01)  | (0,13)  | (0,22)  |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 3,37    | 1,39    | 6,44    | 2,68    | 3,61    | 2,14    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 3,24    | 1,39    | 6,20    | 2,67    | 3,48    | 1,92    |
| Schlussnettoinventarwert  | 12,04   | 11,39   | 23,47   | 22,67   | 12,60   | 11,92   |
| Gesamtertrag  | 36,82 % | 13,90 % | 35,90 % | 13,35 % | 38,16 % | 19,20 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |          |          |          |          |          |          |
|--------------------------------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 1,83 %   | 0,83 %   | 1,80 %   | 0,81 %   | 1,83 %   | 2,94 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (1,23 %) | (0,16 %) | (1,20 %) | (0,16 %) | (1,22 %) | (2,31 %) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Next Generation Connectivity (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I2<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I3<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I5<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M<br>US\$ |
|---|---|--|--|--|--|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |  |  |  |  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 13,65                                     | 13,65                                    | 8,74                                       | 9,30                                       | 12,70                                      | 11,02                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |  |  |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,04)                                    | (0,04)                                   | (0,01)                                     | 0,00                                       | 0,02                                       | (0,25)                                    |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 4,79                                      | 4,79                                     | 3,07                                       | 3,27                                       | 4,48                                       | 3,85                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 4,75                                      | 4,75                                     | 3,06                                       | 3,27                                       | 4,50                                       | 3,60                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 18,40                                     | 18,40                                    | 11,80                                      | 12,57                                      | 17,20                                      | 14,62                                     |
| Gesamtertrag  | 34,80 %                                   | 34,80 %                                  | 35,01 %                                    | 35,16 %                                    | 35,43 %                                    | 32,67 %                                   |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |          |          |          |          |        |          |
|--------------------------------|----------|----------|----------|----------|--------|----------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,97 %   | 0,97 %   | 0,81 %   | 0,72 %   | 0,55 % | 2,62 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,27 %) | (0,26 %) | (0,11 %) | (0,01 %) | 0,16 % | (1,91 %) |

**31. Dezember 2023**

|   |         |         |         |         |         |         |
|---|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 9,79    | 9,79    | 6,26    | 6,65    | 9,07    | 8,04    |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |         |         |         |         |         |         |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,04)  | (0,04)  | (0,01)  | (0,01)  | 0,01    | (0,19)  |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 3,90    | 3,90    | 2,49    | 2,66    | 3,62    | 3,17    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 3,86    | 3,86    | 2,48    | 2,65    | 3,63    | 2,98    |
| Schlussnettoinventarwert  | 13,65   | 13,65   | 8,74    | 9,30    | 12,70   | 11,02   |
| Gesamtertrag  | 39,43 % | 39,43 % | 39,62 % | 39,85 % | 40,02 % | 37,06 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |          |          |          |          |        |          |
|--------------------------------|----------|----------|----------|----------|--------|----------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,99 %   | 0,99 %   | 0,81 %   | 0,73 %   | 0,56 % | 2,64 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,38 %) | (0,37 %) | (0,21 %) | (0,11 %) | 0,06 % | (2,02 %) |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Next Generation Connectivity (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>ZAR A<br>ZAR | Thesaurierende<br>Klasse<br>ZAR E<br>ZAR |
|---|---|--|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 8,78                                      | 125,63                                   | 126,25                                   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,07                                      | (1,90)                                   | (3,60)                                   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 3,09                                      | 48,13                                    | 48,17                                    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 3,16                                      | 46,23                                    | 44,57                                    |
| Schlussnettoinventarwert  | 11,94                                     | 171,86                                   | 170,82                                   |
| Gesamtertrag  | 35,99 %                                   | 36,80 %                                  | 35,30 %                                  |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |          |          |
|--------------------------------|--------|----------|----------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,12 % | 1,91 %   | 3,00 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,64 % | (1,19 %) | (2,26 %) |

**31. Dezember 2023**

|   |         |         |         |
|---|---------|---------|---------|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 6,24    | 100,00  | 100,00  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |         |         |         |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,04    | (1,08)  | (2,20)  |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 2,50    | 26,71   | 28,45   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 2,54    | 25,63   | 26,25   |
| Schlussnettoinventarwert  | 8,78    | 125,63  | 126,25  |
| Gesamtertrag  | 40,71 % | 25,63 % | 26,25 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |          |          |
|--------------------------------|--------|----------|----------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,14 % | 1,78 %   | 2,85 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,48 % | (1,12 %) | (2,22 %) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Next Generation Mobility

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I (nicht<br>währungsgesichert)<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M (nicht<br>währungsgesichert)<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD C1<br>US\$ |
|---|--|--|---|---|---|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |  |   |   |   |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 14,54                                  | 10,36                                  | 16,80   | 19,34   | 16,82                                     | 17,99                                      |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |   |   |   |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,15)                                 | (0,01)                                 | (0,02)  | (0,37)  | (0,16)                                    | (0,35)                                     |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | (0,47)                                 | (0,34)                                 | 0,85  | 1,00  | (0,25)                                    | (0,26)                                     |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | (0,62)                                 | (0,35)                                 | 0,83  | 0,63  | (0,41)                                    | (0,61)                                     |
| Schlussnettoinventarwert  | 13,92                                  | 10,01                                  | 17,63   | 19,97   | 16,41                                     | 17,38                                      |
| Gesamtertrag  | (4,26 %)                               | (3,38 %)                               | 4,94 %  | 3,26 %  | (2,44 %)                                  | (3,39 %)                                   |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |          |          |          |          |          |          |
|--------------------------------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 1,99 %   | 1,10 %   | 1,10 %   | 2,82 %   | 1,90 %   | 2,90 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (1,01 %) | (0,12 %) | (0,11 %) | (1,82 %) | (0,95 %) | (1,90 %) |

**31. Dezember 2023**

|   |         |         |         |         |         |         |
|---|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 11,62   | 8,21    | 13,43   | 15,72   | 13,10   | 14,16   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |         |         |         |         |         |         |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,11)  | 0,00    | 0,00    | (0,29)  | (0,13)  | (0,30)  |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 3,03    | 2,15    | 3,37    | 3,91    | 3,85    | 4,13    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 2,92    | 2,15    | 3,37    | 3,62    | 3,72    | 3,83    |
| Schlussnettoinventarwert  | 14,54   | 10,36   | 16,80   | 19,34   | 16,82   | 17,99   |
| Gesamtertrag  | 25,13 % | 26,19 % | 25,09 % | 23,03 % | 28,40 % | 27,05 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |          |        |        |          |          |          |
|--------------------------------|----------|--------|--------|----------|----------|----------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 1,85 %   | 1,01 % | 1,02 % | 2,64 %   | 1,90 %   | 2,90 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,84 %) | 0,01 % | 0,00   | (1,61 %) | (0,85 %) | (1,84 %) |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Next Generation Mobility (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD X<br>US\$ |
|---|---|--|---|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |  |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 17,15                                     | 17,14                                    | 18,16                                     | 19,90                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,04)                                    | (0,01)                                   | (0,32)                                    | (0,16)                                    |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | (0,24)                                    | (0,27)                                   | (0,27)                                    | (0,30)                                    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | (0,28)                                    | (0,28)                                   | (0,59)                                    | (0,46)                                    |
| Schlussnettoinventarwert  | 16,87                                     | 16,86                                    | 17,57                                     | 19,44                                     |
| Gesamtertrag  | (1,63 %)                                  | (1,63 %)                                 | (3,25 %)                                  | (2,31 %)                                  |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |          |          |          |          |
|--------------------------------|----------|----------|----------|----------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 1,04 %   | 1,05 %   | 2,70 %   | 1,75 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,22 %) | (0,04 %) | (1,73 %) | (0,80 %) |

**31. Dezember 2023**

|   |         |         |         |         |
|---|---------|---------|---------|---------|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 13,25   | 13,24   | 14,25   | 15,48   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |         |         |         |         |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,00    | 0,00    | (0,27)  | (0,12)  |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 3,90    | 3,90    | 4,18    | 4,54    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 3,90    | 3,90    | 3,91    | 4,42    |
| Schlussnettoinventarwert  | 17,15   | 17,14   | 18,16   | 19,90   |
| Gesamtertrag  | 29,43 % | 29,46 % | 27,44 % | 28,55 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |        |          |          |
|--------------------------------|--------|--------|----------|----------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 1,05 % | 1,05 % | 2,70 %   | 1,74 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,02 % | 0,00   | (1,64 %) | (0,70 %) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Next Generation Space Economy

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A (nicht<br>währungs-<br>gesichert)*<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I3 (nicht<br>währungsgesichert)<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M (nicht<br>währungsgesichert)<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A*<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ |
|---|---|--|---|--|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |  |   |  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,00   | 11,72  | 11,36   | 10,00                                      | 12,23                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |   |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,02)  | 0,04   | (0,23)  | (0,02)                                     | 0,00                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,96  | 4,01   | 3,86  | 0,45                                       | 3,15                                      |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit  | 0,94  | 4,05   | 3,63  | 0,43                                       | 3,15                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 10,94   | 15,77  | 14,99   | 10,43                                      | 15,38                                     |
| Gesamtertrag  | 9,40 %  | 34,56 %  | 31,95 %   | 4,30 %                                     | 25,76 %                                   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>  |   |  |   |  |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 2,01 %  | 0,84 %   | 2,84 %  | 1,97 %                                     | 1,07 %                                    |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | (1,23 %)  | 0,29 %   | (1,72 %)  | (1,21 %)                                   | 0,03 %                                    |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |   |  |   |  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | –   | 9,51   | 9,39  | –  | 9,61                                      |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |   |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | –   | 0,03   | (0,16)  | –  | 0,01                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | –   | 2,18   | 2,13  | –  | 2,61                                      |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit  | –   | 2,21   | 1,97  | –  | 2,62                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | –   | 11,72  | 11,36   | –  | 12,23                                     |
| Gesamtertrag  | –   | 23,24 %  | 20,98 %   | –  | 27,26 %                                   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>  |   |  |   |  |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | –   | 0,79 %   | 2,66 %  | –  | 1,06 %                                    |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | –   | 0,32 %   | (1,53 %)  | –  | 0,06 %                                    |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Short Duration Emerging Market Debt

|  | Ausschüttende<br>Klasse<br>AUD A<br>(Monatlich)<br>AUD | Ausschüttende<br>Klasse<br>CAD A<br>(Monatlich)<br>CAD | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF A<br>CHF | Ausschüttende<br>Klasse<br>CHF A<br>CHF | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF I<br>CHF | Ausschüttende<br>Klasse<br>CHF I<br>CHF |
|--|--|--|--|---|--|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>   |  |  |  |   |  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert  | 7,87   | 8,23   | 9,54                                     | 6,80                                    | 10,01                                    | 6,82                                    |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:  |  |  |  |   |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>  | 0,32   | 0,33   | 0,39                                     | 0,27                                    | 0,45                                     | 0,28                                    |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,23   | 0,26   | (0,01)                                   | (0,01)                                  | 0,00                                     | 0,02                                    |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit   | 0,55   | 0,59   | 0,38                                     | 0,26                                    | 0,45                                     | 0,30                                    |
| Ausschüttungen   | (0,59)   | (0,62)   | –  | (0,23)                                  | –  | (0,26)                                  |
| Schlussnettoinventarwert   | 7,83   | 8,20   | 9,92                                     | 6,83                                    | 10,46                                    | 6,86                                    |
| Gesamtertrag   | 7,26 %   | 7,42 %   | 3,98 %                                   | 3,92 %                                  | 4,50 %                                   | 4,55 %                                  |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>   |  |  |  |   |  |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>   | 1,15 %   | 1,13 %   | 1,11 %                                   | 1,11 %                                  | 0,60 %                                   | 0,62 %                                  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)   | 4,07 %   | 3,98 %   | 3,95 %                                   | 3,91 %                                  | 4,41 %                                   | 4,07 %                                  |
| <b>31. Dezember 2023</b>   |  |  |  |   |  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert  | 7,91   | 8,21   | 9,23                                     | 6,80                                    | 9,64                                     | 6,82                                    |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:  |  |  |  |   |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>  | 0,24   | 0,25   | 0,27                                     | 0,20                                    | 0,33                                     | 0,23                                    |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,22   | 0,29   | 0,04                                     | 0,02                                    | 0,04                                     | 0,02                                    |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit   | 0,46   | 0,54   | 0,31                                     | 0,22                                    | 0,37                                     | 0,25                                    |
| Ausschüttungen   | (0,50)   | (0,52)   | –  | (0,22)                                  | –  | (0,25)                                  |
| Schlussnettoinventarwert   | 7,87   | 8,23   | 9,54                                     | 6,80                                    | 10,01                                    | 6,82                                    |
| Gesamtertrag   | 6,06 %   | 6,84 %   | 3,36 %                                   | 3,32 %                                  | 3,84 %                                   | 3,84 %                                  |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>   |  |  |  |   |  |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>   | 1,06 %   | 1,06 %   | 1,02 %                                   | 1,02 %                                  | 0,55 %                                   | 0,55 %                                  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)   | 3,05 %   | 3,11 %   | 2,93 %                                   | 2,94 %                                  | 3,35 %                                   | 3,41 %                                  |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF I2<br>CHF | Ausschüttende<br>Klasse<br>CHF I2<br>CHF | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF I5<br>CHF | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF P<br>CHF | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A<br>€ | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR A<br>€ |
|---|---|--|---|--|--|---------------------------------------|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |  |   |  |  |                                       |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,23                                     | 7,49                                     | 10,44                                     | 9,68                                     | 10,06                                  | 7,18                                  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |   |  |  |                                       |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,47                                      | 0,34                                     | 0,48                                      | 0,45                                     | 0,41                                   | 0,29                                  |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | (0,01)                                    | (0,01)                                   | 0,01                                      | (0,02)                                   | 0,25                                   | 0,17                                  |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,46                                      | 0,33                                     | 0,49                                      | 0,43                                     | 0,66                                   | 0,46                                  |
| Ausschüttungen  | –   | (0,30)                                   | –   | –  | –                                      | (0,25)                                |
| Schlussnettoinventarwert  | 10,69                                     | 7,52                                     | 10,93                                     | 10,11                                    | 10,72                                  | 7,39                                  |
| Gesamtertrag  | 4,50 %                                    | 4,48 %                                   | 4,69 %                                    | 4,44 %                                   | 6,56 %                                 | 6,49 %                                |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |  |   |  |  |                                       |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,50 %                                    | 0,50 %                                   | 0,34 %                                    | 0,57 %                                   | 1,13 %                                 | 1,13 %                                |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 4,46 %                                    | 4,53 %                                   | 4,54 %                                    | 4,50 %                                   | 3,95 %                                 | 3,93 %                                |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |   |  |   |  |  |                                       |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 9,84                                      | 7,49                                     | 10,02                                     | 9,32                                     | 9,55                                   | 7,04                                  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |   |  |  |                                       |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,35                                      | 0,26                                     | 0,37                                      | 0,32                                     | 0,30                                   | 0,21                                  |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,04                                      | 0,02                                     | 0,05                                      | 0,04                                     | 0,21                                   | 0,16                                  |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,39                                      | 0,28                                     | 0,42                                      | 0,36                                     | 0,51                                   | 0,37                                  |
| Ausschüttungen  | –   | (0,28)                                   | –   | –  | –                                      | (0,23)                                |
| Schlussnettoinventarwert  | 10,23                                     | 7,49                                     | 10,44                                     | 9,68                                     | 10,06                                  | 7,18                                  |
| Gesamtertrag  | 3,96 %                                    | 3,94 %                                   | 4,19 %                                    | 3,86 %                                   | 5,34 %                                 | 5,35 %                                |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |  |   |  |  |                                       |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,46 %                                    | 0,44 %                                   | 0,32 %                                    | 0,53 %                                   | 1,07 %                                 | 1,07 %                                |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 3,48 %                                    | 3,44 %                                   | 3,64 %                                    | 3,41 %                                   | 3,07 %                                 | 3,07 %                                |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I<br>€ | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I2<br>€ | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I2<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I5<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M<br>€ |
|---|--|---------------------------------------|---|--|---|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |                                       |   |  |   |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,56                                  | 7,18                                  | 10,65                                   | 7,77                                   | 11,07                                   | 9,76                                   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |                                       |   |  |   |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,49                                   | 0,33                                  | 0,51                                    | 0,36                                   | 0,55                                    | 0,34                                   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,26                                   | 0,17                                  | 0,26                                    | 0,19                                   | 0,26                                    | 0,24                                   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,75                                   | 0,50                                  | 0,77                                    | 0,55                                   | 0,81                                    | 0,58                                   |
| Ausschüttungen  | –                                      | (0,28)                                | –                                       | (0,31)                                 | –                                       | –                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 11,31                                  | 7,40                                  | 11,42                                   | 8,01                                   | 11,88                                   | 10,34                                  |
| Gesamtertrag  | 7,10 %                                 | 7,16 %                                | 7,23 %                                  | 7,29 %                                 | 7,32 %                                  | 5,94 %                                 |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |                                       |   |  |   |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,60 %                                 | 0,61 %                                | 0,50 %                                  | 0,50 %                                 | 0,35 %                                  | 1,75 %                                 |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 4,51 %                                 | 4,47 %                                | 4,62 %                                  | 4,58 %                                 | 4,79 %                                  | 3,40 %                                 |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |  |                                       |   |  |   |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 9,98                                   | 7,05                                  | 10,06                                   | 7,63                                   | 10,43                                   | 9,33                                   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |                                       |   |  |   |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,36                                   | 0,25                                  | 0,37                                    | 0,28                                   | 0,40                                    | 0,23                                   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,22                                   | 0,14                                  | 0,22                                    | 0,15                                   | 0,24                                    | 0,20                                   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,58                                   | 0,39                                  | 0,59                                    | 0,43                                   | 0,64                                    | 0,43                                   |
| Ausschüttungen  | –                                      | (0,26)                                | –                                       | (0,29)                                 | –                                       | –                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 10,56                                  | 7,18                                  | 10,65                                   | 7,77                                   | 11,07                                   | 9,76                                   |
| Gesamtertrag  | 5,81 %                                 | 5,72 %                                | 5,86 %                                  | 5,82 %                                 | 6,14 %                                  | 4,61 %                                 |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |                                       |   |  |   |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,58 %                                 | 0,58 %                                | 0,48 %                                  | 0,48 %                                 | 0,33 %                                  | 1,66 %                                 |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 3,56 %                                 | 3,56 %                                | 3,66 %                                  | 3,66 %                                 | 3,81 %                                  | 2,48 %                                 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

|   | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR M<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR P<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR U<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP A<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I<br>£ | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP I<br>£ |
|---|---------------------------------------|--|--|--|--|---------------------------------------|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |                                       |  |  |  |  |                                       |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 6,80                                  | 10,12                                  | 10,01                                  | 10,69                                  | 11,06                                  | 8,59                                  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |                                       |  |  |  |  |                                       |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,24                                  | 0,46                                   | 0,44                                   | 0,44                                   | 0,49                                   | 0,38                                  |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,16                                  | 0,27                                   | 0,25                                   | 0,43                                   | 0,47                                   | 0,35                                  |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,40                                  | 0,73                                   | 0,69                                   | 0,87                                   | 0,96                                   | 0,73                                  |
| Ausschüttungen  | (0,31)                                | –                                      | –                                      | –                                      | –                                      | (0,34)                                |
| Schlussnettoinventarwert  | 6,89                                  | 10,85                                  | 10,70                                  | 11,56                                  | 12,02                                  | 8,98                                  |
| Gesamtertrag  | 5,97 %                                | 7,21 %                                 | 6,89 %                                 | 8,14 %                                 | 8,68 %                                 | 8,66 %                                |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |                                       |  |  |  |  |                                       |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,76 %                                | 0,58 %                                 | 0,87 %                                 | 1,10 %                                 | 0,59 %                                 | 0,59 %                                |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 3,45 %                                | 4,44 %                                 | 4,23 %                                 | 3,91 %                                 | 4,31 %                                 | 4,33 %                                |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |                                       |  |  |  |  |                                       |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 6,79                                  | 9,56                                   | 9,49                                   | 10,00                                  | 10,30                                  | 8,30                                  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |                                       |  |  |  |  |                                       |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,17                                  | 0,34                                   | 0,32                                   | 0,31                                   | 0,37                                   | 0,29                                  |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,13                                  | 0,22                                   | 0,20                                   | 0,38                                   | 0,39                                   | 0,31                                  |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,30                                  | 0,56                                   | 0,52                                   | 0,69                                   | 0,76                                   | 0,60                                  |
| Ausschüttungen  | (0,29)                                | –                                      | –                                      | –                                      | –                                      | (0,31)                                |
| Schlussnettoinventarwert  | 6,80                                  | 10,12                                  | 10,01                                  | 10,69                                  | 11,06                                  | 8,59                                  |
| Gesamtertrag  | 4,56 %                                | 5,86 %                                 | 5,48 %                                 | 6,90 %                                 | 7,38 %                                 | 7,43 %                                |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |                                       |  |  |  |  |                                       |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,65 %                                | 0,55 %                                 | 0,82 %                                 | 1,06 %                                 | 0,57 %                                 | 0,57 %                                |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 2,49 %                                | 3,54 %                                 | 3,35 %                                 | 3,04 %                                 | 3,52 %                                 | 3,52 %                                |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I2<br>£ | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP I2<br>£ | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP I5<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP P<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>JPY I<br>¥ | Ausschüttende<br>Klasse<br>JPY I<br>¥ |
|---|---|--|--|--|--|---------------------------------------|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |  |  |  |  |                                       |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 11,06                                   | 8,43                                   | 7,92                                   | 10,39                                  | 1.045,62                               | 707,66                                |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |  |  |  |                                       |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,52                                    | 0,38                                   | 0,37                                   | 0,49                                   | 47,25                                  | 31,59                                 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,46                                    | 0,35                                   | 0,33                                   | 0,41                                   | (17,26)                                | (11,73)                               |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,98                                    | 0,73                                   | 0,70                                   | 0,90                                   | 29,99                                  | 19,86                                 |
| Ausschüttungen  | –                                       | (0,34)                                 | (0,33)                                 | –                                      | –                                      | (27,51)                               |
| Schlussnettoinventarwert  | 12,04                                   | 8,82                                   | 8,29                                   | 11,29                                  | 1.075,61                               | 700,01                                |
| Gesamtertrag  | 8,86 %                                  | 8,85 %                                 | 9,06 %                                 | 8,66 %                                 | 2,87 %                                 | 2,87 %                                |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |  |  |  |  |                                       |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,49 %                                  | 0,49 %                                 | 0,34 %                                 | 0,57 %                                 | 0,60 %                                 | 0,60 %                                |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 4,48 %                                  | 4,44 %                                 | 4,63 %                                 | 4,51 %                                 | 4,46 %                                 | 4,51 %                                |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |   |  |  |  |  |                                       |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,29                                   | 8,15                                   | 7,66                                   | 9,67                                   | 1.024,16                               | 719,95                                |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |  |  |  |                                       |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,38                                    | 0,30                                   | 0,29                                   | 0,35                                   | 37,46                                  | 25,73                                 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,39                                    | 0,29                                   | 0,27                                   | 0,37                                   | (16,00)                                | (11,28)                               |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,77                                    | 0,59                                   | 0,56                                   | 0,72                                   | 21,46                                  | 14,45                                 |
| Ausschüttungen  | –                                       | (0,31)                                 | (0,30)                                 | –                                      | –                                      | (26,74)                               |
| Schlussnettoinventarwert  | 11,06                                   | 8,43                                   | 7,92                                   | 10,39                                  | 1.045,62                               | 707,66                                |
| Gesamtertrag  | 7,48 %                                  | 7,47 %                                 | 7,59 %                                 | 7,45 %                                 | 2,10 %                                 | 2,10 %                                |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |  |  |  |  |                                       |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,47 %                                  | 0,47 %                                 | 0,33 %                                 | 0,56 %                                 | 0,59 %                                 | 0,59 %                                |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 3,63 %                                  | 3,69 %                                 | 3,79 %                                 | 3,57 %                                 | 3,66 %                                 | 3,66 %                                |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>SEK A<br>SEK | Ausschüttende<br>Klasse<br>SGD A<br>(Monatlich)<br>SGD | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD A<br>(Monatlich)<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD A<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD C1<br>US\$ |
|---|--|--|---|---|--|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |  |   |   |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 98,35                                    | 16,04  | 8,26  | 12,14                                     | 8,44                                     | 10,35                                      |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |   |   |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 3,99                                     | 0,62   | 0,32  | 0,48                                      | 0,32                                     | 0,29                                       |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 2,21                                     | 0,37   | 0,35  | 0,54                                      | 0,38                                     | 0,47                                       |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 6,20                                     | 0,99   | 0,67  | 1,02                                      | 0,70                                     | 0,76                                       |
| Ausschüttungen  | –  | (1,20)   | (0,62)  | –   | (0,29)                                   | –  |
| Schlussnettoinventarwert  | 104,55                                   | 15,83  | 8,31  | 13,16                                     | 8,85                                     | 11,11                                      |
| Gesamtertrag  | 6,30 %                                   | 6,40 %   | 8,46 %  | 8,40 %                                    | 8,50 %                                   | 7,34 %                                     |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |   |   |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,13 %                                   | 1,10 %   | 1,08 %  | 1,08 %                                    | 1,08 %                                   | 2,08 %                                     |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 3,93 %                                   | 3,90 %   | 3,81 %  | 3,81 %                                    | 3,77 %                                   | 2,70 %                                     |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |  |  |   |   |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 93,27                                    | 16,13  | 8,19  | 11,29                                     | 8,11                                     | 9,72                                       |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |   |   |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 2,82                                     | 0,49   | 0,25  | 0,36                                      | 0,26                                     | 0,21                                       |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 2,26                                     | 0,43   | 0,33  | 0,49                                      | 0,33                                     | 0,42                                       |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 5,08                                     | 0,92   | 0,58  | 0,85                                      | 0,59                                     | 0,63                                       |
| Ausschüttungen  | –  | (1,01)   | (0,51)  | –   | (0,26)                                   | –  |
| Schlussnettoinventarwert  | 98,35                                    | 16,04  | 8,26  | 12,14                                     | 8,44                                     | 10,35                                      |
| Gesamtertrag  | 5,45 %                                   | 5,98 %   | 7,45 %  | 7,53 %                                    | 7,51 %                                   | 6,48 %                                     |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |   |   |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,04 %                                   | 1,07 %   | 1,09 %  | 1,09 %                                    | 1,09 %                                   | 2,09 %                                     |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 2,98 %                                   | 3,08 %   | 3,14 %  | 3,13 %                                    | 3,14 %                                   | 2,13 %                                     |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

|   | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD C1<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I2<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I2<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I5<br>US\$ |
|---|---|---|--|--|---|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |   |  |  |   |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 8,92                                      | 12,74                                     | 8,97                                     | 12,52                                      | 8,96                                      | 12,98                                      |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |   |  |  |   |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,25                                      | 0,57                                      | 0,39                                     | 0,57                                       | 0,40                                      | 0,62                                       |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,39                                      | 0,57                                      | 0,40                                     | 0,57                                       | 0,39                                      | 0,58                                       |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,64                                      | 1,14                                      | 0,79                                     | 1,14                                       | 0,79                                      | 1,20                                       |
| Ausschüttungen  | (0,22)                                    | –   | (0,36)                                   | –  | (0,36)                                    | –  |
| Schlussnettoinventarwert  | 9,34                                      | 13,88                                     | 9,40                                     | 13,66                                      | 9,39                                      | 14,18                                      |
| Gesamtertrag  | 7,28 %                                    | 8,95 %                                    | 8,96 %                                   | 9,11 %                                     | 9,08 %                                    | 9,24 %                                     |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |   |  |  |   |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 2,08 %                                    | 0,58 %                                    | 0,58 %                                   | 0,48 %                                     | 0,48 %                                    | 0,33 %                                     |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 2,79 %                                    | 4,31 %                                    | 4,27 %                                   | 4,37 %                                     | 4,42 %                                    | 4,55 %                                     |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |   |   |  |  |   |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 8,57                                      | 11,79                                     | 8,62                                     | 11,58                                      | 8,61                                      | 11,98                                      |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |   |  |  |   |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,18                                      | 0,44                                      | 0,32                                     | 0,44                                       | 0,33                                      | 0,48                                       |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,36                                      | 0,51                                      | 0,35                                     | 0,50                                       | 0,35                                      | 0,52                                       |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,54                                      | 0,95                                      | 0,67                                     | 0,94                                       | 0,68                                      | 1,00                                       |
| Ausschüttungen  | (0,19)                                    | –   | (0,32)                                   | –  | (0,33)                                    | –  |
| Schlussnettoinventarwert  | 8,92                                      | 12,74                                     | 8,97                                     | 12,52                                      | 8,96                                      | 12,98                                      |
| Gesamtertrag  | 6,46 %                                    | 8,06 %                                    | 8,04 %                                   | 8,12 %                                     | 8,15 %                                    | 8,35 %                                     |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |   |  |  |   |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 2,09 %                                    | 0,59 %                                    | 0,59 %                                   | 0,49 %                                     | 0,49 %                                    | 0,34 %                                     |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 2,13 %                                    | 3,63 %                                    | 3,64 %                                   | 3,68 %                                     | 3,78 %                                    | 3,89 %                                     |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

|   | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I5<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD M<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD P<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z<br>US\$ |
|---|---|---|--|---|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |   |  |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 8,58                                      | 10,62                                     | 8,02                                     | 12,34                                     | 13,22                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |   |  |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,40                                      | 0,35                                      | 0,26                                     | 0,54                                      | 0,66                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,38                                      | 0,48                                      | 0,34                                     | 0,57                                      | 0,60                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,78                                      | 0,83                                      | 0,60                                     | 1,11                                      | 1,26                                      |
| Ausschüttungen  | (0,36)                                    | –   | (0,36)                                   | –   | –   |
| Schlussnettoinventarwert  | 9,00                                      | 11,45                                     | 8,26                                     | 13,45                                     | 14,48                                     |
| Gesamtertrag  | 9,34 %                                    | 7,82 %                                    | 7,73 %                                   | 9,00 %                                    | 9,53 %                                    |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |        |        |        |        |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,33 % | 1,68 % | 1,68 % | 0,56 % | 0,08 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 4,52 % | 3,21 % | 3,16 % | 4,21 % | 4,79 % |

**31. Dezember 2023**

|   |        |        |        |        |        |
|---|--------|--------|--------|--------|--------|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 8,25   | 9,94   | 7,84   | 11,42  | 12,18  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |        |        |        |        |        |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,32   | 0,26   | 0,20   | 0,43   | 0,52   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,34   | 0,42   | 0,32   | 0,49   | 0,52   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,66   | 0,68   | 0,52   | 0,92   | 1,04   |
| Ausschüttungen  | (0,33) | –      | (0,34) | –      | –      |
| Schlussnettoinventarwert  | 8,58   | 10,62  | 8,02   | 12,34  | 13,22  |
| Gesamtertrag  | 8,25 % | 6,84 % | 6,84 % | 8,06 % | 8,54 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |        |        |        |        |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,34 % | 1,69 % | 1,69 % | 0,56 % | 0,09 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,89 % | 2,54 % | 2,53 % | 3,66 % | 4,14 % |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Short Duration Euro Bond

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF P<br>CHF | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF U<br>CHF | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I<br>€ | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I2<br>€ |
|---|--|--|--|--|---------------------------------------|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |  |  |  |                                       |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 102,04                                   | 101,34                                   | 100,22                                 | 105,88                                 | 99,85                                 | 104,65                                  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |  |  |                                       |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 2,81                                     | 2,65                                     | 2,76                                   | 3,03                                   | 2,79                                  | 2,98                                    |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 1,99                                     | 1,99                                     | 4,42                                   | 4,77                                   | 4,46                                  | 4,78                                    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 4,80                                     | 4,64                                     | 7,18                                   | 7,80                                   | 7,25                                  | 7,76                                    |
| Ausschüttungen  | –  | –  | –                                      | –                                      | (2,45)                                | –                                       |
| Schlussnettoinventarwert  | 106,84                                   | 105,98                                   | 107,40                                 | 113,68                                 | 104,65                                | 112,41                                  |
| Gesamtertrag  | 4,70 %                                   | 4,58 %                                   | 7,16 %                                 | 7,37 %                                 | 7,36 %                                | 7,42 %                                  |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |        |        |        |        |        |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,25 % | 0,36 % | 0,46 % | 0,27 % | 0,27 % | 0,23 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 2,69 % | 2,55 % | 2,63 % | 2,75 % | 2,73 % | 2,75 % |

**31. Dezember 2023**

|   |        |        |        |        |        |        |
|---|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 97,48  | 96,91  | 94,09  | 99,21  | 95,44  | 98,02  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |        |        |        |        |        |        |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 2,13   | 2,01   | 2,03   | 2,28   | 2,23   | 2,30   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 2,43   | 2,42   | 4,10   | 4,39   | 4,09   | 4,33   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 4,56   | 4,43   | 6,13   | 6,67   | 6,32   | 6,63   |
| Ausschüttungen  | –      | –      | –      | –      | (1,91) | –      |
| Schlussnettoinventarwert  | 102,04 | 101,34 | 100,22 | 105,88 | 99,85  | 104,65 |
| Gesamtertrag  | 4,68 % | 4,57 % | 6,52 % | 6,72 % | 6,71 % | 6,76 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |        |        |        |        |        |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,26 % | 0,37 % | 0,48 % | 0,28 % | 0,28 % | 0,24 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 2,14 % | 2,03 % | 2,09 % | 2,24 % | 2,30 % | 2,28 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Short Duration Euro Bond (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR IS<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR U<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR Z<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z<br>US\$ |
|---|---|--|--|--|---|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |  |  |  |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 106,36                                  | 98,98                                  | 103,96                                 | 107,11                                 | 104,93                                    | 117,20                                    |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |  |  |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 3,11                                    | 2,52                                   | 2,89                                   | 3,22                                   | 2,82                                      | 2,79                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 4,84                                    | 4,36                                   | 4,66                                   | 4,89                                   | 6,78                                      | 8,19                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 7,95                                    | 6,88                                   | 7,55                                   | 8,11                                   | 9,60                                      | 10,98                                     |
| Schlussnettoinventarwert  | 114,31                                  | 105,86                                 | 111,51                                 | 115,22                                 | 114,53                                    | 128,18                                    |
| Gesamtertrag  | 7,47 %                                  | 6,95 %                                 | 7,26 %                                 | 7,57 %                                 | 9,15 %                                    | 9,37 %                                    |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |        |        |        |        |        |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,17 % | 0,66 % | 0,37 % | 0,08 % | 0,25 % | 0,08 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 2,81 % | 2,44 % | 2,67 % | 2,90 % | 2,57 % | 2,36 % |

**31. Dezember 2023**

|   |        |        |        |        |        |        |
|---|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 99,56  | 93,22  | 97,51  | 100,17 | 96,33  | 107,40 |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |        |        |        |        |        |        |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 2,39   | 1,93   | 2,17   | 2,48   | 2,22   | 2,73   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 4,41   | 3,83   | 4,28   | 4,46   | 6,38   | 7,07   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 6,80   | 5,76   | 6,45   | 6,94   | 8,60   | 9,80   |
| Schlussnettoinventarwert  | 106,36 | 98,98  | 103,96 | 107,11 | 104,93 | 117,20 |
| Gesamtertrag  | 6,83 % | 6,18 % | 6,61 % | 6,93 % | 8,93 % | 9,12 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |        |        |        |        |        |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,18 % | 0,68 % | 0,39 % | 0,09 % | 0,29 % | 0,10 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 2,33 % | 1,99 % | 2,16 % | 2,41 % | 2,23 % | 2,45 % |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Short Duration High Yield Engagement

|   | Ausschüttende<br>Klasse<br>AUD A<br>(Monatlich)<br>AUD | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF A<br>CHF | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF I<br>CHF | Ausschüttende<br>Klasse<br>CNY A<br>(Monatlich)<br>CNY | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A<br>€ | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR A<br>€ |
|---|--|--|--|--|--|---------------------------------------|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |  |  |  |  |                                       |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 7,10   | 11,27                                    | 12,28                                    | 83,39  | 12,07                                  | 6,89                                  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |  |  |  |                                       |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,38   | 0,59                                     | 0,72                                     | 4,17   | 0,65                                   | 0,36                                  |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | (0,06)   | (0,40)                                   | (0,43)                                   | (1,42)   | (0,14)                                 | (0,08)                                |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,32   | 0,19                                     | 0,29                                     | 2,75   | 0,51                                   | 0,28                                  |
| Ausschüttungen  | (0,49)   | –  | –  | (5,74)   | –                                      | (0,34)                                |
| Schlussnettoinventarwert  | 6,93   | 11,46                                    | 12,57                                    | 80,40  | 12,58                                  | 6,83                                  |
| Gesamtertrag  | 4,71 %   | 1,69 %                                   | 2,36 %                                   | 3,43 %   | 4,23 %                                 | 4,25 %                                |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |  |  |  |                                       |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,41 %   | 1,35 %                                   | 0,73 %                                   | 1,33 %   | 1,37 %                                 | 1,37 %                                |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 5,48 %   | 5,18 %                                   | 5,80 %                                   | 5,11 %   | 5,27 %                                 | 5,26 %                                |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |  |  |  |  |  |                                       |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 7,08   | 10,75                                    | 11,64                                    | 84,25  | 11,29                                  | 6,76                                  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |  |  |  |                                       |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,34   | 0,51                                     | 0,62                                     | 4,16   | 0,57                                   | 0,33                                  |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,18   | 0,01                                     | 0,02                                     | 0,83   | 0,21                                   | 0,13                                  |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,52   | 0,52                                     | 0,64                                     | 4,99   | 0,78                                   | 0,46                                  |
| Ausschüttungen  | (0,50)   | –  | –  | (5,85)   | –                                      | (0,33)                                |
| Schlussnettoinventarwert  | 7,10   | 11,27                                    | 12,28                                    | 83,39  | 12,07                                  | 6,89                                  |
| Gesamtertrag  | 7,63 %   | 4,84 %                                   | 5,50 %                                   | 6,21 %   | 6,91 %                                 | 6,99 %                                |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |  |  |  |                                       |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,30 %   | 1,24 %                                   | 0,69 %                                   | 1,34 %   | 1,31 %                                 | 1,31 %                                |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 4,86 %   | 4,65 %                                   | 5,24 %                                   | 5,02 %   | 4,90 %                                 | 4,88 %                                |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Short Duration High Yield Engagement (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I2<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M<br>€ | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR M<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I<br>£ | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP I<br>£ |
|---|--|---|--|---------------------------------------|--|---------------------------------------|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |   |  |                                       |  |                                       |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 12,94                                  | 12,01                                   | 10,64                                  | 6,83                                  | 14,40                                  | 7,80                                  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |   |  |                                       |  |                                       |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,78                                   | 0,73                                    | 0,50                                   | 0,31                                  | 0,84                                   | 0,45                                  |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | (0,14)                                 | (0,14)                                  | (0,11)                                 | (0,07)                                | 0,07                                   | 0,02                                  |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,64                                   | 0,59                                    | 0,39                                   | 0,24                                  | 0,91                                   | 0,47                                  |
| Ausschüttungen  | –                                      | –                                       | –                                      | (0,43)                                | –                                      | (0,43)                                |
| Schlussnettoinventarwert  | 13,58                                  | 12,60                                   | 11,03                                  | 6,64                                  | 15,31                                  | 7,84                                  |
| Gesamtertrag  | 4,95 %                                 | 4,91 %                                  | 3,67 %                                 | 3,61 %                                | 6,32 %                                 | 6,28 %                                |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |        |        |        |        |        |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,74 % | 0,64 % | 1,99 % | 2,00 % | 0,72 % | 0,72 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 5,89 % | 5,99 % | 4,63 % | 4,64 % | 5,70 % | 5,75 % |

**31. Dezember 2023**

|   |        |        |        |        |        |        |
|---|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 12,03  | 11,15  | 10,01  | 6,83   | 13,18  | 7,53   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |        |        |        |        |        |        |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,68   | 0,65   | 0,44   | 0,29   | 0,72   | 0,42   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,23   | 0,21   | 0,19   | 0,13   | 0,50   | 0,26   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,91   | 0,86   | 0,63   | 0,42   | 1,22   | 0,68   |
| Ausschüttungen  | –      | –      | –      | (0,42) | –      | (0,41) |
| Schlussnettoinventarwert  | 12,94  | 12,01  | 10,64  | 6,83   | 14,40  | 7,80   |
| Gesamtertrag  | 7,56 % | 7,71 % | 6,29 % | 6,39 % | 9,26 % | 9,38 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |        |        |        |        |        |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,72 % | 0,62 % | 1,89 % | 1,89 % | 0,70 % | 0,73 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 5,49 % | 5,62 % | 4,30 % | 4,30 % | 5,34 % | 5,54 % |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Short Duration High Yield Engagement (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I2<br>£ | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP I2<br>£ | Ausschüttende<br>Klasse<br>HKD A<br>(Monatlich)<br>HKD | Thesaurierende<br>Klasse<br>JPY I<br>¥ | Ausschüttende<br>Klasse<br>SGD A<br>(Monatlich)<br>SGD | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD A<br>(Monatlich)<br>US\$ |
|---|---|--|--|--|--|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |  |  |  |  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 13,38                                   | 7,60                                   | 10,06  | 1.250,95                               | 14,92  | 7,71  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |  |  |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,81                                    | 0,44                                   | 0,50   | 73,40                                  | 0,75   | 0,38  |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,06                                    | 0,03                                   | 0,00   | (62,86)                                | (0,15)   | 0,07  |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,87                                    | 0,47                                   | 0,50   | 10,54                                  | 0,60   | 0,45  |
| Ausschüttungen  | –                                       | (0,43)                                 | (0,70)   | –                                      | (1,03)   | (0,54)  |
| Schlussnettoinventarwert  | 14,25                                   | 7,64                                   | 9,86   | 1.261,49                               | 14,49  | 7,62  |
| Gesamtertrag  | 6,50 %                                  | 6,40 %                                 | 5,14 %   | 0,84 %                                 | 4,18 %   | 6,02 %  |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |  |  |  |  |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,62 %                                  | 0,62 %                                 | 1,30 %   | 0,74 %                                 | 1,34 %   | 1,31 %  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 5,85 %                                  | 5,85 %                                 | 5,00 %   | 5,85 %                                 | 5,14 %   | 5,03 %  |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |   |  |  |  |  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 12,24                                   | 7,34                                   | 9,97   | 1.205,68                               | 14,86  | 7,57  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |  |  |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,71                                    | 0,41                                   | 0,49   | 68,62                                  | 0,73   | 0,38  |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,43                                    | 0,26                                   | 0,30   | (23,35)                                | 0,37   | 0,29  |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,14                                    | 0,67                                   | 0,79   | 45,27                                  | 1,10   | 0,67  |
| Ausschüttungen  | –                                       | (0,41)                                 | (0,70)   | –                                      | (1,04)   | (0,53)  |
| Schlussnettoinventarwert  | 13,38                                   | 7,60                                   | 10,06  | 1.250,95                               | 14,92  | 7,71  |
| Gesamtertrag  | 9,31 %                                  | 9,44 %                                 | 8,25 %   | 3,75 %                                 | 7,74 %   | 9,25 %  |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |  |  |  |  |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,62 %                                  | 0,62 %                                 | 1,33 %   | 0,74 %                                 | 1,31 %   | 1,33 %  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 5,56 %                                  | 5,54 %                                 | 4,97 %   | 5,62 %                                 | 4,93 %   | 5,00 %  |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Short Duration High Yield Engagement (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD A<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD C1<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I2<br>US\$ |
|---|---|--|--|---|--|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |  |  |   |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 14,33                                     | 8,23                                     | 11,10                                      | 15,39                                     | 8,42                                     | 14,44                                      |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |  |   |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,74                                      | 0,41                                     | 0,46                                       | 0,89                                      | 0,47                                     | 0,85                                       |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,13                                      | 0,07                                     | 0,09                                       | 0,14                                      | 0,07                                     | 0,13                                       |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,87                                      | 0,48                                     | 0,55                                       | 1,03                                      | 0,54                                     | 0,98                                       |
| Ausschüttungen  | –   | (0,41)                                   | –  | –   | (0,47)                                   | –  |
| Schlussnettoinventarwert  | 15,20                                     | 8,30                                     | 11,65                                      | 16,42                                     | 8,49                                     | 15,42                                      |
| Gesamtertrag  | 6,07 %                                    | 6,07 %                                   | 4,95 %                                     | 6,69 %                                    | 6,68 %                                   | 6,79 %                                     |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |  |  |   |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,31 %                                    | 1,31 %                                   | 2,31 %                                     | 0,71 %                                    | 0,71 %                                   | 0,61 %                                     |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 5,04 %                                    | 5,04 %                                   | 4,03 %                                     | 5,63 %                                    | 5,60 %                                   | 5,72 %                                     |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |   |  |  |   |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 13,11                                     | 7,91                                     | 10,26                                      | 14,00                                     | 8,09                                     | 13,11                                      |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |  |   |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,68                                      | 0,40                                     | 0,42                                       | 0,82                                      | 0,46                                     | 0,75                                       |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,54                                      | 0,31                                     | 0,42                                       | 0,57                                      | 0,31                                     | 0,58                                       |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,22                                      | 0,71                                     | 0,84                                       | 1,39                                      | 0,77                                     | 1,33                                       |
| Ausschüttungen  | –   | (0,39)                                   | –  | –   | (0,44)                                   | –  |
| Schlussnettoinventarwert  | 14,33                                     | 8,23                                     | 11,10                                      | 15,39                                     | 8,42                                     | 14,44                                      |
| Gesamtertrag  | 9,31 %                                    | 9,25 %                                   | 8,19 %                                     | 9,93 %                                    | 9,94 %                                   | 10,14 %                                    |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |  |  |   |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,33 %                                    | 1,33 %                                   | 2,33 %                                     | 0,73 %                                    | 0,74 %                                   | 0,62 %                                     |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 4,99 %                                    | 4,99 %                                   | 3,98 %                                     | 5,59 %                                    | 5,65 %                                   | 5,57 %                                     |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Short Duration High Yield Engagement (Fortsetzung)

|   | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I2<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I4<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I5<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD M<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z<br>US\$ |
|---|---|--|--|---|--|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |  |  |   |  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 8,22                                      | 10,66                                      | 11,07                                      | 11,46                                     | 8,17                                     | 13,98                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |  |   |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,47                                      | 0,65                                       | 0,68                                       | 0,52                                      | 0,36                                     | 0,90                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,07                                      | 0,10                                       | 0,10                                       | 0,10                                      | 0,06                                     | 0,12                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,54                                      | 0,75                                       | 0,78                                       | 0,62                                      | 0,42                                     | 1,02                                      |
| Ausschüttungen  | (0,47)                                    | –  | –  | –   | (0,51)                                   | –   |
| Schlussnettoinventarwert  | 8,29                                      | 11,41                                      | 11,85                                      | 12,08                                     | 8,08                                     | 15,00                                     |
| Gesamtertrag  | 6,81 %                                    | 7,04 %                                     | 7,05 %                                     | 5,41 %                                    | 5,42 %                                   | 7,30 %                                    |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |  |  |   |  |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,61 %                                    | 0,48 %                                     | 0,41 %                                     | 1,91 %                                    | 1,91 %                                   | 0,11 %                                    |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 5,74 %                                    | 5,99 %                                     | 5,95 %                                     | 4,44 %                                    | 4,46 %                                   | 6,24 %                                    |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |   |  |  |   |  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 7,90                                      | 10,00                                      | 10,04                                      | 10,55                                     | 8,00                                     | 12,64                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |  |   |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,45                                      | 0,39                                       | 0,62                                       | 0,47                                      | 0,35                                     | 0,81                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,31                                      | 0,27                                       | 0,41                                       | 0,44                                      | 0,31                                     | 0,53                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,76                                      | 0,66                                       | 1,03                                       | 0,91                                      | 0,66                                     | 1,34                                      |
| Ausschüttungen  | (0,44)                                    | –  | –  | –   | (0,49)                                   | –   |
| Schlussnettoinventarwert  | 8,22                                      | 10,66                                      | 11,07                                      | 11,46                                     | 8,17                                     | 13,98                                     |
| Gesamtertrag  | 10,02 %                                   | 6,60 %                                     | 10,26 %                                    | 8,63 %                                    | 8,68 %                                   | 10,60 %                                   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |  |  |   |  |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,62 %                                    | 0,51 %                                     | 0,43 %                                     | 1,93 %                                    | 1,93 %                                   | 0,13 %                                    |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 5,63 %                                    | 5,95 %                                     | 5,90 %                                     | 4,34 %                                    | 4,35 %                                   | 6,17 %                                    |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Strategic Income

|   | Ausschüttende<br>Klasse<br>AUD A<br>(Monatlich)<br>AUD | Ausschüttende<br>Klasse<br>AUD E<br>(Monatlich)*<br>AUD | Ausschüttende<br>Klasse<br>AUD Z<br>(Monatlich)<br>AUD | Ausschüttende<br>Klasse<br>CNY A<br>(Monatlich)<br>CNY | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR A<br>(Monatlich)<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A<br>€ |
|---|--|---|--|--|--|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |   |  |  |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 8,07   | 10,00   | 8,80   | 100,06   | 7,50   | 10,64                                  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |   |  |  |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,33   | 0,24  | 0,45   | 3,87   | 0,30   | 0,44                                   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | (0,07)   | 0,11  | (0,08)   | (1,83)   | (0,10)   | (0,14)                                 |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,26   | 0,35  | 0,37   | 2,04   | 0,20   | 0,30                                   |
| Ausschüttungen  | (0,51)   | (0,50)  | (0,56)   | (6,36)   | (0,48)   | –                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 7,82   | 9,85  | 8,61   | 95,74  | 7,22   | 10,94                                  |
| Gesamtertrag  | 3,42 %   | (1,50 %)  | 4,42 %   | 2,11 %   | 2,74 %   | 2,82 %                                 |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |   |  |  |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,17 %   | 2,26 %  | 0,11 %   | 1,12 %   | 1,15 %   | 1,16 %                                 |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 4,15 %   | 3,22 %  | 5,20 %   | 3,98 %   | 4,06 %   | 4,11 %                                 |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |  |   |  |  |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 8,10   | –   | 8,74   | 100,00   | 7,56   | 10,05                                  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |   |  |  |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,24   | –   | 0,34   | 1,69   | 0,22   | 0,31                                   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,26   | –   | 0,29   | 2,12   | 0,21   | 0,28                                   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,50   | –   | 0,63   | 3,81   | 0,43   | 0,59                                   |
| Ausschüttungen  | (0,53)   | –   | (0,57)   | (3,75)   | (0,49)   | –                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 8,07   | –   | 8,80   | 100,06   | 7,50   | 10,64                                  |
| Gesamtertrag  | 6,42 %   | –   | 7,55 %   | 4,01 %   | 5,95 %   | 5,87 %                                 |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |   |  |  |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,08 %   | –   | 0,12 %   | 1,15 %   | 1,10 %   | 1,10 %                                 |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 3,00 %   | –   | 3,96 %   | 2,98 %   | 3,04 %   | 3,03 %                                 |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Strategic Income (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M<br>€ | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP A<br>(Monatlich)<br>£ | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP I<br>(Monatlich)<br>£ | Ausschüttende<br>Klasse<br>HKD A<br>(Monatlich)<br>HKD | Ausschüttende<br>Klasse<br>JPY X<br>(Monatlich)*<br>¥ |
|---|--|--|--|--|--|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |  |  |  |  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 11,37                                  | 10,37                                  | 8,01   | 10,23  | 8,35   | 1.000,00  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |  |  |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,52                                   | 0,36                                   | 0,31   | 0,45   | 0,32   | 35,21   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | (0,15)                                 | (0,14)                                 | 0,02   | 0,03   | (0,03)   | (28,13)   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,37                                   | 0,22                                   | 0,33   | 0,48   | 0,29   | 7,08  |
| Ausschüttungen  | –                                      | –                                      | (0,51)   | (0,66)   | (0,53)   | (50,39)   |
| Schlussnettoinventarwert  | 11,74                                  | 10,59                                  | 7,83   | 10,05  | 8,11   | 956,69  |
| Gesamtertrag  | 3,25 %                                 | 2,12 %                                 | 4,32 %   | 4,84 %   | 3,65 %   | 0,68 %  |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |  |  |  |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,63 %                                 | 1,78 %                                 | 1,13 %   | 0,61 %   | 1,10 %   | 1,14 %  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 4,54 %                                 | 3,40 %                                 | 3,98 %   | 4,46 %   | 3,89 %   | 4,13 %  |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |  |  |  |  |  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,68                                  | 9,85                                   | 7,95   | 10,00  | 8,31   | –   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |  |  |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,38                                   | 0,24                                   | 0,24   | 0,02   | 0,25   | –   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,31                                   | 0,28                                   | 0,34   | 0,21   | 0,33   | –   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,69                                   | 0,52                                   | 0,58   | 0,23   | 0,58   | –   |
| Ausschüttungen  | –                                      | –                                      | (0,52)   | –  | (0,54)   | –   |
| Schlussnettoinventarwert  | 11,37                                  | 10,37                                  | 8,01   | 10,23  | 8,35   | –   |
| Gesamtertrag  | 6,46 %                                 | 5,28 %                                 | 7,61 %   | 2,30 %   | 7,28 %   | –   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |  |  |  |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,61 %                                 | 1,68 %                                 | 1,10 %   | 0,67 %   | 1,12 %   | –   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 3,52 %                                 | 2,40 %                                 | 3,07 %   | 3,14 %   | 3,12 %   | –   |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Strategic Income (Fortsetzung)

|   | Ausschüttende<br>Klasse<br>JPY A<br>(Monatlich)<br>(nicht<br>währungs-<br>gesichert)*<br>¥ | Ausschüttende<br>Klasse<br>JPY E<br>(Monatlich)<br>(nicht<br>währungs-<br>gesichert)*<br>¥ | Thesaurierende<br>Klasse<br>JPY I<br>¥ | Thesaurierende<br>Klasse<br>JPY I (nicht<br>währungsgesichert)<br>¥ | Ausschüttende<br>Klasse<br>JPY I CG<br>¥ | Ausschüttende<br>Klasse<br>JPY I<br>¥ |
|---|--|--|--|---|--|---------------------------------------|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |  |  |   |  |                                       |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 1.000,00   | 1.000,00   | 1.092,06                               | 1.926,94  | 897,38                                   | 798,89                                |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |  |   |  |                                       |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 13,78  | 11,42  | 48,93                                  | 95,80   | 40,13                                    | (15,65)                               |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 63,42  | 64,58  | (57,75)                                | 236,12  | (47,37)                                  | 9,26                                  |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 77,20  | 76,00  | (8,82)                                 | 331,92  | (7,24)                                   | (6,39)                                |
| Ausschüttungen  | (15,92)  | (25,00)  | –                                      | –   | –  | (22,13)                               |
| Schlussnettoinventarwert  | 1.061,28   | 1.051,00   | 1.083,24                               | 2.258,86  | 890,14                                   | 770,37                                |
| Gesamtertrag  | 7,79 %   | 7,73 %   | (0,81 %)                               | 17,23 %   | (0,81 %)                                 | (0,80 %)                              |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |  |   |  |                                       |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,15 %   | 2,21 %   | 0,63 %                                 | 0,62 %  | 0,63 %                                   | 0,62 %                                |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 4,13 %   | 3,09 %   | 4,52 %                                 | 4,53 %  | 4,51 %                                   | (2,01 %)                              |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |  |  |  |   |  |                                       |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | –  | –  | 1.065,57                               | 1.656,82  | 875,62                                   | 803,30                                |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |  |   |  |                                       |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | –  | –  | 38,46                                  | 65,42   | 31,29                                    | 29,82                                 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | –  | –  | (11,97)                                | 204,70  | (9,53)                                   | (9,88)                                |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | –  | –  | 26,49                                  | 270,12  | 21,76                                    | 19,94                                 |
| Ausschüttungen  | –  | –  | –                                      | –   | –  | (24,35)                               |
| Schlussnettoinventarwert  | –  | –  | 1.092,06                               | 1.926,94  | 897,38                                   | 798,89                                |
| Gesamtertrag  | –  | –  | 2,49 %                                 | 16,30 %   | 2,49 %                                   | 2,56 %                                |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |  |   |  |                                       |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | –  | –  | 0,62 %                                 | 0,62 %  | 0,62 %                                   | 0,65 %                                |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | –  | –  | 3,60 %                                 | 3,59 %  | 3,56 %                                   | 3,68 %                                |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Strategic Income (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>JPY Z<br>¥ | Ausschüttende<br>Klasse<br>SGD A<br>(Monatlich)<br>SGD | Thesaurierende<br>Klasse<br>SGD A<br>SGD | Ausschüttende<br>Klasse<br>SGD I<br>(Monatlich)<br>SGD | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD X<br>(Monatlich)<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A<br>US\$ |
|---|--|--|--|--|---|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |  |  |  |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 942,88                                 | 15,90  | 21,73                                    | 17,77  | 8,23  | 12,31                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |  |  |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 47,30                                  | 0,63   | 0,88                                     | 0,78   | 0,32  | 0,49                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | (50,22)                                | (0,22)   | (0,29)                                   | (0,23)   | 0,05  | 0,08                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | (2,92)                                 | 0,41   | 0,59                                     | 0,55   | 0,37  | 0,57                                      |
| Ausschüttungen  | –                                      | (1,01)   | –  | (1,13)   | (0,53)  | –   |
| Schlussnettoinventarwert  | 939,96                                 | 15,30  | 22,32                                    | 17,19  | 8,07  | 12,88                                     |
| Gesamtertrag  | (0,31 %)                               | 2,70 %   | 2,72 %                                   | 3,24 %   | 4,65 %  | 4,63 %                                    |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |        |        |        |        |        |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,11 % | 1,13 % | 1,13 % | 0,61 % | 1,10 % | 1,10 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 5,04 % | 4,05 % | 4,01 % | 4,46 % | 3,91 % | 3,89 % |

**31. Dezember 2023**

|   |         |        |        |        |        |        |
|---|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 915,43  | 15,90  | 20,36  | 17,69  | 8,11   | 11,37  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |         |        |        |        |        |        |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 37,50   | 0,47   | 0,63   | 0,61   | 0,25   | 0,36   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | (10,05) | 0,56   | 0,74   | 0,62   | 0,40   | 0,58   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 27,45   | 1,03   | 1,37   | 1,23   | 0,65   | 0,94   |
| Ausschüttungen  | –       | (1,03) | –      | (1,15) | (0,53) | –      |
| Schlussnettoinventarwert  | 942,88  | 15,90  | 21,73  | 17,77  | 8,23   | 12,31  |
| Gesamtertrag  | 3,00 %  | 6,79 % | 6,73 % | 7,27 % | 8,34 % | 8,27 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |        |        |        |        |        |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,12 % | 1,11 % | 1,11 % | 0,61 % | 1,12 % | 1,12 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 4,06 % | 3,02 % | 3,02 % | 3,51 % | 3,09 % | 3,08 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Strategic Income (Fortsetzung)

|   | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD A<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD C1<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD E<br>(Monatlich)*<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I4<br>(Monatlich)*<br>US\$ |
|---|--|--|--|---|--|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |  |  |   |  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 9,88                                     | 10,71                                      | 10,00  | 13,36                                     | 9,93                                     | 10,00   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |  |   |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,38                                     | 0,31                                       | 0,23   | 0,60                                      | 0,44                                     | 0,21  |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,07                                     | 0,08                                       | 0,20   | 0,09                                      | 0,05                                     | 0,09  |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,45                                     | 0,39                                       | 0,43   | 0,69                                      | 0,49                                     | 0,30  |
| Ausschüttungen  | (0,33)                                   | –  | (0,50)   | –   | (0,38)                                   | (0,23)  |
| Schlussnettoinventarwert  | 10,00                                    | 11,10                                      | 9,93   | 14,05                                     | 10,04                                    | 10,07   |
| Gesamtertrag  | 4,69 %                                   | 3,64 %                                     | (0,70 %)   | 5,16 %                                    | 5,10 %                                   | 3,03 %  |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |        |        |        |        |        |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 1,10 % | 2,10 % | 2,13 % | 0,60 % | 0,61 % | 0,41 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,86 % | 2,84 % | 3,02 % | 4,38 % | 4,41 % | 4,69 % |

**31. Dezember 2023**

|   |        |        |   |        |        |   |
|---|--------|--------|---|--------|--------|---|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 9,39   | 9,99   | – | 12,27  | 9,43   | – |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |        |        |   |        |        |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,29   | 0,21   | – | 0,45   | 0,34   | – |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,47   | 0,51   | – | 0,64   | 0,48   | – |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,76   | 0,72   | – | 1,09   | 0,82   | – |
| Ausschüttungen  | (0,27) | –      | – | –      | (0,32) | – |
| Schlussnettoinventarwert  | 9,88   | 10,71  | – | 13,36  | 9,93   | – |
| Gesamtertrag  | 8,24 % | 7,21 % | – | 8,88 % | 8,87 % | – |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |        |   |        |        |   |
|--------------------------------|--------|--------|---|--------|--------|---|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 1,12 % | 2,12 % | – | 0,62 % | 0,62 % | – |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,09 % | 2,07 % | – | 3,58 % | 3,59 % | – |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Strategic Income (Fortsetzung)

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD M<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>ZAR A<br>(Monatlich)*<br>ZAR | Ausschüttende<br>Klasse<br>ZAR E<br>(Monatlich)*<br>ZAR |
|--|---|--|---|---|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>   |   |  |   |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert  | 12,23                                     | 8,54                                     | 13,55                                     | 100,00  | 100,00  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:  |   |  |   |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>  | 0,41                                      | 0,28                                     | 0,67                                      | 3,08  | 2,37  |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,08                                      | 0,06                                     | 0,10                                      | 5,08  | 3,87  |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit   | 0,49                                      | 0,34                                     | 0,77                                      | 8,16  | 6,24  |
| Ausschüttungen   | –   | (0,41)                                   | –   | (6,37)  | (7,17)  |
| Schlussnettoinventarwert   | 12,72                                     | 8,47                                     | 14,32                                     | 101,79  | 99,07   |
| Gesamtertrag   | 4,01 %                                    | 4,11 %                                   | 5,68 %                                    | 8,30 %  | (0,93 %)  |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>   |   |  |   |   |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>   | 1,70 %                                    | 1,70 %                                   | 0,10 %                                    | 1,16 %  | 2,23 %  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)   | 3,28 %                                    | 3,27 %                                   | 4,85 %                                    | 4,16 %  | 3,17 %  |
| <b>31. Dezember 2023</b>   |   |  |   |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert  | 11,36                                     | 8,30                                     | 12,39                                     | –   | –   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:  |   |  |   |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>  | 0,29                                      | 0,21                                     | 0,52                                      | –   | –   |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,58                                      | 0,40                                     | 0,64                                      | –   | –   |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit   | 0,87                                      | 0,61                                     | 1,16                                      | –   | –   |
| Ausschüttungen   | –   | (0,37)                                   | –   | –   | –   |
| Schlussnettoinventarwert   | 12,23                                     | 8,54                                     | 13,55                                     | –   | –   |
| Gesamtertrag   | 7,66 %                                    | 7,64 %                                   | 9,36 %                                    | –   | –   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>   |   |  |   |   |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>   | 1,72 %                                    | 1,72 %                                   | 0,12 %                                    | –   | –   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)   | 2,48 %                                    | 2,48 %                                   | 4,07 %                                    | –   | –   |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Sustainable Asia High Yield

|   | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD A<br>(Monatlich)<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD Z<br>US\$ |
|---|---|---|---|---|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |   |   |   |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 7,07  | 8,40                                      | 8,51                                      | 8,93                                      | 9,13                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |   |   |   |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,27  | 0,34                                      | 0,40                                      | 0,47                                      | 0,47                                     |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,63  | 0,78                                      | 0,78                                      | 0,83                                      | 0,83                                     |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,90  | 1,12                                      | 1,18                                      | 1,30                                      | 1,30                                     |
| Ausschüttungen  | (0,63)  | –   | –   | –   | (0,46)                                   |
| Schlussnettoinventarwert  | 7,34  | 9,52                                      | 9,69                                      | 10,23                                     | 9,97                                     |
| Gesamtertrag  | 13,20 %   | 13,33 %                                   | 13,87 %                                   | 14,56 %                                   | 14,58 %                                  |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |        |        |        |        |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 1,40 % | 1,41 % | 0,80 % | 0,21 % | 0,21 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,70 % | 3,71 % | 4,31 % | 4,90 % | 4,91 % |

**31. Dezember 2023**

|   |        |        |        |        |        |
|---|--------|--------|--------|--------|--------|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 7,63   | 8,28   | 8,34   | 8,70   | 9,42   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |        |        |        |        |        |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,27   | 0,34   | 0,39   | 0,46   | 0,48   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | (0,17) | (0,22) | (0,22) | (0,23) | (0,25) |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,10   | 0,12   | 0,17   | 0,23   | 0,23   |
| Ausschüttungen  | (0,66) | –      | –      | –      | (0,52) |
| Schlussnettoinventarwert  | 7,07   | 8,40   | 8,51   | 8,93   | 9,13   |
| Gesamtertrag  | 1,47 % | 1,45 % | 2,04 % | 2,64 % | 2,56 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |        |        |        |        |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 1,42 % | 1,41 % | 0,82 % | 0,22 % | 0,22 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,75 % | 4,09 % | 4,68 % | 5,28 % | 5,29 % |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I3<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I4<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR X<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I5<br>US\$ |
|---|---|---|--|---|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |   |  |   |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 11,95                                   | 10,83                                   | 9,27                                   | 9,66                                      | 9,71                                       |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |   |  |   |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,65                                    | 0,61                                    | 0,55                                   | 0,53                                      | 0,54                                       |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,37                                    | 0,32                                    | 0,26                                   | 0,47                                      | 0,49                                       |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,02                                    | 0,93                                    | 0,81                                   | 1,00                                      | 1,03                                       |
| Schlussnettoinventarwert  | 12,97                                   | 11,76                                   | 10,08                                  | 10,66                                     | 10,74                                      |
| Gesamtertrag  | 8,54 %                                  | 8,59 %                                  | 8,74 %                                 | 10,35 %                                   | 10,61 %                                    |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |        |        |        |        |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,60 % | 0,52 % | 0,45 % | 0,77 % | 0,43 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 5,26 % | 5,40 % | 5,61 % | 5,08 % | 5,25 % |

**31. Dezember 2023**

|   |         |        |         |         |         |
|---|---------|--------|---------|---------|---------|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,79   | 10,00  | 8,36    | 8,54    | 8,55    |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |         |        |         |         |         |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,49    | 0,33   | 0,39    | 0,39    | 0,42    |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,67    | 0,50   | 0,52    | 0,73    | 0,74    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,16    | 0,83   | 0,91    | 1,12    | 1,16    |
| Schlussnettoinventarwert  | 11,95   | 10,83  | 9,27    | 9,66    | 9,71    |
| Gesamtertrag  | 10,75 % | 8,30 % | 10,89 % | 13,11 % | 13,57 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |        |        |        |        |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,59 % | 0,51 % | 0,45 % | 0,79 % | 0,47 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 4,42 % | 4,55 % | 4,55 % | 4,35 % | 4,67 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Tactical Macro<sup>1</sup>

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I5*<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I5<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z<br>US\$ |
|---|--|---|--|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |   |  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,00                                    | 10,22                                     | 10,24                                      | 10,26                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |   |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,07                                     | 0,03                                      | 0,06                                       | 0,11                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,24                                     | 0,41                                      | 0,43                                       | 0,42                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,31                                     | 0,44                                      | 0,49                                       | 0,53                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 10,31                                    | 10,66                                     | 10,73                                      | 10,79                                     |
| Gesamtertrag  | 3,10 %                                   | 4,31 %                                    | 4,79 %                                     | 5,17 %                                    |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |        |        |        |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,65 % | 1,01 % | 0,62 % | 0,22 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,75 % | 0,29 % | 0,60 % | 1,07 % |

**31. Dezember 2023**

|   |   |        |        |        |
|---|---|--------|--------|--------|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | – | 10,00  | 10,00  | 10,00  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |        |        |        |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | – | 0,01   | 0,10   | 0,06   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | – | 0,21   | 0,14   | 0,20   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | – | 0,22   | 0,24   | 0,26   |
| Schlussnettoinventarwert  | – | 10,22  | 10,24  | 10,26  |
| Gesamtertrag  | – | 2,20 % | 2,40 % | 2,60 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |   |        |        |        |
|--------------------------------|---|--------|--------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | – | 0,97 % | 0,70 % | 0,18 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | – | 0,31 % | 2,02 % | 1,13 % |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Uncorrelated Strategies

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF I<br>CHF | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I2<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR P<br>€ |
|---|--|--|--|---|--|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |  |  |   |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 9,07                                     | 8,94                                   | 9,40                                   | 9,72                                    | 8,66                                   | 8,83                                   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |  |   |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,07                                     | 0,03                                   | 0,10                                   | 0,07                                    | (0,06)                                 | 0,32                                   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,16                                     | 0,34                                   | 0,37                                   | 0,43                                    | 0,35                                   | 0,12                                   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,23                                     | 0,37                                   | 0,47                                   | 0,50                                    | 0,29                                   | 0,44                                   |
| Schlussnettoinventarwert  | 9,30                                     | 9,31                                   | 9,87                                   | 10,22                                   | 8,95                                   | 9,27                                   |
| Gesamtertrag  | 2,54 %                                   | 4,14 %                                 | 5,00 %                                 | 5,14 %                                  | 3,35 %                                 | 4,98 %                                 |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |        |        |        |          |        |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|----------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 1,79 % | 2,60 % | 1,79 % | 1,63 % | 3,42 %   | 1,76 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,83 % | 0,29 % | 1,11 % | 0,76 % | (0,71 %) | 3,70 % |

**31. Dezember 2023**

|   |           |           |           |           |           |           |
|---|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,34     | 10,07     | 10,51     | 10,85     | 9,83      | 9,85      |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |           |           |           |           |           |           |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,06)    | (0,14)    | (0,07)    | (0,05)    | (0,20)    | (0,07)    |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | (1,21)    | (0,99)    | (1,04)    | (1,08)    | (0,97)    | (0,95)    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | (1,27)    | (1,13)    | (1,11)    | (1,13)    | (1,17)    | (1,02)    |
| Schlussnettoinventarwert  | 9,07      | 8,94      | 9,40      | 9,72      | 8,66      | 8,83      |
| Gesamtertrag  | (12,28 %) | (11,22 %) | (10,56 %) | (10,41 %) | (11,90 %) | (10,36 %) |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |          |          |          |          |          |          |
|--------------------------------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 1,78 %   | 2,60 %   | 1,81 %   | 1,73 %   | 3,40 %   | 1,74 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,62 %) | (1,44 %) | (0,69 %) | (0,51 %) | (2,19 %) | (0,72 %) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I2<br>£ | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP I2<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I5<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP P<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP Z<br>£ |
|---|--|---|--|---|--|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |   |  |   |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,47                                  | 10,52                                   | 9,07                                   | 10,72                                   | 10,15                                  | 11,01                                  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |   |  |   |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,03)                                 | 0,13                                    | 0,47                                   | 0,45                                    | 0,18                                   | 0,20                                   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,71                                   | 0,57                                    | 0,14                                   | 0,29                                    | 0,48                                   | 0,61                                   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,68                                   | 0,70                                    | 0,61                                   | 0,74                                    | 0,66                                   | 0,81                                   |
| Schlussnettoinventarwert  | 11,15                                  | 11,22                                   | 9,68                                   | 11,46                                   | 10,81                                  | 11,82                                  |
| Gesamtertrag  | 6,49 %                                 | 6,65 %                                  | 6,73 %                                 | 6,90 %                                  | 6,50 %                                 | 7,36 %                                 |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |          |        |        |        |        |        |
|--------------------------------|----------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 1,73 %   | 1,61 % | 1,57 % | 1,36 % | 1,74 % | 0,97 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,29 %) | 1,22 % | 5,23 % | 4,24 % | 1,78 % | 1,82 % |

**31. Dezember 2023**

|   |          |          |          |          |          |          |
|---|----------|----------|----------|----------|----------|----------|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 11,52    | 11,56    | 9,96     | 11,74    | 11,16    | 12,02    |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |          |          |          |          |          |          |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,08)   | (0,05)   | (0,03)   | (0,04)   | (0,06)   | 0,02     |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | (0,97)   | (0,99)   | (0,86)   | (0,98)   | (0,95)   | (1,03)   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | (1,05)   | (1,04)   | (0,89)   | (1,02)   | (1,01)   | (1,01)   |
| Schlussnettoinventarwert  | 10,47    | 10,52    | 9,07     | 10,72    | 10,15    | 11,01    |
| Gesamtertrag  | (9,11 %) | (9,00 %) | (8,94 %) | (8,69 %) | (9,05 %) | (8,40 %) |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |          |          |          |          |          |        |
|--------------------------------|----------|----------|----------|----------|----------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 1,87 %   | 1,72 %   | 1,73 %   | 1,46 %   | 1,81 %   | 1,14 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,71 %) | (0,48 %) | (0,35 %) | (0,34 %) | (0,59 %) | 0,15 % |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>JPY I<br>¥ | Thesaurierende<br>Klasse<br>SGD A*<br>SGD | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD C1<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I2<br>US\$ |
|---|--|---|---|--|---|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |   |   |  |   |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 887,86                                 | 19,35                                     | 9,98                                      | 9,46                                       | 10,91                                     | 10,97                                      |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |   |   |  |   |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 7,57                                   | 0,32                                      | 0,01                                      | (0,14)                                     | 0,09                                      | 0,15                                       |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 1,06                                   | 0,77                                      | 0,58                                      | 0,60                                       | 0,64                                      | 0,60                                       |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 8,63                                   | 1,09                                      | 0,59                                      | 0,46                                       | 0,73                                      | 0,75                                       |
| Schlussnettoinventarwert  | 896,49                                 | 20,44                                     | 10,57                                     | 9,92                                       | 11,64                                     | 11,72                                      |
| Gesamtertrag  | 0,97 %                                 | 5,63 %                                    | 5,91 %                                    | 4,86 %                                     | 6,69 %                                    | 6,84 %                                     |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |        |        |          |        |        |
|--------------------------------|--------|--------|--------|----------|--------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 1,77 % | 2,46 % | 2,46 % | 3,48 %   | 1,70 % | 1,56 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,88 % | 1,65 % | 0,08 % | (1,51 %) | 0,84 % | 1,40 % |

**31. Dezember 2023**

|   |           |            |          |           |          |          |
|---|-----------|------------|----------|-----------|----------|----------|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 1.029,89  | 19,98      | 11,03    | 10,57     | 11,97    | 12,01    |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |           |            |          |           |          |          |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (5,93)    | 1,25       | (0,14)   | (0,23)    | (0,07)   | (0,05)   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | (136,10)  | (1,88)     | (0,91)   | (0,88)    | (0,99)   | (0,99)   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | (142,03)  | (0,63)     | (1,05)   | (1,11)    | (1,06)   | (1,04)   |
| Schlussnettoinventarwert  | 887,86    | 19,35      | 9,98     | 9,46      | 10,91    | 10,97    |
| Gesamtertrag  | (13,79 %) | (3,25 %)** | (9,52 %) | (10,50 %) | (8,86 %) | (8,66 %) |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |          |         |          |          |          |          |
|--------------------------------|----------|---------|----------|----------|----------|----------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 1,94 %   | 44,14 % | 2,67 %   | 3,67 %   | 1,93 %   | 1,77 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,63 %) | 8,84 %  | (1,40 %) | (2,39 %) | (0,62 %) | (0,47 %) |

\*Wiederaufnahme der Geschäfte am 13. April 2023.

\*\* Die Gesamterträge für den Zeitraum von 1. Januar 2023 bis 5. April 2023 betrug (6,97 %).

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I5<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD P<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z<br>US\$ |
|---|--|---|---|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |   |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 11,18                                      | 9,77                                      | 10,62                                     | 11,31                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |   |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,10                                       | (0,06)                                    | (0,10)                                    | 0,63                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,69                                       | 0,55                                      | 0,82                                      | 0,22                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,79                                       | 0,49                                      | 0,72                                      | 0,85                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 11,97                                      | 10,26                                     | 11,34                                     | 12,16                                     |
| Gesamtertrag  | 7,07 %                                     | 5,02 %                                    | 6,78 %                                    | 7,52 %                                    |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |          |          |        |
|--------------------------------|--------|----------|----------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 1,32 % | 3,27 %   | 1,69 %   | 1,16 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,90 % | (0,66 %) | (0,96 %) | 5,60 % |

**31. Dezember 2023**

|   |          |           |          |          |
|---|----------|-----------|----------|----------|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 12,22    | 10,89     | 11,66    | 12,32    |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |          |           |          |          |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,03)   | (0,23)    | (0,08)   | 0,01     |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | (1,01)   | (0,89)    | (0,96)   | (1,02)   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | (1,04)   | (1,12)    | (1,04)   | (1,01)   |
| Schlussnettoinventarwert  | 11,18    | 9,77      | 10,62    | 11,31    |
| Gesamtertrag  | (8,51 %) | (10,28 %) | (8,92 %) | (8,20 %) |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |          |          |          |        |
|--------------------------------|----------|----------|----------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 1,52 %   | 3,47 %   | 1,82 %   | 1,15 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,23 %) | (2,22 %) | (0,69 %) | 0,09 % |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## US Equity

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I (nicht<br>währungs-<br>gesichert)*<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I5*<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I5 (nicht<br>währungs-<br>gesichert)*<br>€ | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I5 (nicht<br>währungs-<br>gesichert)*<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR X (nicht<br>währungsgesichert)*<br>€ | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP I5 (nicht<br>währungsgesichert)*<br>£ |
|--|---|--|--|---|--|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>   |   |  |  |   |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert  | 10,00   | 10,00                                    | 10,00  | 10,00   | 10,00  | 10,00  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:  |   |  |  |   |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>  | (0,02)  | 0,00                                     | 0,00   | 0,00  | 0,04   | 0,00   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus<br>Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 1,22  | 0,73                                     | 1,21   | 1,21  | 2,14   | 0,96   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit  | 1,20  | 0,73                                     | 1,21   | 1,21  | 2,18   | 0,96   |
| Schlussnettoinventarwert   | 11,20   | 10,73                                    | 11,21  | 11,21   | 12,18  | 10,96  |
| Gesamtertrag   | 12,00 %   | 7,30 %                                   | 12,10 %  | 12,10 %   | 21,80 %  | 9,60 %   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>   |   |  |  |   |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>   | 1,00 %  | 0,66 %                                   | 0,61 %   | 0,61 %  | 0,28 %   | 0,60 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)   | (0,39 %)  | (0,05 %)                                 | 0,01 %   | 0,01 %  | 0,40 %   | 0,01 %   |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Equity (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP X (nicht<br>währungs-<br>gesichert)*<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>JPY I3<br>¥ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I5*<br>US\$ |
|---|---|---|---|---|--|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |   |   |   |  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,00   | 1.058,06                                | 18,69                                     | 27,83                                     | 27,62                                    | 10,00                                       |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |   |   |   |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,05  | (1,46)                                  | (0,24)                                    | (0,11)                                    | (0,10)                                   | 0,00  |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 1,75  | 177,46                                  | 4,49                                      | 6,71                                      | 6,64                                     | 1,49  |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,80  | 176,00                                  | 4,25                                      | 6,60                                      | 6,54                                     | 1,49  |
| Schlussnettoinventarwert  | 11,80   | 1.234,06                                | 22,94                                     | 34,43                                     | 34,16                                    | 11,49                                       |
| Gesamtertrag  | 18,00 %   | 16,63 %                                 | 22,74 %                                   | 23,72 %                                   | 23,68 %                                  | 14,90 %                                     |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |   |   |   |  |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,28 %  | 0,77 %                                  | 1,72 %                                    | 0,97 %                                    | 0,97 %                                   | 0,60 %                                      |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 0,53 %  | (0,13 %)                                | (1,09 %)                                  | (0,34 %)                                  | (0,33 %)                                 | 0,03 %                                      |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |   |   |   |   |  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | –   | 816,04                                  | 13,76                                     | 20,34                                     | 20,18                                    | –   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |   |   |   |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | –   | 0,97                                    | (0,14)                                    | (0,03)                                    | (0,03)                                   | –   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | –   | 241,05                                  | 5,07                                      | 7,52                                      | 7,47                                     | –   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | –   | 242,02                                  | 4,93                                      | 7,49                                      | 7,44                                     | –   |
| Schlussnettoinventarwert  | –   | 1.058,06                                | 18,69                                     | 27,83                                     | 27,62                                    | –   |
| Gesamtertrag  | –   | 29,66 %                                 | 35,83 %                                   | 36,82 %                                   | 36,87 %                                  | –   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |   |   |   |  |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | –   | 0,74 %                                  | 1,72 %                                    | 0,97 %                                    | 0,97 %                                   | –   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | –   | 0,10 %                                  | (0,87 %)                                  | (0,12 %)                                  | (0,12 %)                                 | –   |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## US Equity (Fortsetzung)

|   | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I5*<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD X*<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z*<br>US\$ |
|---|--|---|--|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |   |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,00                                      | 10,43                                     | 10,00                                      | 10,00                                      |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |   |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,00                                       | (0,22)                                    | 0,03                                       | 0,01                                       |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,83                                       | 2,49                                      | 1,58                                       | 0,39                                       |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,83                                       | 2,27                                      | 1,61                                       | 0,40                                       |
| Schlussnettoinventarwert  | 10,83                                      | 12,70                                     | 11,61                                      | 10,40                                      |
| Gesamtertrag  | 8,30 %                                     | 21,76 %                                   | 16,10 %                                    | 4,00 %                                     |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |          |        |        |
|--------------------------------|--------|----------|--------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,59 % | 2,52 %   | 0,26 % | 0,21 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,00 % | (1,88 %) | 0,35 % | 0,34 % |

**31. Dezember 2023**

|   |   |         |   |   |
|---|---|---------|---|---|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | – | 7,74    | – | – |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |         |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | – | (0,15)  | – | – |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | – | 2,84    | – | – |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | – | 2,69    | – | – |
| Schlussnettoinventarwert  | – | 10,43   | – | – |
| Gesamtertrag  | – | 34,75 % | – | – |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |   |          |   |   |
|--------------------------------|---|----------|---|---|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | – | 2,54 %   | – | – |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | – | (1,63 %) | – | – |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Equity Premium

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I<br>€ | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I3<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I4<br>€ | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I4<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I (nicht<br>währungsgesichert)<br>£ |
|---|--|--|---|--|--|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |  |   |  |  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 13,19                                  | 9,95                                   | 13,18                                   | 10,07                                  | 11,98                                  | 14,79   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |   |  |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,52                                   | 0,40                                   | 0,55                                    | 0,42                                   | 0,27                                   | 0,55  |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,97                                   | 0,73                                   | 0,98                                    | 0,73                                   | 0,89                                   | 1,70  |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,49                                   | 1,13                                   | 1,53                                    | 1,15                                   | 1,16                                   | 2,25  |
| Ausschüttungen  | –                                      | (0,30)                                 | –                                       | (0,29)                                 | –                                      | –   |
| Schlussnettoinventarwert  | 14,68                                  | 10,78                                  | 14,71                                   | 10,93                                  | 13,14                                  | 17,04   |
| Gesamtertrag  | 11,30 %                                | 11,56 %                                | 11,61 %                                 | 11,58 %                                | 9,68 %                                 | 15,21 %   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |   |  |  |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,73 %                                 | 0,54 %                                 | 0,48 %                                  | 0,47 %                                 | 2,19 %                                 | 0,71 %  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 3,72 %                                 | 3,84 %                                 | 3,96 %                                  | 3,98 %                                 | 2,16 %                                 | 3,52 %  |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |  |  |   |  |  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 11,69                                  | 8,83                                   | 11,65                                   | 10,00                                  | 10,76                                  | 13,58   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |   |  |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,10                                   | 0,05                                   | 0,07                                    | 0,01                                   | (0,11)                                 | 0,04  |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 1,40                                   | 1,10                                   | 1,46                                    | 0,06                                   | 1,33                                   | 1,17  |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,50                                   | 1,15                                   | 1,53                                    | 0,07                                   | 1,22                                   | 1,21  |
| Ausschüttungen  | –                                      | (0,03)                                 | –                                       | –                                      | –                                      | –   |
| Schlussnettoinventarwert  | 13,19                                  | 9,95                                   | 13,18                                   | 10,07                                  | 11,98                                  | 14,79   |
| Gesamtertrag  | 12,83 %                                | 13,03 %                                | 13,13 %                                 | 0,70 %                                 | 11,34 %                                | 8,91 %  |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |   |  |  |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,72 %                                 | 0,52 %                                 | 0,46 %                                  | 0,46 %                                 | 2,07 %                                 | 0,69 %  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 0,76 %                                 | 0,56 %                                 | 0,58 %                                  | 1,92 %                                 | (0,98 %)                               | 0,27 %  |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## US Equity Premium (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I3<br>£ | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP I3<br>£ | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP I3 (nicht<br>währungs-<br>gesichert)<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I4 (nicht<br>währungs-<br>gesichert)<br>£ | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP I4<br>£ | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP P (nicht<br>währungs-<br>gesichert)<br>£ |
|---|---|--|--|---|--|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |  |  |   |  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 12,63                                   | 10,76                                  | 10,48  | 15,33   | 10,24                                  | 10,53   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |  |   |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,51                                    | 0,42                                   | 0,42   | 0,60  | 0,39                                   | 0,40  |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 1,44                                    | 0,97                                   | 1,17   | 1,78  | 0,93                                   | 1,15  |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,95                                    | 1,39                                   | 1,59   | 2,38  | 1,32                                   | 1,55  |
| Ausschüttungen  | –                                       | (0,33)                                 | (0,32)   | –   | (0,30)                                 | (0,43)  |
| Schlussnettoinventarwert  | 14,58                                   | 11,82                                  | 11,75  | 17,71   | 11,26                                  | 11,65   |
| Gesamtertrag  | 15,44 %                                 | 13,08 %                                | 15,47 %  | 15,53 %   | 13,07 %                                | 15,18 %   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |  |  |   |  |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,53 %                                  | 0,53 %                                 | 0,50 %   | 0,47 %  | 0,47 %                                 | 0,68 %  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 3,80 %                                  | 3,70 %                                 | 3,85 %   | 3,75 %  | 3,65 %                                 | 3,64 %  |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |   |  |  |   |  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 11,58                                   | 9,40                                   | 10,00  | 14,05   | 10,00                                  | 10,06   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |  |   |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,07                                    | 0,06                                   | 0,05   | 0,09  | 0,01                                   | 0,04  |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,98                                    | 1,33                                   | 0,45   | 1,19  | 0,23                                   | 0,84  |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,05                                    | 1,39                                   | 0,50   | 1,28  | 0,24                                   | 0,88  |
| Ausschüttungen  | –                                       | (0,03)                                 | (0,02)   | –   | –                                      | (0,41)  |
| Schlussnettoinventarwert  | 12,63                                   | 10,76                                  | 10,48  | 15,33   | 10,24                                  | 10,53   |
| Gesamtertrag  | 9,07 %                                  | 14,82 %                                | 5,00 %   | 9,11 %  | 2,40 %                                 | 8,96 %  |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |  |  |   |  |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,52 %                                  | 0,52 %                                 | 0,51 %   | 0,46 %  | 0,49 %                                 | 0,66 %  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 0,61 %                                  | 0,58 %                                 | 0,94 %   | 0,59 %  | 1,61 %                                 | 0,38 %  |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Equity Premium (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP X (nicht<br>währungs-<br>gesichert)*<br>£ | Ausschüttende<br>Klasse<br>SGD A<br>(Monatlich)<br>SGD | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I<br>(Monatlich)<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I3<br>US\$ |
|---|---|--|---|---|---|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |  |   |   |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,00   | 20,38  | 14,98                                     | 11,64   | 15,82                                     | 10,47                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |   |   |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,37  | 0,68   | 0,48                                      | 0,45  | 0,62                                      | 0,40                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,85  | 1,38   | 1,40                                      | 1,03  | 1,46                                      | 0,98                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,22  | 2,06   | 1,88                                      | 1,48  | 2,08                                      | 1,38                                      |
| Ausschüttungen  | –   | (1,45)   | –   | (0,84)  | –   | (0,32)                                    |
| Schlussnettoinventarwert  | 11,22   | 20,99  | 16,86                                     | 12,28   | 17,90                                     | 11,53                                     |
| Gesamtertrag  | 12,20 %   | 10,51 %  | 12,55 %                                   | 13,19 %   | 13,15 %                                   | 13,40 %                                   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |  |   |   |   |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,45 %  | 1,33 %   | 1,30 %                                    | 0,68 %  | 0,70 %                                    | 0,52 %                                    |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 4,14 %  | 3,27 %   | 3,00 %                                    | 3,71 %  | 3,62 %                                    | 3,68 %                                    |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |   |  |   |   |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | –   | 18,85  | 13,06                                     | 10,55   | 13,71                                     | 9,09                                      |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |   |   |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | –   | (0,04)   | (0,03)                                    | 0,02  | 0,06                                      | 0,06                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | –   | 2,46   | 1,95                                      | 1,57  | 2,05                                      | 1,35                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | –   | 2,42   | 1,92                                      | 1,59  | 2,11                                      | 1,41                                      |
| Ausschüttungen  | –   | (0,89)   | –   | (0,50)  | –   | (0,03)                                    |
| Schlussnettoinventarwert  | –   | 20,38  | 14,98                                     | 11,64   | 15,82                                     | 10,47                                     |
| Gesamtertrag  | –   | 13,13 %  | 14,70 %                                   | 15,43 %   | 15,39 %                                   | 15,53 %                                   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |  |   |   |   |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | –   | 1,29 %   | 1,31 %                                    | 0,70 %  | 0,71 %                                    | 0,53 %                                    |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | –   | (0,23 %)   | (0,19 %)                                  | 0,16 %  | 0,41 %                                    | 0,60 %                                    |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## US Equity Premium (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I4<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z<br>US\$ |
|---|--|---|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 15,37                                      | 14,02                                     | 16,10                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,63                                       | 0,34                                      | 0,72                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 1,44                                       | 1,28                                      | 1,51                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 2,07                                       | 1,62                                      | 2,23                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 17,44                                      | 15,64                                     | 18,33                                     |
| Gesamtertrag  | 13,47 %                                    | 11,55 %                                   | 13,85 %                                   |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |        |        |
|--------------------------------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,46 % | 2,10 % | 0,10 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 3,80 % | 2,22 % | 4,14 % |

**31. Dezember 2023**

|   |         |         |         |
|---|---------|---------|---------|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 13,29   | 12,32   | 13,87   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |         |         |         |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,09    | (0,14)  | 0,16    |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 1,99    | 1,84    | 2,07    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 2,08    | 1,70    | 2,23    |
| Schlussnettoinventarwert  | 15,37   | 14,02   | 16,10   |
| Gesamtertrag  | 15,65 % | 13,80 % | 16,08 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |          |        |
|--------------------------------|--------|----------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,47 % | 2,12 %   | 0,11 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,65 % | (1,03 %) | 1,04 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Large Cap Value

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A (nicht<br>währungsgesichert)<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I (nicht<br>währungsgesichert)<br>€ | Ausschüttende<br>Klasse<br>EUR I4 (nicht<br>währungsgesichert)<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I5 (nicht<br>währungsgesichert)<br>€ |
|--|--|---|--|---|---|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>   |  |   |  |   |   |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert  | 10,25                                  | 9,96  | 8,75                                   | 8,86  | 9,26  | 9,84   |
| Erträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit:   |  |   |  |   |   |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>  | 0,05                                   | 0,06  | 0,12                                   | 0,13  | 0,17  | 0,18   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus<br>Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,74                                   | 1,62  | 0,62                                   | 1,45  | 1,47  | 1,60   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit  | 0,79                                   | 1,68  | 0,74                                   | 1,58  | 1,64  | 1,78   |
| Ausschüttungen   | –                                      | –   | –                                      | –   | (0,15)  | –  |
| Schlussnettoinventarwert   | 11,04                                  | 11,64   | 9,49                                   | 10,44   | 10,75   | 11,62  |
| Gesamtertrag   | 7,71 %                                 | 16,87 %   | 8,46 %                                 | 17,83 %   | 18,01 %   | 18,09 %  |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |        |        |        |        |        |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 1,65 % | 1,65 % | 0,81 % | 0,81 % | 0,53 % | 0,45 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,47 % | 0,51 % | 1,28 % | 1,29 % | 1,76 % | 1,66 % |

**31. Dezember 2023**

|  |          |          |          |          |          |          |
|--|----------|----------|----------|----------|----------|----------|
| Eröffnungsnettoinventarwert  | 10,87    | 10,68    | 9,20     | 9,42     | 9,91     | 10,42    |
| Erträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit:   |          |          |          |          |          |          |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>  | 0,06     | 0,06     | 0,12     | 0,13     | 0,15     | 0,17     |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus<br>Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | (0,68)   | (0,78)   | (0,57)   | (0,69)   | (0,70)   | (0,75)   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit  | (0,62)   | (0,72)   | (0,45)   | (0,56)   | (0,55)   | (0,58)   |
| Ausschüttungen   | –        | –        | –        | –        | (0,10)   | –        |
| Schlussnettoinventarwert   | 10,25    | 9,96     | 8,75     | 8,86     | 9,26     | 9,84     |
| Gesamtertrag   | (5,70 %) | (6,74 %) | (4,89 %) | (5,94 %) | (5,62 %) | (5,57 %) |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |        |        |        |        |        |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 1,56 % | 1,55 % | 0,78 % | 0,78 % | 0,50 % | 0,43 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,62 % | 0,60 % | 1,40 % | 1,42 % | 1,64 % | 1,71 % |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## US Large Cap Value (Fortsetzung)

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I (nicht<br>währungsgesichert)<br>£ | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP I<br>£ | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP I (nicht<br>währungsgesichert)<br>£ | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP I4 (nicht<br>währungsgesichert)<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP P (nicht<br>währungsgesichert)<br>£ |
|--|--|---|---------------------------------------|--|---|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>   |  |   |                                       |  |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert  | 9,43                                   | 8,88  | 9,42                                  | 8,86   | 9,96  | 9,44  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:  |  |   |                                       |  |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>  | 0,13                                   | 0,12  | 0,13                                  | 0,12   | 0,16  | 0,13  |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,80                                   | 0,97  | 0,80                                  | 0,96   | 1,09  | 1,04  |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit   | 0,93                                   | 1,09  | 0,93                                  | 1,08   | 1,25  | 1,17  |
| Ausschüttungen   | –                                      | –   | (0,13)                                | (0,12)   | (0,17)  | –   |
| Schlussnettoinventarwert   | 10,36                                  | 9,97  | 10,22                                 | 9,82   | 11,04   | 10,61   |
| Gesamtertrag   | 9,86 %                                 | 12,27 %   | 9,96 %                                | 12,37 %  | 12,69 %   | 12,39 %   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>   |  |   |                                       |  |   |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>   | 0,78 %                                 | 0,80 %  | 0,80 %                                | 0,80 %   | 0,51 %  | 0,76 %  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)   | 1,28 %                                 | 1,29 %  | 1,26 %                                | 1,27 %   | 1,60 %  | 1,31 %  |
| <b>31. Dezember 2023</b>   |  |   |                                       |  |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert  | 9,76                                   | 9,66  | 9,76                                  | 9,66   | 10,92   | 10,28   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:  |  |   |                                       |  |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>  | 0,13                                   | 0,13  | 0,13                                  | 0,13   | 0,17  | 0,13  |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | (0,46)                                 | (0,91)  | (0,46)                                | (0,92)   | (1,02)  | (0,97)  |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit   | (0,33)                                 | (0,78)  | (0,33)                                | (0,79)   | (0,85)  | (0,84)  |
| Ausschüttungen   | –                                      | –   | (0,01)                                | (0,01)   | (0,11)  | –   |
| Schlussnettoinventarwert   | 9,43                                   | 8,88  | 9,42                                  | 8,86   | 9,96  | 9,44  |
| Gesamtertrag   | (3,38 %)                               | (8,07 %)  | (3,39 %)                              | (8,20 %)   | (7,87 %)  | (8,17 %)  |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>   |  |   |                                       |  |   |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>   | 0,76 %                                 | 0,79 %  | 0,79 %                                | 0,78 %   | 0,50 %  | 0,75 %  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)   | 1,37 %                                 | 1,43 %  | 1,41 %                                | 1,41 %   | 1,64 %  | 1,40 %  |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Large Cap Value (Fortsetzung)

|   | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP P<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP Y (nicht<br>währungs-<br>gesichert)<br>£ | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP Y (nicht<br>währungs-<br>gesichert)<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I4<br>US\$ |
|---|---------------------------------------|--|---|---|---|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |                                       |  |   |   |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,25                                 | 9,63   | 9,43  | 9,18                                      | 10,01                                     | 9,31                                      |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |                                       |  |   |   |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,14                                  | 0,14   | 0,14  | 0,04                                      | 0,13                                      | 0,15                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,86                                  | 1,06   | 1,02  | 0,83                                      | 0,91                                      | 0,82                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,00                                  | 1,20   | 1,16  | 0,87                                      | 1,04                                      | 0,97                                      |
| Ausschüttungen  | (0,14)                                | –  | (0,14)  | –   | –   | (0,15)                                    |
| Schlussnettoinventarwert  | 11,11                                 | 10,83  | 10,45   | 10,05                                     | 11,05                                     | 10,13                                     |
| Gesamtertrag  | 9,91 %                                | 12,46 %  | 12,43 %   | 9,48 %                                    | 10,39 %                                   | 10,63 %                                   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |                                       |  |   |   |   |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,76 %                                | 0,72 %   | 0,72 %  | 1,58 %                                    | 0,78 %                                    | 0,50 %                                    |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 1,31 %                                | 1,35 %   | 1,34 %  | 0,45 %                                    | 1,24 %                                    | 1,58 %                                    |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |                                       |  |   |   |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,63                                 | 10,48  | 10,29   | 9,50                                      | 10,28                                     | 9,63                                      |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |                                       |  |   |   |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,14                                  | 0,14   | 0,14  | 0,06                                      | 0,14                                      | 0,16                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | (0,50)                                | (0,99)   | (0,96)  | (0,38)                                    | (0,41)                                    | (0,38)                                    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | (0,36)                                | (0,85)   | (0,82)  | (0,32)                                    | (0,27)                                    | (0,22)                                    |
| Ausschüttungen  | (0,02)                                | –  | (0,04)  | –   | –   | (0,10)                                    |
| Schlussnettoinventarwert  | 10,25                                 | 9,63   | 9,43  | 9,18                                      | 10,01                                     | 9,31                                      |
| Gesamtertrag  | (3,37 %)                              | (8,11 %)   | (8,02 %)  | (3,37 %)                                  | (2,63 %)                                  | (2,34 %)                                  |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |                                       |  |   |   |   |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,73 %                                | 0,71 %   | 0,71 %  | 1,59 %                                    | 0,79 %                                    | 0,51 %                                    |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 1,41 %                                | 1,44 %   | 1,51 %  | 0,60 %                                    | 1,40 %                                    | 1,67 %                                    |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## US Large Cap Value (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I5<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Y<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z<br>US\$ |
|---|--|---|---|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |   |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 9,43                                       | 8,95                                      | 9,89                                      | 9,90                                      |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |   |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,17                                       | (0,03)                                    | 0,14                                      | 0,21                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,85                                       | 0,81                                      | 0,90                                      | 0,90                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,02                                       | 0,78                                      | 1,04                                      | 1,11                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 10,45                                      | 9,73                                      | 10,93                                     | 11,01                                     |
| Gesamtertrag  | 10,82 %                                    | 8,72 %                                    | 10,52 %                                   | 11,21 %                                   |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |          |        |        |
|--------------------------------|--------|----------|--------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,42 % | 2,38 %   | 0,71 % | 0,08 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 1,64 % | (0,35 %) | 1,32 % | 1,94 % |

**31. Dezember 2023**

|   |          |          |          |          |
|---|----------|----------|----------|----------|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 9,65     | 9,35     | 10,00    | 10,10    |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |          |          |          |          |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,16     | (0,02)   | 0,06     | 0,21     |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | (0,38)   | (0,38)   | (0,17)   | (0,41)   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | (0,22)   | (0,40)   | (0,11)   | (0,20)   |
| Schlussnettoinventarwert  | 9,43     | 8,95     | 9,89     | 9,90     |
| Gesamtertrag  | (2,28 %) | (4,28 %) | (1,10 %) | (1,98 %) |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |          |        |        |
|--------------------------------|--------|----------|--------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,44 % | 2,39 %   | 0,75 % | 0,08 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 1,74 % | (0,21 %) | 1,54 % | 2,11 % |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Long Short Equity

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I3<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I3 (nicht<br>währungsgesichert)*<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M<br>€ | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP I3<br>£ |
|---|--|--|---|---|--|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |  |   |   |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 11,44                                  | 12,46                                  | 11,75                                   | 10,00   | 11,14                                  | 11,34                                  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |   |   |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,14)                                 | (0,03)                                 | 0,02                                    | 0,01  | (0,23)                                 | 0,03                                   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,57                                   | 0,62                                   | 0,59                                    | 0,77  | 0,56                                   | 0,70                                   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,43                                   | 0,59                                   | 0,61                                    | 0,78  | 0,33                                   | 0,73                                   |
| Ausschüttungen  | –                                      | –                                      | –                                       | –   | –                                      | (0,16)                                 |
| Schlussnettoinventarwert  | 11,87                                  | 13,05                                  | 12,36                                   | 10,78   | 11,47                                  | 11,91                                  |
| Gesamtertrag  | 3,76 %                                 | 4,74 %                                 | 5,19 %                                  | 7,80 %  | 2,96 %                                 | 6,57 %                                 |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |   |   |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 2,55 %                                 | 1,62 %                                 | 1,19 %                                  | 1,14 %  | 3,39 %                                 | 1,16 %                                 |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | (1,17 %)                               | (0,24 %)                               | 0,20 %                                  | 0,20 %  | (2,01 %)                               | 0,23 %                                 |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |  |  |   |   |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,40                                  | 11,22                                  | 10,54                                   | –   | 10,21                                  | 10,08                                  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |   |   |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,08)                                 | 0,02                                   | 0,06                                    | –   | (0,16)                                 | 0,06                                   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 1,12                                   | 1,22                                   | 1,15                                    | –   | 1,09                                   | 1,27                                   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,04                                   | 1,24                                   | 1,21                                    | –   | 0,93                                   | 1,33                                   |
| Ausschüttungen  | –                                      | –                                      | –                                       | –   | –                                      | (0,07)                                 |
| Schlussnettoinventarwert  | 11,44                                  | 12,46                                  | 11,75                                   | –   | 11,14                                  | 11,34                                  |
| Gesamtertrag  | 10,00 %                                | 11,05 %                                | 11,48 %                                 | –   | 9,11 %                                 | 13,23 %                                |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |   |   |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 2,40 %                                 | 1,50 %                                 | 1,13 %                                  | –   | 3,19 %                                 | 1,15 %                                 |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | (0,71 %)                               | 0,19 %                                 | 0,56 %                                  | –   | (1,50 %)                               | 0,54 %                                 |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## US Long Short Equity (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>SGD A1<br>SGD | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A (PF)<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A1<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I (PF)<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ |
|---|---|--|---|--|---|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |  |   |  |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 26,86                                     | 13,16  | 13,33                                     | 14,24                                      | 13,83   | 15,29                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |   |  |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,19)                                    | (0,20)   | (0,15)                                    | (0,10)                                     | (0,14)  | (0,03)                                    |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 1,30                                      | 0,88   | 0,89                                      | 0,96                                       | 0,93  | 1,02                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,11                                      | 0,68   | 0,74                                      | 0,86                                       | 0,79  | 0,99                                      |
| Ausschüttungen  | –   | –  | –   | –  | (0,04)  | –   |
| Schlussnettoinventarwert  | 27,97                                     | 13,84  | 14,07                                     | 15,10                                      | 14,58   | 16,28                                     |
| Gesamtertrag  | 4,13 %                                    | 5,17 %   | 5,55 %                                    | 6,04 %                                     | 5,70 %  | 6,47 %                                    |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |  |   |  |   |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 2,04 %                                    | 2,79 %   | 2,45 %                                    | 2,00 %                                     | 2,30 %  | 1,55 %                                    |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | (0,70 %)                                  | (1,48 %)                                       | (1,12 %)                                  | (0,68 %)                                   | (0,98 %)                                      | (0,16 %)                                  |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |   |  |   |  |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 24,13                                     | 11,72  | 11,86                                     | 12,63                                      | 12,33   | 13,49                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |  |   |  |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,08)                                    | (0,08)   | (0,09)                                    | (0,04)                                     | (0,04)  | 0,03                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 2,81                                      | 1,52   | 1,56                                      | 1,65                                       | 1,62  | 1,77                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 2,73                                      | 1,44   | 1,47                                      | 1,61                                       | 1,58  | 1,80                                      |
| Ausschüttungen  | –   | –  | –   | –  | (0,08)  | –   |
| Schlussnettoinventarwert  | 26,86                                     | 13,16  | 13,33                                     | 14,24                                      | 13,83   | 15,29                                     |
| Gesamtertrag  | 11,31 %                                   | 12,29 %  | 12,39 %                                   | 12,75 %                                    | 12,83 %                                       | 13,34 %                                   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |   |  |   |  |   |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 2,03 %                                    | 2,38 %   | 2,46 %                                    | 2,06 %                                     | 2,02 %  | 1,56 %                                    |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | (0,32 %)                                  | (0,65 %)                                       | (0,73 %)                                  | (0,33 %)                                   | (0,29 %)                                      | 0,18 %                                    |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Long Short Equity (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I3<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD U<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z<br>US\$ |
|---|--|---|---|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |   |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 12,51                                      | 12,24                                     | 13,99                                     | 17,13                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |   |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,03                                       | (0,24)                                    | (0,10)                                    | 0,20                                      |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,84                                       | 0,81                                      | 0,94                                      | 1,16                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,87                                       | 0,57                                      | 0,84                                      | 1,36                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 13,38                                      | 12,81                                     | 14,83                                     | 18,49                                     |
| Gesamtertrag  | 6,95 %                                     | 4,66 %                                    | 6,00 %                                    | 7,94 %                                    |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |          |          |        |
|--------------------------------|--------|----------|----------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 1,14 % | 3,25 %   | 2,00 %   | 0,19 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,20 % | (1,92 %) | (0,70 %) | 1,13 % |

**31. Dezember 2023**

|   |         |         |         |         |
|---|---------|---------|---------|---------|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,99   | 10,98   | 12,39   | 14,90   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |         |         |         |         |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,07    | (0,18)  | (0,03)  | 0,24    |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 1,45    | 1,44    | 1,63    | 1,99    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,52    | 1,26    | 1,60    | 2,23    |
| Schlussnettoinventarwert  | 12,51   | 12,24   | 13,99   | 17,13   |
| Gesamtertrag  | 13,83 % | 11,48 % | 12,91 % | 14,97 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |          |          |        |
|--------------------------------|--------|----------|----------|--------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 1,15 % | 3,26 %   | 2,00 %   | 0,21 % |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,59 % | (1,54 %) | (0,23 %) | 1,52 % |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## US Multi Cap Opportunities

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>AUD E<br>AUD | Thesaurierende<br>Klasse<br>AUD T<br>AUD | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I (nicht<br>währungs-<br>gesichert)*<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I3<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR1 A<br>€ |
|---|--|--|---|---|--|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |  |   |   |  |   |
| Eröffnungsinventarwert  | 18,33                                    | 17,38                                    | 10,00   | 26,06                                   | 18,00                                  | 28,67                                   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |   |   |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,48)                                   | (0,25)                                   | 0,00  | 0,02                                    | (0,44)                                 | (0,37)                                  |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 3,53                                     | 3,35                                     | (0,30)  | 4,94                                    | 3,40                                   | 5,42                                    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 3,05                                     | 3,10                                     | (0,30)  | 4,96                                    | 2,96                                   | 5,05                                    |
| Schlussinventarwert   | 21,38                                    | 20,48                                    | 9,70  | 31,02                                   | 20,96                                  | 33,72                                   |
| Gesamtertrag  | 16,64 %                                  | 17,84 %                                  | (3,00 %)  | 19,03 %                                 | 16,44 %                                | 17,61 %                                 |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |   |   |  |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 3,19 %                                   | 2,12 %                                   | 1,09 %  | 0,72 %                                  | 3,02 %                                 | 1,98 %                                  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | (2,37 %)                                 | (1,31 %)                                 | (0,85 %)  | 0,08 %                                  | (2,21 %)                               | (1,18 %)                                |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |  |  |   |   |  |   |
| Eröffnungsinventarwert  | 16,18                                    | 15,19                                    | –   | 22,53                                   | 15,91                                  | 25,08                                   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |   |   |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,35)                                   | (0,17)                                   | –   | 0,04                                    | (0,33)                                 | (0,26)                                  |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 2,50                                     | 2,36                                     | –   | 3,49                                    | 2,42                                   | 3,85                                    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 2,15                                     | 2,19                                     | –   | 3,53                                    | 2,09                                   | 3,59                                    |
| Schlussinventarwert   | 18,33                                    | 17,38                                    | –   | 26,06                                   | 18,00                                  | 28,67                                   |
| Gesamtertrag  | 13,29 %                                  | 14,42 %                                  | –   | 15,67 %                                 | 13,14 %                                | 14,31 %                                 |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |   |   |  |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 2,92 %                                   | 1,94 %                                   | –   | 0,68 %                                  | 2,84 %                                 | 1,86 %                                  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | (2,06 %)                                 | (1,08 %)                                 | –   | 0,18 %                                  | (1,98 %)                               | (0,99 %)                                |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR 1 I<br>€ | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP I3*<br>£ | Ausschüttende<br>Klasse<br>GBP I3 (nicht<br>währungs-<br>gesichert)<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP P (nicht<br>währungsgesichert)*<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>SGD A<br>SGD | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD B<br>US\$ |
|---|--|---|--|--|--|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |   |  |  |  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 31,53                                    | 10,00                                   | 18,26  | 10,00  | 48,71                                    | 20,61                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |   |  |  |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,10)                                   | 0,00                                    | 0,02   | (0,01)   | (0,63)                                   | (0,51)                                    |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 5,97                                     | 0,84                                    | 4,22   | 0,69   | 9,16                                     | 4,30                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 5,87                                     | 0,84                                    | 4,24   | 0,68   | 8,53                                     | 3,79                                      |
| Ausschüttungen  | –  | –                                       | (0,03)   | –  | –  | –   |
| Schlussnettoinventarwert  | 37,40                                    | 10,84                                   | 22,47  | 10,68  | 57,24                                    | 24,40                                     |
| Gesamtertrag  | 18,62 %                                  | 8,40 %                                  | 23,28 %  | 6,80 %   | 17,51 %                                  | 18,39 %                                   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |   |  |  |  |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,09 %                                   | 0,68 %                                  | 0,69 %   | 0,98 %   | 1,93 %                                   | 3,00 %                                    |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | (0,30 %)                                 | 0,05 %                                  | 0,09 %   | (0,16 %)   | (1,15 %)                                 | (2,23 %)                                  |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |  |   |  |  |  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 27,36                                    | –                                       | 16,38  | –  | 42,26                                    | 17,80                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |   |  |  |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,05)                                   | –                                       | 0,03   | –  | (0,44)                                   | (0,40)                                    |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 4,22                                     | –                                       | 1,89   | –  | 6,89                                     | 3,21                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 4,17                                     | –                                       | 1,92   | –  | 6,45                                     | 2,81                                      |
| Ausschüttungen  | –  | –                                       | (0,04)   | –  | –  | –   |
| Schlussnettoinventarwert  | 31,53                                    | –                                       | 18,26  | –  | 48,71                                    | 20,61                                     |
| Gesamtertrag  | 15,24 %                                  | –                                       | 11,77 %  | –  | 15,26 %                                  | 15,79 %                                   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |   |  |  |  |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,02 %                                   | –                                       | 0,67 %   | –  | 1,86 %                                   | 3,00 %                                    |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | (0,16 %)                                 | –                                       | 0,20 %   | –  | (0,99 %)                                 | (2,10 %)                                  |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD C1<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD E<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I2<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I3<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD T<br>US\$ |
|---|--|---|--|--|---|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |   |  |  |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 15,79                                      | 19,40                                     | 11,20                                      | 30,97                                      | 21,97                                     | 22,81                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |   |  |  |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,37)                                     | (0,47)                                    | (0,01)                                     | 0,03                                       | (0,52)                                    | (0,31)                                    |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 3,29                                       | 4,03                                      | 2,35                                       | 6,50                                       | 4,58                                      | 4,77                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 2,92                                       | 3,56                                      | 2,34                                       | 6,53                                       | 4,06                                      | 4,46                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 18,71                                      | 22,96                                     | 13,54                                      | 37,50                                      | 26,03                                     | 27,27                                     |
| Gesamtertrag  | 18,49 %                                    | 18,35 %                                   | 20,89 %                                    | 21,08 %                                    | 18,48 %                                   | 19,55 %                                   |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |          |          |          |        |          |          |
|--------------------------------|----------|----------|----------|--------|----------|----------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 2,89 %   | 3,00 %   | 0,86 %   | 0,69 % | 2,89 %   | 1,99 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (2,12 %) | (2,23 %) | (0,10 %) | 0,08 % | (2,12 %) | (1,23 %) |

**31. Dezember 2023**

|   |         |         |         |         |         |         |
|---|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 13,62   | 16,75   | 10,00   | 26,14   | 18,95   | 19,51   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |         |         |         |         |         |         |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,29)  | (0,38)  | 0,01    | 0,05    | (0,41)  | (0,23)  |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 2,46    | 3,03    | 1,19    | 4,78    | 3,43    | 3,53    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 2,17    | 2,65    | 1,20    | 4,83    | 3,02    | 3,30    |
| Schlussnettoinventarwert  | 15,79   | 19,40   | 11,20   | 30,97   | 21,97   | 22,81   |
| Gesamtertrag  | 15,93 % | 15,82 % | 12,00 % | 18,48 % | 15,94 % | 16,91 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |          |          |        |        |          |          |
|--------------------------------|----------|----------|--------|--------|----------|----------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 2,90 %   | 3,00 %   | 0,85 % | 0,70 % | 2,90 %   | 2,00 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (2,01 %) | (2,11 %) | 0,10 % | 0,17 % | (2,02 %) | (1,11 %) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD U<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD1 A<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD1 I<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD1 I<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>ZAR B<br>ZAR |
|---|---|---|--|--|---|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |   |   |  |  |   |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 31,54                                     | 26,27                                     | 34,23                                      | 38,63                                      | 37,27                                     | 306,92                                   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |   |   |  |  |   |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,24)                                    | 0,17                                      | (0,43)                                     | (0,12)                                     | (0,12)                                    | (7,85)                                   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 6,62                                      | 5,53                                      | 7,16                                       | 8,11                                       | 7,83                                      | 73,90                                    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 6,38                                      | 5,70                                      | 6,73                                       | 7,99                                       | 7,71                                      | 66,05                                    |
| Schlussnettoinventarwert  | 37,92                                     | 31,97                                     | 40,96                                      | 46,62                                      | 44,98                                     | 372,97                                   |
| Gesamtertrag  | 20,23 %                                   | 21,70 %                                   | 19,66 %                                    | 20,68 %                                    | 20,69 %                                   | 21,52 %                                  |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |          |        |          |          |          |          |
|--------------------------------|----------|--------|----------|----------|----------|----------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 1,44 %   | 0,19 % | 1,89 %   | 1,04 %   | 1,04 %   | 3,09 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,68 %) | 0,57 % | (1,12 %) | (0,29 %) | (0,28 %) | (2,29 %) |

**31. Dezember 2023**

|   |         |         |         |         |         |         |
|---|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 26,82   | 22,06   | 29,24   | 32,71   | 31,57   | 258,68  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |         |         |         |         |         |         |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,16)  | 0,16    | (0,32)  | (0,06)  | (0,05)  | (5,83)  |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 4,88    | 4,05    | 5,31    | 5,98    | 5,75    | 54,07   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 4,72    | 4,21    | 4,99    | 5,92    | 5,70    | 48,24   |
| Schlussnettoinventarwert  | 31,54   | 26,27   | 34,23   | 38,63   | 37,27   | 306,92  |
| Gesamtertrag  | 17,60 % | 19,08 % | 17,07 % | 18,10 % | 18,06 % | 18,65 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |          |        |          |          |          |          |
|--------------------------------|----------|--------|----------|----------|----------|----------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 1,45 %   | 0,20 % | 1,90 %   | 1,05 %   | 1,05 %   | 2,97 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,56 %) | 0,69 % | (1,02 %) | (0,17 %) | (0,14 %) | (2,09 %) |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>ZAR E<br>ZAR | Thesaurierende<br>Klasse<br>ZAR T<br>ZAR |
|---|--|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 282,64                                   | 339,34                                   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (7,12)                                   | (4,88)                                   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 67,96                                    | 82,07                                    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 60,84                                    | 77,19                                    |
| Schlussnettoinventarwert  | 343,48                                   | 416,53                                   |
| Gesamtertrag  | 21,53 %                                  | 22,75 %                                  |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |          |          |
|--------------------------------|----------|----------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 3,10 %   | 2,05 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (2,25 %) | (1,27 %) |

**31. Dezember 2023**

|   |         |         |
|---|---------|---------|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 238,22  | 283,17  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |         |         |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (5,39)  | (3,40)  |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 49,81   | 59,57   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 44,42   | 56,17   |
| Schlussnettoinventarwert  | 282,64  | 339,34  |
| Gesamtertrag  | 18,65 % | 19,84 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |          |          |
|--------------------------------|----------|----------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 2,96 %   | 1,98 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (2,10 %) | (1,11 %) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities

|   | Ausschüttende<br>Klasse<br>AUD A<br>(Monatlich)<br>AUD | Ausschüttende<br>Klasse<br>AUD B<br>(Monatlich)<br>AUD | Thesaurierende<br>Klasse<br>AUD B<br>AUD | Ausschüttende<br>Klasse<br>AUD E<br>(Monatlich)<br>AUD | Thesaurierende<br>Klasse<br>AUD E<br>AUD | Ausschüttende<br>Klasse<br>AUD T<br>(Monatlich)<br>AUD |
|---|--|--|--|--|--|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |  |  |  |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 8,36   | 7,64   | 11,86                                    | 7,63   | 12,83                                    | 8,96   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |  |  |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,08   | (0,03)   | (0,05)                                   | (0,03)   | (0,04)                                   | 0,06   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,06   | 0,06   | 0,10                                     | 0,06   | 0,10                                     | 0,06   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,14   | 0,03   | 0,05                                     | 0,03   | 0,06                                     | 0,12   |
| Ausschüttungen  | (0,33)   | (0,30)   | –  | (0,30)   | –  | (0,35)   |
| Schlussnettoinventarwert  | 8,17   | 7,37   | 11,91                                    | 7,36   | 12,89                                    | 8,73   |
| Gesamtertrag  | 1,75 %   | 0,44 %   | 0,42 %                                   | 0,43 %   | 0,47 %                                   | 1,44 %   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |  |  |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,85 %   | 3,24 %   | 3,24 %                                   | 3,24 %   | 3,25 %                                   | 2,17 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 0,97 %   | (0,43 %)   | (0,43 %)                                 | (0,44 %)   | (0,29 %)                                 | 0,68 %   |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |  |  |  |  |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 8,13   | 7,53   | 11,22                                    | 7,52   | 12,14                                    | 8,74   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |  |  |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,09   | (0,01)   | (0,01)                                   | (0,01)   | (0,03)                                   | 0,08   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,46   | 0,42   | 0,65                                     | 0,42   | 0,72                                     | 0,49   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,55   | 0,41   | 0,64                                     | 0,41   | 0,69                                     | 0,57   |
| Ausschüttungen  | (0,32)   | (0,30)   | –  | (0,30)   | –  | (0,35)   |
| Schlussnettoinventarwert  | 8,36   | 7,64   | 11,86                                    | 7,63   | 12,83                                    | 8,96   |
| Gesamtertrag  | 7,12 %   | 5,69 %   | 5,70 %                                   | 5,70 %   | 5,68 %                                   | 6,79 %   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |  |  |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,68 %   | 2,94 %   | 2,94 %                                   | 2,94 %   | 2,96 %                                   | 1,95 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 1,12 %   | (0,17 %)   | (0,12 %)                                 | (0,10 %)   | (0,28 %)                                 | 0,89 %   |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## US Real Estate Securities (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>AUD T<br>AUD | Thesaurierende<br>Klasse<br>CHF A<br>CHF | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M<br>€ | Ausschüttende<br>Klasse<br>HKD A<br>(Monatlich)<br>HKD |
|---|--|--|--|--|--|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |  |  |  |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 15,33                                    | 13,99                                    | 8,54                                   | 19,01                                  | 11,42                                  | 9,20   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |  |  |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,10                                     | 0,13                                     | 0,04                                   | 0,32                                   | (0,01)                                 | 0,08   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,13                                     | (0,31)                                   | 0,07                                   | 0,06                                   | 0,03                                   | 0,12   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,23                                     | (0,18)                                   | 0,11                                   | 0,38                                   | 0,02                                   | 0,20   |
| Ausschüttungen  | –  | –  | –                                      | –                                      | –                                      | (0,36)   |
| Schlussnettoinventarwert  | 15,56                                    | 13,81                                    | 8,65                                   | 19,39                                  | 11,44                                  | 9,04   |
| Gesamtertrag  | 1,50 %                                   | (1,29 %)                                 | 1,29 %                                 | 2,00 %                                 | 0,18 %                                 | 2,30 %   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |  |  |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 2,17 %                                   | 1,79 %                                   | 1,77 %                                 | 1,03 %                                 | 2,86 %                                 | 1,73 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 0,63 %                                   | 0,92 %                                   | 0,47 %                                 | 1,71 %                                 | (0,10 %)                               | 0,91 %   |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |  |  |  |  |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 14,37                                    | 13,32                                    | 7,98                                   | 17,63                                  | 10,78                                  | 8,82   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |  |  |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,12                                     | 0,15                                     | 0,09                                   | 0,34                                   | 0,02                                   | 0,10   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,84                                     | 0,52                                     | 0,47                                   | 1,04                                   | 0,62                                   | 0,63   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,96                                     | 0,67                                     | 0,56                                   | 1,38                                   | 0,64                                   | 0,73   |
| Ausschüttungen  | –  | –  | –                                      | –                                      | –                                      | (0,35)   |
| Schlussnettoinventarwert  | 15,33                                    | 13,99                                    | 8,54                                   | 19,01                                  | 11,42                                  | 9,20   |
| Gesamtertrag  | 6,68 %                                   | 5,03 %                                   | 7,02 %                                 | 7,83 %                                 | 5,94 %                                 | 8,62 %   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |  |  |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,96 %                                   | 1,59 %                                   | 1,67 %                                 | 0,93 %                                 | 2,65 %                                 | 1,70 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 0,84 %                                   | 1,11 %                                   | 1,17 %                                 | 1,92 %                                 | 0,21 %                                 | 1,15 %   |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>SGD A<br>SGD | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD A<br>(Monatlich)<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD A<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD B<br>(Monatlich)<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD B<br>US\$ |
|---|--|---|---|--|---|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |   |   |  |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 30,21                                    | 10,69   | 24,05                                     | 17,15                                    | 8,79  | 14,60                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |   |   |  |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,31                                     | 0,09  | 0,22                                      | 0,16                                     | (0,03)  | (0,05)                                    |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,06                                     | 0,25  | 0,57                                      | 0,39                                     | 0,20  | 0,33                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,37                                     | 0,34  | 0,79                                      | 0,55                                     | 0,17  | 0,28                                      |
| Ausschüttungen  | –  | (0,42)  | –   | (0,17)                                   | (0,35)  | –   |
| Schlussnettoinventarwert  | 30,58                                    | 10,61   | 24,84                                     | 17,53                                    | 8,61  | 14,88                                     |
| Gesamtertrag  | 1,22 %                                   | 3,34 %  | 3,28 %                                    | 3,27 %                                   | 1,98 %  | 1,92 %                                    |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |   |   |  |   |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,77 %                                   | 1,74 %  | 1,74 %                                    | 1,74 %                                   | 3,04 %  | 3,04 %                                    |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 1,02 %                                   | 0,88 %  | 0,90 %                                    | 0,92 %                                   | (0,40 %)  | (0,37 %)                                  |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |  |   |   |  |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 27,99                                    | 10,15   | 21,92                                     | 15,81                                    | 8,45  | 13,48                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |   |   |  |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,32                                     | 0,12  | 0,26                                      | 0,19                                     | (0,01)  | (0,02)                                    |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 1,90                                     | 0,82  | 1,87                                      | 1,32                                     | 0,69  | 1,14                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 2,22                                     | 0,94  | 2,13                                      | 1,51                                     | 0,68  | 1,12                                      |
| Ausschüttungen  | –  | (0,40)  | –   | (0,17)                                   | (0,34)  | –   |
| Schlussnettoinventarwert  | 30,21                                    | 10,69   | 24,05                                     | 17,15                                    | 8,79  | 14,60                                     |
| Gesamtertrag  | 7,93 %                                   | 9,67 %  | 9,72 %                                    | 9,70 %                                   | 8,32 %  | 8,31 %                                    |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |   |   |  |   |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,69 %                                   | 1,70 %  | 1,70 %                                    | 1,70 %                                   | 3,01 %  | 3,01 %                                    |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 1,14 %                                   | 1,18 %  | 1,20 %                                    | 1,20 %                                   | (0,12 %)  | (0,15 %)                                  |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## US Real Estate Securities (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD C1<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD E<br>(Monatlich)<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD E<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I<br>(Monatlich)<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ |
|---|--|---|---|---|---|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |   |   |   |   |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 12,22                                      | 8,79  | 13,85                                     | 9,22  | 27,36                                     | 15,75                                    |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |   |   |   |   |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,01)                                     | (0,04)  | (0,05)                                    | 0,15  | 0,46                                      | 0,29                                     |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,28                                       | 0,21  | 0,32                                      | 0,22  | 0,65                                      | 0,33                                     |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,27                                       | 0,17  | 0,27                                      | 0,37  | 1,11                                      | 0,62                                     |
| Ausschüttungen  | –  | (0,35)  | –   | (0,37)  | –   | (0,27)                                   |
| Schlussnettoinventarwert  | 12,49                                      | 8,61  | 14,12                                     | 9,22  | 28,47                                     | 16,10                                    |
| Gesamtertrag  | 2,21 %                                     | 1,98 %  | 1,95 %                                    | 4,11 %  | 4,06 %                                    | 4,03 %                                   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |   |   |   |   |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 2,74 %                                     | 3,04 %  | 3,03 %                                    | 0,99 %  | 0,99 %                                    | 0,98 %                                   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | (0,10 %)                                   | (0,41 %)  | (0,37 %)                                  | 1,67 %  | 1,68 %                                    | 1,81 %                                   |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |  |   |   |   |   |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 11,25                                      | 8,45  | 12,79                                     | 8,69  | 24,75                                     | 14,51                                    |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |   |   |   |   |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,02                                       | (0,01)  | (0,02)                                    | 0,17  | 0,48                                      | 0,29                                     |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,95                                       | 0,69  | 1,08                                      | 0,71  | 2,13                                      | 1,22                                     |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,97                                       | 0,68  | 1,06                                      | 0,88  | 2,61                                      | 1,51                                     |
| Ausschüttungen  | –  | (0,34)  | –   | (0,35)  | –   | (0,27)                                   |
| Schlussnettoinventarwert  | 12,22                                      | 8,79  | 13,85                                     | 9,22  | 27,36                                     | 15,75                                    |
| Gesamtertrag  | 8,62 %                                     | 8,32 %  | 8,29 %                                    | 10,48 %   | 10,55 %                                   | 10,62 %                                  |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |   |   |   |   |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 2,71 %                                     | 3,01 %  | 3,01 %                                    | 0,95 %  | 0,95 %                                    | 0,95 %                                   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 0,18 %                                     | (0,12 %)  | (0,16 %)                                  | 1,98 %  | 1,93 %                                    | 1,98 %                                   |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I2<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD T<br>(Monatlich)<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD T<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>ZAR B<br>(Monatlich)<br>ZAR |
|---|--|---|---|---|---|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |   |   |   |   |  |
| Eröffnungsinventarwert  | 20,15                                      | 14,25                                     | 10,21   | 16,18                                     | 16,00                                     | 80,01  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |   |   |   |   |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,38                                       | (0,01)                                    | 0,06  | 0,10                                      | 0,49                                      | (0,34)   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,48                                       | 0,33                                      | 0,23  | 0,38                                      | 0,28                                      | 3,87   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,86                                       | 0,32                                      | 0,29  | 0,48                                      | 0,77                                      | 3,53   |
| Ausschüttungen  | –  | –   | (0,40)  | –   | –   | (5,69)   |
| Schlussinventarwert   | 21,01                                      | 14,57                                     | 10,10   | 16,66                                     | 16,77                                     | 77,85  |
| Gesamtertrag  | 4,27 %                                     | 2,25 %                                    | 2,99 %  | 2,97 %                                    | 4,81 %                                    | 4,69 %   |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |          |        |        |        |          |
|--------------------------------|--------|----------|--------|--------|--------|----------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,78 % | 2,74 %   | 2,04 % | 2,04 % | 0,26 % | 3,13 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 1,89 % | (0,08 %) | 0,64 % | 0,63 % | 2,99 % | (0,44 %) |

**31. Dezember 2023**

|   |         |        |        |        |         |         |
|---|---------|--------|--------|--------|---------|---------|
| Eröffnungsinventarwert  | 18,19   | 13,12  | 9,72   | 14,79  | 14,36   | 78,11   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |         |        |        |        |         |         |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,40    | 0,02   | 0,09   | 0,13   | 0,36    | (0,11)  |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 1,56    | 1,11   | 0,79   | 1,26   | 1,28    | 7,78    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,96    | 1,13   | 0,88   | 1,39   | 1,64    | 7,67    |
| Ausschüttungen  | –       | –      | (0,39) | –      | –       | (5,77)  |
| Schlussinventarwert   | 20,15   | 14,25  | 10,21  | 16,18  | 16,00   | 80,01   |
| Gesamtertrag  | 10,78 % | 8,61 % | 9,38 % | 9,40 % | 11,42 % | 10,53 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |        |        |        |        |          |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|----------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,74 % | 2,71 % | 2,01 % | 2,00 % | 0,22 % | 2,99 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 2,19 % | 0,17 % | 0,90 % | 0,90 % | 2,49 % | (0,14 %) |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## US Real Estate Securities (Fortsetzung)

|  | Thesaurierende<br>Klasse<br>ZAR B<br>ZAR | Ausschüttende<br>Klasse<br>ZAR E<br>(Monatlich)<br>ZAR | Thesaurierende<br>Klasse<br>ZAR E<br>ZAR | Ausschüttende<br>Klasse<br>ZAR T (Monatlich)<br>ZAR | Thesaurierende<br>Klasse<br>ZAR T<br>ZAR |
|--|--|--|--|---|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>   |  |  |  |   |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert  | 179,65                                   | 80,02  | 200,99                                   | 124,36  | 249,46                                   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:  |  |  |  |   |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>  | (0,81)                                   | (0,35)   | (1,03)                                   | 0,93  | 1,65                                     |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 9,18                                     | 3,88   | 10,39                                    | 5,82  | 12,59                                    |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit   | 8,37                                     | 3,53   | 9,36                                     | 6,75  | 14,24                                    |
| Ausschüttungen   | –  | (5,69)   | –  | (8,88)  | –  |
| Schlussnettoinventarwert   | 188,02                                   | 77,86  | 210,35                                   | 122,23  | 263,70                                   |
| Gesamtertrag   | 4,66 %                                   | 4,69 %   | 4,66 %                                   | 5,75 %  | 5,71 %                                   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>   |  |  |  |   |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>   | 3,12 %                                   | 3,14 %   | 3,13 %                                   | 2,10 %  | 2,10 %                                   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)   | (0,45 %)                                 | (0,44 %)   | (0,51 %)                                 | 0,76 %  | 0,65 %                                   |
| <b>31. Dezember 2023</b>   |  |  |  |   |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert  | 162,51                                   | 78,12  | 181,81                                   | 120,20  | 223,40                                   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:  |  |  |  |   |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>  | (0,23)                                   | (0,10)   | (0,32)                                   | 1,02  | 1,93                                     |
| Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 17,37                                    | 7,77   | 19,50                                    | 12,05   | 24,13                                    |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit   | 17,14                                    | 7,67   | 19,18                                    | 13,07   | 26,06                                    |
| Ausschüttungen   | –  | (5,77)   | –  | (8,91)  | –  |
| Schlussnettoinventarwert   | 179,65                                   | 80,02  | 200,99                                   | 124,36  | 249,46                                   |
| Gesamtertrag   | 10,55 %                                  | 10,53 %  | 10,55 %                                  | 11,63 %   | 11,67 %                                  |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen</b>   |  |  |  |   |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>   | 3,01 %                                   | 3,00 %   | 3,00 %                                   | 1,99 %  | 1,99 %                                   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)   | (0,14 %)                                 | (0,14 %)   | (0,17 %)                                 | 0,87 %  | 0,85 %                                   |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Small Cap

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>AUD B<br>AUD | Thesaurierende<br>Klasse<br>AUD E<br>AUD | Thesaurierende<br>Klasse<br>AUD T<br>AUD | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR A (nicht<br>währungs-<br>gesichert)<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I<br>€ |
|---|--|--|--|--|--|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |  |  |  |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 11,99                                    | 16,78                                    | 15,66                                    | 17,04                                  | 13,95  | 20,33                                  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |  |  |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,29)                                   | (0,41)                                   | (0,21)                                   | (0,15)                                 | (0,14)   | (0,06)                                 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,88                                     | 1,24                                     | 1,14                                     | 1,18                                   | 2,24   | 1,46                                   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,59                                     | 0,83                                     | 0,93                                     | 1,03                                   | 2,10   | 1,40                                   |
| Schlussnettoinventarwert  | 12,58                                    | 17,61                                    | 16,59                                    | 18,07                                  | 16,05  | 21,73                                  |
| Gesamtertrag  | 4,92 %                                   | 4,95 %                                   | 5,94 %                                   | 6,04 %                                 | 15,05 %  | 6,89 %                                 |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |  |  |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 3,11 %                                   | 3,13 %                                   | 2,05 %                                   | 1,93 %                                 | 1,92 %   | 1,02 %                                 |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | (2,34 %)                                 | (2,35 %)                                 | (1,27 %)                                 | (0,77 %)                               | (0,89 %)   | (0,29 %)                               |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |  |  |  |  |  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 10,86                                    | 15,20                                    | 14,04                                    | 15,29                                  | 12,63  | 18,08                                  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |  |  |  |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,24)                                   | (0,33)                                   | (0,17)                                   | (0,17)                                 | (0,14)   | (0,03)                                 |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 1,37                                     | 1,91                                     | 1,79                                     | 1,92                                   | 1,46   | 2,28                                   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,13                                     | 1,58                                     | 1,62                                     | 1,75                                   | 1,32   | 2,25                                   |
| Schlussnettoinventarwert  | 11,99                                    | 16,78                                    | 15,66                                    | 17,04                                  | 13,95  | 20,33                                  |
| Gesamtertrag  | 10,41 %                                  | 10,39 %                                  | 11,54 %                                  | 11,45 %                                | 10,45 %  | 12,44 %                                |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |  |  |  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 2,86 %                                   | 2,86 %                                   | 1,89 %                                   | 1,80 %                                 | 1,81 %   | 0,97 %                                 |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | (2,09 %)                                 | (2,09 %)                                 | (1,13 %)                                 | (1,05 %)                               | (1,06 %)   | (0,18 %)                               |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## US Small Cap (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I (nicht<br>währungs-<br>gesichert)<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I2 (nicht<br>währungs-<br>gesichert)<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I4 (nicht<br>währungs-<br>gesichert)<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR M<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR Z<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP P (nicht<br>währungs-<br>gesichert)*<br>£ |
|---|--|---|---|--|--|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |   |   |  |  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 18,23  | 17,02   | 11,02   | 17,10                                  | 19,39                                  | 10,00   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |   |   |  |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,03)   | (0,02)  | 0,01  | (0,39)                                 | 0,14                                   | 0,00  |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 2,95   | 2,79  | 1,80  | 1,23                                   | 1,37                                   | (0,09)  |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 2,92   | 2,77  | 1,81  | 0,84                                   | 1,51                                   | (0,09)  |
| Schlussnettoinventarwert  | 21,15  | 19,79   | 12,83   | 17,94                                  | 20,90                                  | 9,91  |
| Gesamtertrag  | 16,02 %  | 16,27 %   | 16,42 %   | 4,91 %                                 | 7,79 %                                 | (0,90 %)  |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |   |   |  |  |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,02 %   | 0,83 %  | 0,66 %  | 2,95 %                                 | 0,13 %                                 | 0,91 %  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | (0,16 %)   | (0,11 %)  | 0,10 %  | (2,16 %)                               | 0,67 %                                 | 0,06 %  |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |  |   |   |  |  |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 16,36  | 15,26   | 9,86  | 15,49                                  | 17,10                                  | –   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |   |   |  |  |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,03)   | (0,01)  | 0,01  | (0,32)                                 | 0,11                                   | –   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 1,90   | 1,77  | 1,15  | 1,93                                   | 2,18                                   | –   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,87   | 1,76  | 1,16  | 1,61                                   | 2,29                                   | –   |
| Schlussnettoinventarwert  | 18,23  | 17,02   | 11,02   | 17,10                                  | 19,39                                  | –   |
| Gesamtertrag  | 11,43 %  | 11,53 %   | 11,76 %   | 10,39 %                                | 13,39 %                                | –   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |   |   |  |  |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,97 %   | 0,80 %  | 0,64 %  | 2,79 %                                 | 0,14 %                                 | –   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | (0,19 %)   | (0,08 %)  | 0,14 %  | (1,99 %)                               | 0,63 %                                 | –   |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Small Cap (Fortsetzung)

|   | Ausschüttende<br>Klasse<br>JPY I<br>¥ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A<br>US\$ | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD A<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD B<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD E<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ |
|---|---------------------------------------|---|--|---|---|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |                                       |   |  |   |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 5,94                                  | 27,90                                     | 18,01                                    | 20,47                                     | 18,05                                     | 31,17                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |                                       |   |  |   |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,02)                                | (0,31)                                    | (0,20)                                   | (0,47)                                    | (0,41)                                    | (0,07)                                    |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 1,28                                  | 2,51                                      | 1,62                                     | 1,84                                      | 1,62                                      | 2,80                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,26                                  | 2,20                                      | 1,42                                     | 1,37                                      | 1,21                                      | 2,73                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 7,20                                  | 30,10                                     | 19,43                                    | 21,84                                     | 19,26                                     | 33,90                                     |
| Gesamtertrag  | 21,26 %                               | 7,89 %                                    | 7,88 %                                   | 6,69 %                                    | 6,70 %                                    | 8,76 %                                    |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |          |          |          |          |          |          |
|--------------------------------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 1,01 %   | 1,82 %   | 1,82 %   | 2,92 %   | 2,96 %   | 0,97 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,23 %) | (1,06 %) | (1,07 %) | (2,19 %) | (2,10 %) | (0,20 %) |

**31. Dezember 2023**

|   |         |         |         |         |         |         |
|---|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 4,82    | 24,40   | 15,75   | 18,10   | 15,96   | 27,02   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |         |         |         |         |         |         |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,01)  | (0,28)  | (0,18)  | (0,41)  | (0,36)  | (0,06)  |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 1,13    | 3,78    | 2,44    | 2,78    | 2,45    | 4,21    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,12    | 3,50    | 2,26    | 2,37    | 2,09    | 4,15    |
| Schlussnettoinventarwert  | 5,94    | 27,90   | 18,01   | 20,47   | 18,05   | 31,17   |
| Gesamtertrag  | 23,22 % | 14,34 % | 14,35 % | 13,09 % | 13,10 % | 15,36 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |          |          |          |          |          |          |
|--------------------------------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 1,00 %   | 1,84 %   | 1,84 %   | 2,94 %   | 2,95 %   | 0,99 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,21 %) | (1,06 %) | (1,06 %) | (2,14 %) | (2,13 %) | (0,21 %) |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## US Small Cap (Fortsetzung)

|   | Ausschüttende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I3<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD T<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD Z<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>ZAR E<br>ZAR |
|---|--|--|---|---|---|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |  |   |   |   |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 22,68                                    | 15.647,89                                  | 20,63                                     | 22,73                                     | 21,30                                     | 261,62                                   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |   |   |   |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,05)                                   | 5,65                                       | (0,45)                                    | (0,28)                                    | 0,14                                      | (6,08)                                   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 2,04                                     | 1.410,60                                   | 1,85                                      | 2,04                                      | 1,93                                      | 30,36                                    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,99                                     | 1.416,25                                   | 1,40                                      | 1,76                                      | 2,07                                      | 24,28                                    |
| Schlussnettoinventarwert  | 24,67                                    | 17.064,14                                  | 22,03                                     | 24,49                                     | 23,37                                     | 285,90                                   |
| Gesamtertrag  | 8,77 %                                   | 9,05 %                                     | 6,79 %                                    | 7,74 %                                    | 9,72 %                                    | 9,28 %                                   |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |          |        |          |          |        |          |
|--------------------------------|----------|--------|----------|----------|--------|----------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,97 %   | 0,72 % | 2,82 %   | 1,93 %   | 0,12 % | 3,03 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,21 %) | 0,03 % | (2,06 %) | (1,16 %) | 0,63 % | (2,19 %) |

**31. Dezember 2023**

|   |         |           |         |         |         |         |
|---|---------|-----------|---------|---------|---------|---------|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 19,66   | 13.534,58 | 18,23   | 19,89   | 18,32   | 226,59  |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |         |           |         |         |         |         |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (0,04)  | 6,71      | (0,39)  | (0,24)  | 0,12    | (5,32)  |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 3,06    | 2.106,60  | 2,79    | 3,08    | 2,86    | 40,35   |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 3,02    | 2.113,31  | 2,40    | 2,84    | 2,98    | 35,03   |
| Schlussnettoinventarwert  | 22,68   | 15.647,89 | 20,63   | 22,73   | 21,30   | 261,62  |
| Gesamtertrag  | 15,36 % | 15,61 %   | 13,17 % | 14,28 % | 16,27 % | 15,46 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |          |        |          |          |        |          |
|--------------------------------|----------|--------|----------|----------|--------|----------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,99 %   | 0,74 % | 2,85 %   | 1,94 %   | 0,14 % | 2,94 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | (0,21 %) | 0,05 % | (2,04 %) | (1,15 %) | 0,63 % | (2,20 %) |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Small Cap (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>ZAR T<br>ZAR |
|---|--|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 220,56                                   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (2,84)                                   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 25,73                                    |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit  | 22,89                                    |
| Schlussnettoinventarwert  | 243,45                                   |
| Gesamtertrag  | 10,38 %                                  |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,98 %                                   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | (1,21 %)                                 |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |  |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 189,12                                   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | (2,35)                                   |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 33,79                                    |
| Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit  | 31,44                                    |
| Schlussnettoinventarwert  | 220,56                                   |
| Gesamtertrag  | 16,62 %                                  |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 1,93 %                                   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | (1,15 %)                                 |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

## US Small Cap Intrinsic Value

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>EUR I3*<br>€ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I (nicht<br>währungs-<br>gesichert)<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>GBP I2 (nicht<br>währungsgesichert)<br>£ | Thesaurierende<br>Klasse<br>JPY I3 (nicht<br>währungsgesichert)<br>¥ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD A<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I<br>US\$ |
|---|--|--|--|--|---|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |  |  |  |   |   |
| Eröffnungnettoinventarwert  | 10,00                                    | 10,82  | 10,05  | 1.012,53   | 21,63                                     | 19,18                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |  |  |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,01                                     | (0,02)   | 0,00   | 1,05   | (0,23)                                    | (0,03)                                    |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,96                                     | 1,06   | 0,99   | 205,26   | 1,70                                      | 1,51                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,97                                     | 1,04   | 0,99   | 206,31   | 1,47                                      | 1,48                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 10,97                                    | 11,86  | 11,04  | 1.218,84   | 23,10                                     | 20,66                                     |
| Gesamtertrag  | 9,70 %                                   | 9,61 %   | 9,85 %   | 20,38 %  | 6,80 %                                    | 7,72 %                                    |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |  |  |   |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | 0,73 %                                   | 0,99 %   | 0,81 %   | 0,74 %   | 1,82 %                                    | 0,97 %                                    |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | 0,14 %                                   | (0,17 %)   | 0,01 %   | 0,09 %   | (1,02 %)                                  | (0,17 %)                                  |
| <b>31. Dezember 2023</b>  |  |  |  |  |   |   |
| Eröffnungnettoinventarwert  | –  | 10,04  | 9,31   | 1.000,00   | 19,11                                     | 16,80                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |  |  |  |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | –  | (0,01)   | 0,00   | 0,62   | (0,20)                                    | (0,03)                                    |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | –  | 0,79   | 0,74   | 11,91  | 2,72                                      | 2,41                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | –  | 0,78   | 0,74   | 12,53  | 2,52                                      | 2,38                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | –  | 10,82  | 10,05  | 1.012,53   | 21,63                                     | 19,18                                     |
| Gesamtertrag  | –  | 7,77 %   | 7,95 %   | 1,25 %   | 13,19 %                                   | 14,17 %                                   |
| <b>Verhältnis zum durchschnittlichen<br/>Nettovermögen</b>  |  |  |  |  |   |   |
| Aufwendungen <sup>++</sup>  | –  | 0,98 %   | 0,81 %   | 0,75 %   | 1,85 %                                    | 1,00 %                                    |
| Nettoanlageerträge/(-verluste)  | –  | (0,13 %)   | 0,03 %   | 0,19 %   | (1,01 %)                                  | (0,15 %)                                  |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Small Cap Intrinsic Value (Fortsetzung)

|   | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I2<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD I3*<br>US\$ | Thesaurierende<br>Klasse<br>USD M<br>US\$ |
|---|--|---|---|
| <b>31. Dezember 2024</b>  |  |   |   |
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 9,66                                       | 10,00                                       | 17,79                                     |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |  |   |   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,00                                       | 0,01  | (0,37)                                    |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 0,76                                       | (0,36)                                      | 1,39                                      |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 0,76                                       | (0,35)                                      | 1,02                                      |
| Schlussnettoinventarwert  | 10,42                                      | 9,65  | 18,81                                     |
| Gesamtertrag  | 7,87 %                                     | (3,50 %)                                    | 5,73 %                                    |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |        |          |
|--------------------------------|--------|--------|----------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,80 % | 0,77 % | 2,81 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,00   | 0,42 % | (1,99 %) |

**31. Dezember 2023**

|   |         |   |         |
|---|---------|---|---------|
| Eröffnungsnettoinventarwert   | 8,44    | – | 15,88   |
| Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:   |         |   |         |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) <sup>+</sup>   | 0,01    | – | (0,34)  |
| Realisierter und nicht realisierter Netto-<br>gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten <sup>+</sup> | 1,21    | – | 2,25    |
| Gesamterträge aus laufender<br>Geschäftstätigkeit   | 1,22    | – | 1,91    |
| Schlussnettoinventarwert  | 9,66    | – | 17,79   |
| Gesamtertrag  | 14,45 % | – | 12,03 % |

**Verhältnis zum durchschnittlichen  
Nettovermögen**

|                                |        |   |          |
|--------------------------------|--------|---|----------|
| Aufwendungen <sup>++</sup>     | 0,83 % | – | 2,85 %   |
| Nettoanlageerträge/(-verluste) | 0,06 % | – | (2,02 %) |

<sup>+</sup> Berechnet auf Basis der durchschnittlichen Anzahl der im Berichtszeitraum im Umlauf befindlichen Anteile.

<sup>++</sup> Nach Abzug von etwaigen Kostenverzichten. Die Nettokostenquote enthält sowohl die betrieblichen als auch die nicht betrieblichen Kosten und alle erforderlichen Anpassungen, um die angemessenen Rechnungslegungsstandards zu erfüllen.

Die Kennziffern wurden, wo erforderlich, annualisiert.

\* Die Anteilklasse wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt.

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

### 25. DERIVATIVE KONTRAKTE

Der Manager des Fonds ist ein verbundenes Unternehmen von Neuberger Berman Group LLC, einem bei der SEC in den USA registrierten Anlageberater. Die hierin enthaltenen Informationen spiegeln die den allgemein anerkannten Bilanzierungsgrundsätzen der USA entsprechenden Offenlegungen wider, so dass der Manager von bestimmten Ausnahmen Gebrauch machen kann, die ihm gemäß SEC Custody Rule zur Verfügung stehen.

Die Portfolios können Transaktionen in verschiedenen derivativen Instrumenten tätigen, u. a. in Swaptions, Devisenterminkontrakten, Futures-Kontrakten, Differenzkontrakten, Optionskontrakten, Zins-Swaps, Credit Default Swaps, Cross Currency Swaps, Inflation Swaps, Volatility Swaps, Variance Swaps, Correlation Swaps und Total Return Swaps.

Derivative Kontrakte sind in der Regel Bestandteil der Anlagestrategie der Teilfonds und werden in erster Linie eingesetzt, um Anlagen zu strukturieren und abzusichern, die Performance zu steigern und die Risiken der Teilfonds zu mindern (der Fonds erfasst keine Derivate als Absicherungsinstrumente zwecks Bilanzierung von Sicherungsgeschäften (Hedge Accounting)).

Der Fonds setzt derivative Finanzinstrumente ein, um seine Risiken wirtschaftlich abzusichern, und zwar in erster Linie das Zinsrisiko und das Fremdwährungsrisiko. Derivate können auch für Handelszwecke eingesetzt werden, wenn der Manager der Ansicht ist, dass dies effektiver ist als eine direkte Anlage in den zugrundeliegenden Finanzinstrumenten.

Derivate beinhalten bei ihrer Auflegung häufig nur ein wechselseitiges Versprechen, und es findet kein oder nur ein geringer Transfer einer konkreten Gegenleistung statt. Diese Instrumente sind jedoch häufig mit einer hohen Hebelwirkung (Leverage) verbunden und sind sehr volatil. Eine relativ geringfügige Veränderung beim Basiswert eines derivativen Kontrakts kann erhebliche Auswirkungen auf den Gewinn oder Verlust des Fonds haben.

Der Manager überwacht im Rahmen des allgemeinen Portfoliomanagements sorgfältig das Derivaterisiko der Teilfonds.

Der beizulegende Zeitwert dieser derivativen Instrumente wird in der Bilanz ausgewiesen, wobei die Veränderungen im beizulegenden Zeitwert unter dem Nettogewinn/-verlust aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten ausgewiesen werden.

Die Teilfonds halten Devisenterminkontrakte, die für währungsgesicherte Anteilklassen spezifisch sind. Wechselkursschwankungen, die diese Devisenterminkontrakte beeinflussen, betreffen nur das Nettovermögen in der entsprechenden Klasse und nicht den Teilfonds als Ganzem. Weitere Informationen zu den Klassen der Devisenterminkontrakte finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestandes.

Die unten in der Tabelle aufgeführten Nennwerte gelten für die am 31. Dezember 2024 und am 31. Dezember 2023 beendeten Geschäftsjahre und geben einen Hinweis auf das Volumen der Derivate-Aktivitäten für das Jahr/den Zeitraum. Die Nennwerte geben keinen Hinweis auf das Markt- oder Kreditrisiko.

| Devisenterminkontrakte                                  | Währung | 31. Dezember 2024 | 31. Dezember 2023 |
|---|---------|-------------------|-------------------|
|   |         | Nennwert          | Nennwert          |
| Asia Responsible Transition Bond                        | USD     | 9.761.059         | 7.624.355         |
| China Bond  | CNY     | 355.033.035       | 501.443.846       |
| China Equity  | USD     | 28.262.125        | 29.600.700        |
| CLO Income  | USD     | 377.893.101       | 103.473.125       |
| Commodities   | USD     | 50.838.290        | 44.184.381        |
| Corporate Hybrid Bond                                   | EUR     | 1.186.830.128     | 1.240.321.694     |
| Developed Market FMP – 2027 <sup>1</sup>                | USD     | 1.116.045         | 566.890           |
| EMD Corporate – Social and Environmental Transition     | USD     | 104.149.233       | 90.499.208        |
| Emerging Market Debt - Hard Currency                    | USD     | 2.095.955.054     | 2.165.685.992     |
| Emerging Market Debt - Local Currency                   | USD     | 1.278.922.622     | 1.325.747.643     |
| Emerging Market Debt Blend                              | USD     | 550.024.047       | 453.961.300       |
| Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend | USD     | 86.786.862        | 79.740.684        |
| Emerging Markets Equity                                 | USD     | 50.421.286        | 47.928.844        |
| Euro Bond Absolute Return                               | EUR     | 42.610.271        | 32.819.823        |
| European High Yield Bond                                | EUR     | 140.150.503       | 86.764.076        |
| Event Driven  | USD     | 195.694.659       | 80.688.879        |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

| Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)             | Währung        | 31. Dezember 2024        | 31. Dezember 2023        |
|--|----------------|--------------------------|--------------------------|
|  |                | Nennwert                 | Nennwert                 |
| Global Bond                                      | USD            | 182.614.788              | 124.672.222              |
| Global Diversified Income FMP – 2024*            | USD            | 4.601.773                | 9.267.379                |
| Global Equity Megatrends                         | USD            | 7.260.335                | 15.241                   |
| Global Flexible Credit Income                    | USD            | 363.753.546              | 518.632.239              |
| Global High Yield Engagement                     | USD            | 495.380.148              | 412.032.033              |
| Global High Yield Sustainable Action**           | USD            | -                        | 2.821.067                |
| Global Investment Grade Credit                   | USD            | 94.436.506               | 25.864.382               |
| Global Opportunistic Bond                        | USD            | 213.970.850              | 178.355.269              |
| Global Real Estate Securities***                 | USD            | 12.624.529               | 20.240.679               |
| Global Value                                     | USD            | 3.068.017                | 3.123.978                |
| High Yield Bond                                  | USD            | 1.489.614.614            | 1.419.736.818            |
| InnovAsia  | USD            | 9.858.636                | 10.088.438               |
| Japan Equity Engagement                          | JPY            | 10.778.662.496           | 17.323.451.156           |
| Macro Opportunities FX****                       | EUR            | 91.480.928               | 201.226.517              |
| Multi-Asset Income*****                          | USD            | -                        | 7.280.240                |
| Next Generation Connectivity                     | USD            | 282.203.870              | 276.104.436              |
| Next Generation Mobility                         | USD            | 615.079                  | 4.462.307                |
| Short Duration Emerging Market Debt              | USD            | 3.509.371.860            | 4.048.706.440            |
| Short Duration Euro Bond                         | EUR            | 66.665.131               | 89.387.136               |
| Short Duration High Yield Engagement             | USD            | 503.255.615              | 446.518.481              |
| Strategic Income                                 | USD            | 1.742.541.382            | 717.144.047              |
| Sustainable Asia High Yield                      | USD            | 251.236                  | 2.762.038                |
| Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency | USD            | 852.412.024              | 537.345.435              |
| Tactical Macro <sup>1</sup>                      | USD            | 9.528.744                | 4.726.376                |
| Uncorrelated Strategies                          | USD            | 3.999.054.599            | 6.011.925.711            |
| Uncorrelated Trading*****                        | USD            | -                        | 665.116.496              |
| US Equity  | USD            | 43.450.913               | 35.518.253               |
| US Equity Premium                                | USD            | 284.628.649              | 335.985.103              |
| US Large Cap Value                               | USD            | 40.932.522               | 29.275.778               |
| US Long Short Equity                             | USD            | 106.904.306              | 110.571.990              |
| US Multi Cap Opportunities                       | USD            | 71.863.704               | 65.123.730               |
| US Real Estate Securities                        | USD            | 94.107.996               | 101.174.772              |
| US Small Cap                                     | USD            | 50.206.176               | 23.583.750               |
| US Small Cap Intrinsic Value                     | USD            | 5.442.348                | 35.273                   |
| <b>Differenzkontrakte*****</b>                   |                |                          |                          |
|  | <b>Währung</b> | <b>31. Dezember 2024</b> | <b>31. Dezember 2023</b> |
|  |                | <b>Nennwert</b>          | <b>Nennwert</b>          |
| Uncorrelated Strategies                          | USD            | 9.650.762.517            | 17.301.601.051           |
| Uncorrelated Trading*****                        | USD            | -                        | 2.674.871.662            |
| US Long Short Equity                             | USD            | 25.488.581               | 15.351.407               |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

| Optionskontrakte*****       | Währung | 31. Dezember 2024 | 31. Dezember 2023 |
|-----------------------------|---------|-------------------|-------------------|
|                             |         | Nennwert          | Nennwert          |
| Multi-Asset Income*****     | USD     | -                 | 10.169.750        |
| Tactical Macro <sup>1</sup> | USD     | 58.867.225        | 42.552.125        |
| Uncorrelated Strategies     | USD     | 123.948.615.447   | 504.750.536.076   |
| Uncorrelated Trading*****   | USD     | -                 | 58.484.983.323    |
| US Equity Premium           | USD     | 772.908.250       | 770.443.500       |
| US Long Short Equity        | USD     | 865.500           | 2.120.250         |

| Futures-Kontrakte*****                                  | Währung | 31. Dezember 2024 | 31. Dezember 2023 |
|---|---------|-------------------|-------------------|
|   |         | Nennwert          | Nennwert          |
| Asia Responsible Transition Bond                        | USD     | 8.099.969         | 6.440.163         |
| China Bond  | CNY     | 17.773.911        | 32.695.571        |
| EMD Corporate – Social and Environmental Transition     | USD     | 9.837.936         | 7.369.474         |
| Emerging Market Debt - Hard Currency                    | USD     | 844.301.044       | 904.524.632       |
| Emerging Market Debt - Local Currency                   | USD     | 48.527.054        | 63.491.449        |
| Emerging Market Debt Blend                              | USD     | 54.542.370        | 43.648.020        |
| Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend | USD     | 27.166.326        | 21.097.832        |
| Euro Bond   | EUR     | 16.830.028        | 3.392.723         |
| Euro Bond Absolute Return                               | EUR     | 21.259.431        | 25.720.943        |
| Global Bond   | USD     | 35.435.518        | 34.645.038        |
| Global Flexible Credit Income                           | USD     | 228.607.028       | 211.529.519       |
| Global High Yield Engagement                            | USD     | 4.233.890         | -                 |
| Global Opportunistic Bond                               | USD     | 45.150.678        | 49.132.672        |
| Multi-Asset Income*****                                 | USD     | -                 | 434.843           |
| Short Duration Euro Bond                                | EUR     | 299.422.350       | 289.266.783       |
| Strategic Income  | USD     | 966.483.356       | 564.672.378       |
| Sustainable Asia High Yield                             | USD     | 2.393.361         | 1.464.430         |
| Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency        | USD     | 310.558.496       | 180.952.510       |
| Tactical Macro <sup>1</sup>                             | USD     | 1.357.640         | 1.357.640         |
| Uncorrelated Strategies                                 | USD     | 8.793.925.851     | 9.775.604.535     |
| Uncorrelated Trading*****                               | USD     | -                 | 1.262.859.587     |
| US Long Short Equity                                    | USD     | 51.286.950        | 22.464.651        |

| Zinsswap-Kontrakte*****                                 | Währung | 31. Dezember 2024 | 31. Dezember 2023 |
|---|---------|-------------------|-------------------|
|   |         | Nennwert          | Nennwert          |
| Asia Responsible Transition Bond                        | USD     | 1.241.366         | 1.088.909         |
| China Bond  | CNY     | 650.000           | -                 |
| Emerging Market Debt - Local Currency                   | USD     | 607.382.268       | 739.173.899       |
| Emerging Market Debt Blend                              | USD     | 170.537.410       | 185.084.881       |
| Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend | USD     | 4.381.389         | 3.860.688         |
| Euro Bond   | EUR     | 868.114           | 584.031           |
| Euro Bond Absolute Return                               | EUR     | 3.489.833         | 3.200.000         |
| Global Bond   | USD     | 9.875.283         | 8.470.420         |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

| Zinsswap-Kontrakte***** (Fortsetzung) | Währung | 31. Dezember 2024<br>Nennwert | 31. Dezember 2023<br>Nennwert |
|---------------------------------------|---------|-------------------------------|-------------------------------|
| Global Opportunistic Bond             | USD     | 645.702.619                   | 7.586.294                     |
| Short Duration Euro Bond              | EUR     | 12.479.054                    | 37.479.054                    |
| Strategic Income                      | USD     | 22.252.219                    | 32.005.337                    |
| Uncorrelated Strategies               | USD     | 3.662.548.239                 | 26.051.846.069                |
| Uncorrelated Trading*****             | USD     | -                             | 3.967.385.884                 |

| Credit-Default-Swap-Kontrakte*****                      | Währung | 31. Dezember 2024<br>Nennwert | 31. Dezember 2023<br>Nennwert |
|---|---------|-------------------------------|-------------------------------|
| EMD Corporate – Social and Environmental Transition     | USD     | 2.000.000                     | -                             |
| Emerging Market Debt - Hard Currency                    | USD     | 55.163.500                    | 16.320.000                    |
| Emerging Market Debt Blend                              | USD     | 8.986.392                     | 14.175.340                    |
| Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend | USD     | 338.289                       | -                             |
| Euro Bond   | EUR     | 1.865.000                     | 640.000                       |
| Euro Bond Absolute Return                               | EUR     | 2.860.000                     | 2.630.000                     |
| Global Bond   | USD     | 1.860.000                     | 3.346.146                     |
| Global Flexible Credit Income                           | USD     | 2.093.500                     | -                             |
| Global Opportunistic Bond                               | USD     | 16.133.755                    | 14.848.460                    |
| Short Duration Euro Bond                                | EUR     | 29.200.000                    | 38.600.000                    |
| Strategic Income  | USD     | 31.261.600                    | 14.349.207                    |
| Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency        | USD     | 13.348.500                    | 460.000                       |
| Uncorrelated Strategies                                 | USD     | 42.737.709                    | 70.342.375                    |
| Uncorrelated Trading*****                               | USD     | -                             | 2.161.542                     |

| Total Return Swap-Kontrakte***** | Währung | 31. Dezember 2024<br>Nennwert | 31. Dezember 2023<br>Nennwert |
|----------------------------------|---------|-------------------------------|-------------------------------|
| CLO Income                       | USD     | 11.999.791                    | 9.249.791                     |
| Commodities <sup>1</sup>         | USD     | 76.003.693                    | 118.380.497                   |
| European High Yield Bond         | EUR     | 5.009.163                     | 5.009.163                     |
| Event Driven                     | USD     | 171.354.386                   | 70.746.168                    |
| Global Flexible Credit Income    | USD     | 14.248.809                    | 26.749.674                    |
| Global High Yield Engagement     | USD     | -                             | 18.975.000                    |
| High Yield Bond                  | USD     | 12.500.000                    | 20.500.000                    |
| Strategic Income                 | USD     | 36.840.000                    | 100.180.000                   |
| Tactical Macro <sup>1</sup>      | USD     | 3.459.225                     | -                             |
| Uncorrelated Strategies          | USD     | 156.209.137                   | 254.825.479                   |
| Uncorrelated Trading*****        | USD     | -                             | 4.337.204                     |
| US Long Short Equity             | USD     | 14.294.944                    | 26.203.198                    |

| Swaptions                 | Währung | 31. Dezember 2024<br>Nennwert | 31. Dezember 2023<br>Nennwert |
|---------------------------|---------|-------------------------------|-------------------------------|
| Strategic Income          | USD     | 11.046.550                    | 11.046.550                    |
| Uncorrelated Strategies   | USD     | 611.006.239                   | 1.396.221.230                 |
| Uncorrelated Trading***** | USD     | -                             | 128.069.998                   |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

| Inflation Swap-Kontrakte***** | Währung | 31. Dezember 2024 | 31. Dezember 2023 |
|-------------------------------|---------|-------------------|-------------------|
|                               |         | Nennwert          | Nennwert          |
| Euro Bond                     | EUR     | 375.000           | 500.000           |
| Euro Bond Absolute Return     | EUR     | 1.500.000         | 6.998.975         |
| Short Duration Euro Bond      | EUR     | 30.000.000        | 42.500.000        |
| Strategic Income              | USD     | 15.707.500        | -                 |
| Uncorrelated Strategies       | USD     | -                 | 311.774.136       |

| Volatility-Swap-Kontrakte***** | Währung | 31. Dezember 2024 | 31. Dezember 2023 |
|--------------------------------|---------|-------------------|-------------------|
|                                |         | Nennwert          | Nennwert          |
| Uncorrelated Strategies        | USD     | 5.411.993.818     | 9.460.184.524     |
| Uncorrelated Trading*****      | USD     | -                 | 235.186.883       |

| Variance-Swap-Kontrakte***** | Währung | 31. Dezember 2024 | 31. Dezember 2023 |
|------------------------------|---------|-------------------|-------------------|
|                              |         | Nennwert          | Nennwert          |
| Uncorrelated Strategies      | USD     | 116.638.318       | 5.118.171         |
| Uncorrelated Trading*****    | USD     | -                 | 706.681           |

| Correlation-Swap-Kontrakte***** | Währung | 31. Dezember 2024 | 31. Dezember 2023 |
|---------------------------------|---------|-------------------|-------------------|
|                                 |         | Nennwert          | Nennwert          |
| Uncorrelated Strategies         | USD     | 2.500.000         | 9.135.000         |
| Uncorrelated Trading*****       | USD     | -                 | 500.000           |

\* Das Portfolio wurde am 28. Juni 2024 aufgelöst.

\*\* Das Portfolio wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.

\*\*\* Das Portfolio wurde am 31. Dezember 2024 aufgelöst.

\*\*\*\* Das Portfolio wurde am 8. Februar 2024 aufgelöst.

\*\*\*\*\* Das Portfolio wurde am 6. Juli 2023 aufgelöst.

\*\*\*\*\* Das Portfolio wurde am 23. Mai 2023 aufgelöst.

\*\*\*\*\* Die angezeigten Beträge sind absolute Nennwerte.

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

Der realisierte Nettogewinn/(-verlust) und die Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024 sowie die Beträge, die im Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten innerhalb der Gewinn- und Verlustrechnung erfasst wurden, sind wie folgt (Beträge in der jeweiligen Basiswährung der Portfolios):

|  | Wechselkursrisiko                   |   | Zinsrisiko                          |   | Eigenkapitalrisiko                  |   | Kreditrisiko                        |   |
|--|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|
|  | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) |
| Asia Responsible Transition Bond         |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte                   | (76.131)                            | 27.283  | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Futures-Kontrakte                        | -                                   | -   | (48.932)                            | (162.851)   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Swap-Kontrakte                           | -                                   | -   | 7.015                               | (383)   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| China Bond                               |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte                   | 6.691.938                           | 564.391   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Futures-Kontrakte                        | -                                   | -   | 215.575                             | (589.473)   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Swap-Kontrakte                           | -                                   | -   | (364)                               | 5.674   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| China Equity                             |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte                   | 72.797                              | (304.947)   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| CLO Income                               |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte                   | (5.902.535)                         | 20.824.826  | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Swap-Kontrakte                           | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   | 847.845                             | (243.021)   |
| Commodities                              |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte                   | 2.527.959                           | (2.651.304)   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Swap-Kontrakte                           | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   | 1.416.120                           | -   |
| Corporate Hybrid Bond                    |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte                   | (15.798.178)                        | (12.850.931)  | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Developed Market FMP – 2027 <sup>1</sup> |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte                   | 18.878                              | (108.304)   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

|   | Wechselkursrisiko                   |   | Zinsrisiko                          |   | Eigenkapitalrisiko                  |   | Kreditrisiko                        |   |
|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|
|   | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) |
| EMD Corporate – Social and Environmental Transition     |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte                                  | (2.921.057)                         | (3.902.006)   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Futures-Kontrakte                                       | -                                   | -   | 93.580                              | 316.574   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Swap-Kontrakte  | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   | (42.453)                            | 23.607  |
| Emerging Market Debt - Hard Currency                    |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte                                  | (2.625.433)                         | (32.136.232)  | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Futures-Kontrakte                                       | -                                   | -   | (522.997)                           | (5.772.509)   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Swap-Kontrakte  | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   | (1.710.099)                         | 168.209   |
| Emerging Market Debt - Local Currency                   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte                                  | (19.789.756)                        | (11.469.623)  | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Futures-Kontrakte                                       | -                                   | -   | 261.229                             | 573.996   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Optionskontrakte  | -                                   | -   | (172.531)                           | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Swap-Kontrakte  | -                                   | -   | (13.585.441)                        | (4.872.602)   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Emerging Market Debt Blend                              |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte                                  | (10.557.882)                        | (9.590.865)   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Futures-Kontrakte                                       | -                                   | -   | (11.345)                            | (67.165)  | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Optionskontrakte  | (39.525)                            | -   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Swap-Kontrakte  | -                                   | -   | (4.484.531)                         | (269.873)   | -                                   | -   | (456.461)                           | 107.322   |
| Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte                                  | (7.868)                             | (2.893.425)   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Futures-Kontrakte                                       | -                                   | -   | (36.163)                            | (427.012)   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Optionskontrakte  | (3.325)                             | -   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Swap-Kontrakte  | -                                   | -   | (66.004)                            | 1.559   | -                                   | -   | (7.112)                             | 3.179   |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

|                                     | Wechselkursrisiko                   |   | Zinsrisiko                          |   | Eigenkapitalrisiko                  |   | Kreditrisiko                        |   |
|-------------------------------------|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|
|                                     | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) |
| Emerging Markets Equity             |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte              | 226.170                             | (1.575.785)   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Euro Bond                           |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Futures-Kontrakte                   | -                                   | -   | 254.255                             | (99.163)  | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Optionskontrakte                    | -                                   | -   | 8.156                               | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Swap-Kontrakte                      | -                                   | -   | 26.423                              | (10.528)  | -                                   | -   | (119.422)                           | 36.678  |
| Euro Bond Absolute Return           |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte              | (612.803)                           | 2.917.812   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Futures-Kontrakte                   | -                                   | -   | (106.188)                           | 610.105   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Optionskontrakte                    | -                                   | -   | 3.708                               | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Swap-Kontrakte                      | -                                   | -   | 102.477                             | (129.063)   | -                                   | -   | (242.256)                           | 99.722  |
| European High Yield Bond            |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte              | (3.688.645)                         | 1.229.262   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Swap-Kontrakte                      | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   | (60.483)                            | (18.355)  |
| Event Driven                        |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte              | 7.648.282                           | (13.874.125)  | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Swap-Kontrakte                      | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   | 7.803.531                           | (1.347.449)   |
| Global Bond                         |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte              | (249.192)                           | (378.814)   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Futures-Kontrakte                   | -                                   | -   | (15.914)                            | 222.829   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Optionskontrakte                    | -                                   | -   | (3.522)                             | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Swap-Kontrakte                      | -                                   | -   | 132.828                             | (76.949)  | -                                   | -   | (1.382)                             | 72.291  |
| Global Diversified Income FMP–2024* |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte              | 42.320                              | (281.732)   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

|                                | Wechselkursrisiko                   |   | Zinsrisiko                          |   | Eigenkapitalrisiko                  |   | Kreditrisiko                        |   |
|--------------------------------|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|
|                                | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) |
| Global Equity Megatrends       |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte         | 12.894                              | (215.576)   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Global Flexible Credit Income  |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte         | 8.676.052                           | (7.664.433)   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Futures-Kontrakte              | -                                   | -   | (2.337.666)                         | 1.246.415   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Swap-Kontrakte                 | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   | 471.020                             | (126.978)   |
| Global High Yield Engagement   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte         | (3.382.945)                         | (7.067.179)   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Swap-Kontrakte                 | -                                   | -   | (40.585)                            | (69.709)  | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Global Investment Grade Credit |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte         | (1.560.808)                         | 1.270.890   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Global Opportunistic Bond      |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte         | (1.854.527)                         | 5.078.709   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Futures-Kontrakte              | -                                   | -   | (41.392)                            | (636.502)   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Optionskontrakte               | -                                   | -   | (64)                                | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Swap-Kontrakte                 | -                                   | -   | (80.264)                            | 74.052  | -                                   | -   | (1.174.844)                         | 604.518   |
| Global Real Estate Securities* |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte         | 152.245                             | (229.353)   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Global Value                   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte         | 7.166                               | (48.421)  | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| High Yield Bond                |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte         | 29.058.597                          | (66.110.757)  | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Swap-Kontrakte                 | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   | 480.861                             | 51.928  |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

|                                      | Wechselkursrisiko                   |   | Zinsrisiko                          |   | Eigenkapitalrisiko                  |   | Kreditrisiko                        |   |
|--------------------------------------|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|
|                                      | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) |
| InnovAsia                            |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte               | 96.968                              | (644.624)   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Japan Equity Engagement              |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte               | 87.341.377                          | (85.753.726)  | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Macro Opportunities FX <sup>*</sup>  |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte               | 15.701                              | (13.600)  | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Next Generation Connectivity         |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte               | 4.013.946                           | (15.559.946)  | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Next Generation Mobility             |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte               | (3.187)                             | (21.111)  | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Short Duration Emerging Market Debt  |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte               | (89.685.804)                        | (115.158.741)   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Short Duration Euro Bond             |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte               | (1.189.834)                         | 2.370.913   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Futures-Kontrakte                    | -                                   | -   | 2.712.144                           | 3.819.346   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Optionskontrakte                     | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Swap-Kontrakte                       | -                                   | -   | 234.607                             | (86.758)  | -                                   | -   | (2.884.595)                         | 1.338.282   |
| Short Duration High Yield Engagement |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte               | 651.957                             | (28.799.469)  | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Strategic Income                     |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte               | 1.082.527                           | (53.189.996)  | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Futures-Kontrakte                    | -                                   | -   | 13.820.790                          | 17.598.470  | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Optionskontrakte                     | -                                   | -   | (103.174)                           | -   | (41.048)                            | -   | -                                   | -   |
| Swap-Kontrakte                       | -                                   | -   | 687.419                             | (511.162)   | -                                   | -   | 4.875.883                           | (788.676)   |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

|  | Wechselkursrisiko                   |   | Zinsrisiko                          |   | Eigenkapitalrisiko                  |   | Kreditrisiko                        |   |
|--|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|
|  | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) |
| Strategic Income (Fortsetzung)                   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Swaptions  | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   | (52.385)                            | (15.122)  |
| Sustainable Asia High Yield                      |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte                           | (895)                               | (16.430)  | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Futures-Kontrakte                                | -                                   | -   | (96.044)                            | 20.319  | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte                           | (9.229.127)                         | (15.492.380)  | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Futures-Kontrakte                                | -                                   | -   | (3.934.766)                         | (2.894.722)   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Swap-Kontrakte                                   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   | (339.461)                           | 46.324  |
| Tactical Macro <sup>1</sup>                      |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte                           | 30.633                              | (259.971)   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Futures-Kontrakte                                | -                                   | -   | (102.024)                           | 19.364  | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Optionskontrakte                                 | (65.338)                            | 80.615  | (104.712)                           | (151.621)   | 181.837                             | (10.425)  | -                                   | -   |
| Swap-Kontrakte                                   | -                                   | -   | -                                   | -   | 38.951                              | (17.802)  | -                                   | -   |
| Uncorrelated Strategies                          |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Differenzkontrakte                               | -                                   | -   | -                                   | -   | (43.185.931)                        | (79.875.918)  | -                                   | -   |
| Devisenterminkontrakte                           | 49.607.696                          | (59.251.391)  | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Futures-Kontrakte                                | 13.780                              | 11.533.145  | 64.933.920                          | 7.743.706   | 43.322                              | (5.039.998)   | -                                   | -   |
| Optionskontrakte                                 | (2.875.269)                         | 386.835   | 5.024.848                           | (25.301.867)  | 13.402.070                          | 145.981.672   | -                                   | -   |
| Swap-Kontrakte                                   | (183.389)                           | -   | (19.418.041)                        | 5.362.655   | 12.630.902                          | (6.263.959)   | (1.669.667)                         | 1.008.214   |
| Swaptions  | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   | (1.176.231)                         | (1.560)   |
| US Equity  |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte                           | (1.754.966)                         | (2.232.533)   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

|                              | Wechselkursrisiko                   |   | Zinsrisiko                          |   | Eigenkapitalrisiko                  |   | Kreditrisiko                        |   |
|------------------------------|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|
|                              | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) |
| US Equity Premium            |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte       | 15.323.995                          | (19.873.544)  | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Optionskontrakte             | -                                   | -   | -                                   | -   | 69.935.845                          | (7.913.425)   | -                                   | -   |
| US Large Cap Value           |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte       | 392.797                             | (2.696.185)   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| US Long Short Equity         |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Differenzkontrakte           | -                                   | -   | -                                   | -   | (6.020.659)                         | 2.928.020   | -                                   | -   |
| Devisenterminkontrakte       | 1.634.994                           | (8.161.761)   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Futures-Kontrakte            | -                                   | -   | -                                   | -   | (10.901.304)                        | 3.596.148   | -                                   | -   |
| Optionskontrakte             | -                                   | -   | -                                   | -   | 9.770                               | 21.402  | -                                   | -   |
| Swap-Kontrakte               | -                                   | -   | -                                   | -   | (7.498.942)                         | (152.002)   | -                                   | -   |
| US Multi Cap Opportunities   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte       | 1.764.656                           | (4.562.323)   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| US Real Estate Securities    |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte       | 2.134.481                           | (4.970.121)   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| US Small Cap                 |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte       | 379.413                             | (2.271.526)   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| US Small Cap Intrinsic Value |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte       | (46.725)                            | (505.076)   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

Der realisierte Nettogewinn/(-verlust) und die Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 sowie die Beträge, die im Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten innerhalb der Gewinn- und Verlustrechnung erfasst wurden, sind wie folgt (Beträge in der jeweiligen Basiswährung der Portfolios):

|  | Wechselkursrisiko                   |   | Zinsrisiko                          |   | Eigenkapitalrisiko                  |   | Kreditrisiko                        |   |
|--|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|
|  | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) |
| Asia Responsible Transition Bond         |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte                   | (84.287)                            | 42.076  | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Futures-Kontrakte                        | -                                   | -   | 246.941                             | 84.106  | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Swap-Kontrakte                           | -                                   | -   | 17.942                              | 554   | -                                   | -   | (1.774)                             | -   |
| China Bond                               |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte                   | 13.714.698                          | (1.637.908)   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Futures-Kontrakte                        | -                                   | -   | (3.254.641)                         | 641.419   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| China Equity                             |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte                   | 184.079                             | (158.273)   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| CLO Income                               |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte                   | 3.533.994                           | (2.503.040)   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Swap-Kontrakte                           | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   | 314.738                             | 383.055   |
| Commodities                              |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte                   | 1.062.795                           | 176.812   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Swap-Kontrakte                           | -                                   | -   | -                                   | -   | (13.495.759)                        | -   | -                                   | -   |
| Corporate Hybrid Bond                    |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte                   | (2.362.877)                         | (11.919.193)  | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Developed Market FMP – 2027 <sup>1</sup> |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte                   | (25.249)                            | 39.476  | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

|   | Wechselkursrisiko                   |   | Zinsrisiko                          |   | Eigenkapitalrisiko                  |   | Kreditrisiko                        |   |
|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|
|   | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) |
| EMD Corporate – Social and Environmental Transition     |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte                                  | 580.387                             | 951.841   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Futures-Kontrakte                                       | -                                   | -   | 404.614                             | (251.450)   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Swap-Kontrakte  | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   | (21.639)                            | -   |
| Emerging Market Debt - Hard Currency                    |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte                                  | (10.104.061)                        | 17.367.203  | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Futures-Kontrakte                                       | -                                   | -   | (12.892.426)                        | (12.494.331)  | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Swap-Kontrakte  | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   | 904.188                             | (1.909.636)   |
| Emerging Market Debt - Local Currency                   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte                                  | 11.460.818                          | (487.320)   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Futures-Kontrakte                                       | -                                   | -   | 197.184                             | 273.385   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Swap-Kontrakte  | -                                   | -   | (34.175.882)                        | 34.762.871  | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Emerging Market Debt Blend                              |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte                                  | 2.131.413                           | 2.590.338   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Futures-Kontrakte                                       | -                                   | -   | (1.123.477)                         | (786.259)   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Swap-Kontrakte  | -                                   | -   | (3.699.073)                         | 3.557.307   | -                                   | -   | (1.408.426)                         | (1.658.685)   |
| Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte                                  | (3.206.578)                         | 1.934.611   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Futures-Kontrakte                                       | -                                   | -   | (886.171)                           | (68.929)  | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Swap-Kontrakte  | -                                   | -   | (94.090)                            | 73.032  | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Emerging Markets Equity                                 |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte                                  | (2.109)                             | 98.303  | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

|                                     | Wechselkursrisiko                   |   | Zinsrisiko                          |   | Eigenkapitalrisiko                  |   | Kreditrisiko                        |   |
|-------------------------------------|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|
|                                     | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) |
| Euro Bond                           |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Futures-Kontrakte                   | -                                   | -   | (14.161)                            | 53.871  | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Swap-Kontrakte                      | -                                   | -   | 1.073                               | 27.954  | -                                   | -   | (31.470)                            | (47.958)  |
| Euro Bond Absolute Return           |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte              | (357.013)                           | (100.045)   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Futures-Kontrakte                   | -                                   | -   | 1.146.748                           | (1.649.016)   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Swap-Kontrakte                      | -                                   | -   | 40.607                              | 162.305   | -                                   | -   | (147.516)                           | (148.450)   |
| European High Yield Bond            |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte              | (1.982.496)                         | 1.216.114   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Swap-Kontrakte                      | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   | (9.760)                             | 18.355  |
| Event Driven                        |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte              | 206.153                             | 3.003.125   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Swap-Kontrakte                      | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   | 1.227.916                           | 941.165   |
| Global Bond                         |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte              | (1.032.207)                         | (588.150)   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Futures-Kontrakte                   | -                                   | -   | 340.673                             | (261.309)   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Optionskontrakte                    | -                                   | -   | (14.000)                            | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Swap-Kontrakte                      | -                                   | -   | 221.533                             | 123.475   | -                                   | -   | 3.562                               | (59.106)  |
| Global Diversified Income FMP–2024* |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte              | 410.477                             | (241.838)   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Global Equity Megatrends            |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte              | -                                   | 444   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

|                                       | Wechselkursrisiko                   |   | Zinsrisiko                          |   | Eigenkapitalrisiko                  |   | Kreditrisiko                        |   |
|---------------------------------------|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|
|                                       | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) |
| Global Flexible Credit Income         |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte                | 23.332.772                          | (13.492.432)  | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Futures-Kontrakte                     | -                                   | -   | 2.424.244                           | (1.391.731)   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Swap-Kontrakte                        | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   | 249.754                             | 900.363   |
| Global High Yield Engagement          |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte                | 2.790.595                           | 1.750.164   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Swap-Kontrakte                        | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   | 301.493                             | (13.411)  |
| Global High Yield Sustainable Action* |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte                | (430.114)                           | 350.409   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Global Investment Grade Credit        |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte                | (1.050.604)                         | 520.360   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Global Opportunistic Bond             |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte                | (1.960.311)                         | 883.559   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Futures-Kontrakte                     | -                                   | -   | (646.937)                           | 521.019   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Swap-Kontrakte                        | -                                   | -   | (71.440)                            | (17.226)  | -                                   | -   | (1.285.179)                         | (1.018.186)   |
| Global Real Estate Securities         |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte                | 448.253                             | (546.458)   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Global Value                          |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte                | 20.982                              | (15.305)  | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| High Yield Bond                       |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte                | 12.174.201                          | (5.197.021)   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Swap-Kontrakte                        | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   | 240.943                             | 353.035   |
| InnovAsia                             |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte                | 212.374                             | (135.608)   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

|                                      | Wechselkursrisiko                   |   | Zinsrisiko                          |   | Eigenkapitalrisiko                  |   | Kreditrisiko                        |   |
|--------------------------------------|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|
|                                      | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) |
| Japan Equity Engagement              |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte               | 1.239.623.973                       | 183.165.732   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Macro Opportunities FX*              |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte               | (2.127.786)                         | 824.969   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Futures-Kontrakte                    | -                                   | -   | 8.828                               | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Multi-Asset Income*                  |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte               | (540.982)                           | 423.900   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Futures-Kontrakte                    | -                                   | -   | 4.128                               | (40.257)  | (2.851)                             | (7.781)   | -                                   | -   |
| Optionskontrakte                     | -                                   | -   | -                                   | -   | 226.839                             | 55.510  | -                                   | -   |
| Next Generation Connectivity         |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte               | 5.192.363                           | (3.552.805)   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Next Generation Mobility             |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte               | 65.632                              | (70.243)  | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Short Duration Emerging Market Debt  |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte               | (41.340.360)                        | 32.707.080  | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Short Duration Euro Bond             |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte               | (5.209.978)                         | 4.062.314   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Futures-Kontrakte                    | -                                   | -   | 6.652.152                           | (9.957.859)   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Swap-Kontrakte                       | -                                   | -   | (104.982)                           | 1.716.421   | -                                   | -   | (1.827.198)                         | (1.635.504)   |
| Short Duration High Yield Engagement |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte               | (8.357.412)                         | (5.584.858)   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Strategic Income                     |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte               | (14.302.284)                        | (7.621.460)   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Futures-Kontrakte                    | -                                   | -   | 24.458.245                          | (16.418.065)  | -                                   | -   | -                                   | -   |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

|  | Wechselkursrisiko                   |   | Zinsrisiko                          |   | Eigenkapitalrisiko                  |   | Kreditrisiko                        |   |
|--|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|
|  | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) |
| Strategic Income (Fortsetzung)                   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Swap-Kontrakte                                   | -                                   | -   | (55.651)                            | 214.167   | -                                   | -   | 8.912.186                           | 5.302.649   |
| Swaptions  | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   | (1.003)                             | 15.122  |
| Sustainable Asia High Yield                      |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte                           | 309.753                             | (236.678)   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Futures-Kontrakte                                | -                                   | -   | 52.309                              | (47.496)  | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Swap-Kontrakte                                   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   | (1.885)                             | -   |
| Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte                           | (8.837.398)                         | 6.354.956   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Futures-Kontrakte                                | -                                   | -   | (8.439.258)                         | 1.469.059   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Swap-Kontrakte                                   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   | (129.166)                           | (53.826)  |
| Tactical Macro <sup>1</sup>                      |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte                           | (15.490)                            | 30.520  | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Futures-Kontrakte                                | -                                   | -   | 88.726                              | (19.364)  | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Optionskontrakte                                 | 35.570                              | (80.493)  | 35.286                              | (4.131)   | 7.969                               | (22.675)  | -                                   | -   |
| Swap-Kontrakte                                   | -                                   | -   | (17.694)                            | -   | 20.220                              | -   | -                                   | -   |
| Uncorrelated Strategies                          |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Differenzkontrakte                               | -                                   | -   | -                                   | -   | (38.284.984)                        | 66.830.536  | -                                   | -   |
| Devisenterminkontrakte                           | 194.838.411                         | (135.694.188)   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Futures-Kontrakte                                | (12.511)                            | (465.602)   | (57.783.403)                        | (23.399.970)  | (214.065)                           | 2.337.191   | -                                   | -   |
| Optionskontrakte                                 | (5.650.286)                         | (977.722)   | (45.886.349)                        | 21.433.917  | (91.796.907)                        | (8.714.110)   | -                                   | -   |
| Swap-Kontrakte                                   | -                                   | -   | 30.631.005                          | (47.398.570)  | (18.554.766)                        | (18.067.170)  | (812.024)                           | (1.430.223)   |
| Swaptions  | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   | (8.831.969)                         | (669.209)   |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

|                            | Wechselkursrisiko                   |   | Zinsrisiko                          |   | Eigenkapitalrisiko                  |   | Kreditrisiko                        |   |
|----------------------------|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|
|                            | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) |
| Uncorrelated Trading*      |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Differenzkontrakte         | -                                   | -   | -                                   | -   | 86.773.401                          | (10.664.847)  | -                                   | -   |
| Devisenterminkontrakte     | 47.134.508                          | (48.168.205)  | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Futures-Kontrakte          | -                                   | (267.113)   | (85.165.159)                        | (3.388.046)   | -                                   | 55.918  | -                                   | -   |
| Optionskontrakte           | 18.261                              | (31.049)  | 932.386                             | (5.901.762)   | (16.637.386)                        | 12.495.011  | -                                   | -   |
| Swap-Kontrakte             | -                                   | -   | 782.103                             | (23.822)  | (4.798.143)                         | (1.055.312)   | (317.578)                           | 47.926  |
| Swaptions                  | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   | (162.308)                           | (48.110)  |
| US Equity                  |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte     | (2.356.287)                         | (476.620)   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| US Equity Premium          |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte     | 17.968.715                          | (3.650.755)   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Optionskontrakte           | -                                   | -   | -                                   | -   | 69.891.783                          | 7.680.530   | -                                   | -   |
| US Large Cap Value         |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte     | 213.781                             | 132.060   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| US Long Short Equity       |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Differenzkontrakte         | -                                   | -   | -                                   | -   | (374.469)                           | (3.986.584)   | -                                   | -   |
| Devisenterminkontrakte     | 3.889.440                           | (2.923.219)   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| Futures-Kontrakte          | -                                   | -   | -                                   | -   | (4.880.547)                         | (1.473.682)   | -                                   | -   |
| Optionskontrakte           | -                                   | -   | -                                   | -   | 405.975                             | 58.646  | -                                   | -   |
| Swap-Kontrakte             | -                                   | -   | -                                   | -   | (641.328)                           | (4.599.498)   | -                                   | -   |
| US Multi Cap Opportunities |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte     | 225.651                             | (630.018)   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| US Real Estate Securities  |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte     | (421.811)                           | (942.444)   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

|                              | Wechselkursrisiko                   |   | Zinsrisiko                          |   | Eigenkapitalrisiko                  |   | Kreditrisiko                        |   |
|------------------------------|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|-------------------------------------|---|
|                              | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) | Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) |
| US Small Cap                 |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte       | (13.823)                            | (102.532)   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |
| US Small Cap Intrinsic Value |                                     |   |                                     |   |                                     |   |                                     |   |
| Devisenterminkontrakte       | -                                   | (398)   | -                                   | -   | -                                   | -   | -                                   | -   |

\* Der Teilfonds wurde während des aktuellen oder vorherigen Berichtsjahres aufgelöst.

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

**FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR****25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)****Bedingte Merkmale in Bezug auf das Kreditrisiko**

Die derivativen Kontrakte der Teilfonds unterliegen dem International Swaps and Derivatives Association Master Agreement (ISDA), das bestimmte Verpflichtungen und andere Bestimmungen enthält, wonach der Fonds möglicherweise zusätzliche Sicherheiten für Derivate stellen oder diese Kontrakte kündigen muss, wenn der Fonds nicht über eine ausreichende Anlagedeckung (Asset Coverage) für seine Kontrakte verfügt oder sein Nettovermögen um einen festgelegten Prozentsatz oder Betrag sinkt. Die Teilfonds gingen im Rahmen ihrer Anlagestrategien Credit Default Swaps ein, um sich gegen nachteilige Veränderungen im Wert von Anlagen abzusichern und sich vor nachteiligen Änderungen der Zinssätze oder der Kreditperformance von Gegenparteien zu schützen. Der maximale potenzielle Betrag, den die Teilfonds als Verkäufer eines Kreditschutzes eventuell zahlen müssen, wenn ein Kreditereignis eintritt, belief sich zum 31. Dezember 2024 auf 272.519.783 US\$ (31. Dezember 2023: 127.047.007 US\$). Die Summe des Zeitwerts aller Credit Default Swaps in Nettovermögensposition betrug zum 31. Dezember 2024 5.069.085 US\$ (31. Dezember 2023: 3.082.098 US\$). Der Fonds hielt zum 31. Dezember 2024 und zum 31. Dezember 2023 keine derivativen Instrumente mit bedingten Merkmalen in Bezug auf das Kreditrisiko.

**26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN**

Der Manager des Fonds ist ein verbundenes Unternehmen von Neuberger Berman Group LLC, einem bei der SEC in den USA registrierten Anlageberater. Die hierin enthaltenen Informationen spiegeln die den allgemein anerkannten Bilanzierungsgrundsätzen der USA entsprechenden Offenlegungen wider, so dass der Manager von bestimmten Ausnahmen Gebrauch machen kann, die ihm gemäß SEC Custody Rule zur Verfügung stehen.

Finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten werden nur dann saldiert und der Nettobetrag in der Bilanz ausgewiesen, wenn ein Rechtsanspruch besteht, die erfassten Beträge miteinander zu verrechnen und beabsichtigt wird, entweder den Ausgleich auf Nettobasis herbeizuführen oder gleichzeitig mit der Verwertung der betreffenden Vermögenswerte die dazugehörigen Verbindlichkeiten abzulösen.

Im Rahmen der finanziellen Berichterstattung nimmt der Fonds keine Saldierung von derivativen Vermögenswerten und derivativen Verbindlichkeiten in der Bilanz vor. Die folgenden Tabellen zeigen die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten aus außerbörslichen Derivategeschäften (OTC-Derivaten), die Pensions- und umgekehrten Pensionsgeschäfte des Fonds nach Gegenparteien, abzüglich von Beträgen, die im Rahmen eines Master Netting Agreements für eine Saldierung verfügbar sind, und abzüglich der zugehörigen Sicherheiten, die der Fonds zum 31. Dezember 2024 und zum 31. Dezember 2023 für Vermögenswerte erhalten hat und die vom Fonds für Verbindlichkeiten hinterlegt wurden.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Asia Responsible Transition Bond

31. Dezember 2024

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte<br>US\$ | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten<br>US\$ |
|------------------------|--|---|
| Devisenterminkontrakte | 101.004  | (81.996)  |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>101.004</b>   | <b>(81.996)</b>   |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                 | Vermögenswerte   |   |   |                                    | Verbindlichkeiten  |  |   |                                    |
|-----------------------------|--|---|---|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|
|                             | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge<br>US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten<br>US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup><br>US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge<br>US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte<br>US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup><br>US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>US\$ |
| BNP Paribas                 | 2.070  | (148)   | –   | 1.922                              | (148)  | 148  | –   | –                                  |
| Citibank NA                 | 22.310   | (11.034)  | –   | 11.276                             | (11.034)   | 11.034   | –   | –                                  |
| Goldman Sachs International | 12.806   | (12.806)  | –   | –                                  | (24.016)   | 12.806   | –   | (11.210)                           |
| JPMorgan Chase Bank         | 40.269   | (6.840)   | –   | 33.429                             | (6.840)  | 6.840  | –   | –                                  |
| Standard Chartered Bank     | 20.293   | (20.293)  | –   | –                                  | (38.810)   | 20.293   | –   | (18.517)                           |
| UBS AG                      | 3.256  | (1.148)   | –   | 2.108                              | (1.148)  | 1.148  | –   | –                                  |
| <b>Insgesamt</b>            | <b>101.004</b>   | <b>(52.269)</b>                                     | <b>–</b>                                      | <b>48.735</b>                      | <b>(81.996)</b>  | <b>52.269</b>                                    | <b>–</b>  | <b>(29.727)</b>                    |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## Asia Responsible Transition Bond (Fortsetzung)

## 31. Dezember 2023

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte |  | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |  |
|------------------------|--|--|---|--|
|                        | US\$   |  | US\$  |  |
| Devisenterminkontrakte | 127.055  |  | (135.330)   |  |
| OTC-Kontrakt           | 167  |  | –   |  |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>127.222</b>   |  | <b>(135.330)</b>  |  |

## Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                 | Vermögenswerte   |   |                                       |                            | Verbindlichkeiten  |  |   |                            |
|-----------------------------|--|---|---------------------------------------|----------------------------|--|--|---|----------------------------|
|                             | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> | Nettobetrag <sup>(b)</sup> | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> | Nettobetrag <sup>(b)</sup> |
|                             |  |   |                                       |                            |  |  |   |                            |
| BNP Paribas                 | 15.028   | –   | –                                     | 15.028                     | –  | –  | –                                       | –                          |
| Citibank NA                 | 28.364   | (10.417)                                    | –                                     | 17.947                     | (10.417)   | 10.417                                   | –                                       | –                          |
| Goldman Sachs International | 25.702   | –   | –                                     | 25.702                     | –  | –  | –                                       | –                          |
| JPMorgan Chase Bank         | 25.414   | (19.642)                                    | –                                     | 5.772                      | (19.642)   | 19.642                                   | –                                       | –                          |
| Morgan Stanley              | 3.429  | (3.429)                                     | –                                     | –                          | (53.568)   | 3.429                                    | –                                       | (50.139)                   |
| Standard Chartered Bank     | 22.248   | (22.248)                                    | –                                     | –                          | (51.167)   | 22.248                                   | –                                       | (28.919)                   |
| UBS AG                      | 7.037  | (536)                                       | –                                     | 6.501                      | (536)  | 536                                      | –                                       | –                          |
| <b>Insgesamt</b>            | <b>127.222</b>   | <b>(56.272)</b>                             | <b>–</b>                              | <b>70.950</b>              | <b>(135.330)</b>   | <b>56.272</b>                            | <b>–</b>                                | <b>(79.058)</b>            |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

China Bond

31. Dezember 2024

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | CNY  | CNY   |
| Devisenterminkontrakte | 1.649.026  | (1.502.829)   |
| OTC-Kontrakt           | 5.674  | –   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>1.654.700</b>   | <b>(1.502.829)</b>  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei             | Vermögenswerte   |   |   |                                | Verbindlichkeiten  |  |   |                                |
|-------------------------|--|---|---|--------------------------------|--|--|---|--------------------------------|
|                         | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge CNY | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten CNY | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> CNY | Nettobetrag <sup>(b)</sup> CNY | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge CNY | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte CNY | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> CNY | Nettobetrag <sup>(b)</sup> CNY |
| Citibank NA             | –  | –   | –   | –                              | (590.993)  | –  | –   | (590.993)                      |
| JPMorgan Chase Bank     | 1.273.541  | (545.407)                                       | –   | 728.134                        | (545.407)  | 545.407                                      | –   | –                              |
| Standard Chartered Bank | 363.320  | (363.320)                                       | –   | –                              | (366.429)  | 363.320                                      | –   | (3.109)                        |
| UBS AG                  | 17.839   | –   | –   | 17.839                         | –  | –  | –   | –                              |
| <b>Insgesamt</b>        | <b>1.654.700</b>   | <b>(908.727)</b>                                | <b>–</b>                                  | <b>745.973</b>                 | <b>(1.502.829)</b>   | <b>908.727</b>                               | <b>–</b>                                    | <b>(594.102)</b>               |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

China Bond (Fortsetzung)

31. Dezember 2023

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | CNY  | CNY   |
| Devisenterminkontrakte | 1.943.751  | (2.361.945)   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>1.943.751</b>   | <b>(2.361.945)</b>  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei             | Vermögenswerte   |   |   |                                | Verbindlichkeiten  |  |   |                                |
|-------------------------|--|---|---|--------------------------------|--|--|---|--------------------------------|
|                         | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge CNY | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten CNY | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> CNY | Nettobetrag <sup>(b)</sup> CNY | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge CNY | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte CNY | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> CNY | Nettobetrag <sup>(b)</sup> CNY |
| Citibank NA             | 1.917.777  | (333.720)                                       | –   | 1.584.057                      | (333.720)  | 333.720                                      | –   | –                              |
| JPMorgan Chase Bank     | 1.318  | (56)  | –   | 1.262                          | (56)   | 56   | –   | –                              |
| Standard Chartered Bank | 24.656   | (24.656)  | –   | –                              | (209.677)  | 24.656                                       | –   | (185.021)                      |
| UBS AG                  | –  | –   | –   | –                              | (1.818.492)  | –  | –   | (1.818.492)                    |
| <b>Insgesamt</b>        | <b>1.943.751</b>   | <b>(358.432)</b>                                | <b>–</b>                                  | <b>1.585.319</b>               | <b>(2.361.945)</b>   | <b>358.432</b>                               | <b>–</b>                                    | <b>(2.003.513)</b>             |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

China Equity

31. Dezember 2024

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte |  | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |  |
|------------------------|--|--|---|--|
|                        | US\$   |  | US\$  |  |
| Devisenterminkontrakte | 685.905  |  | (866.976)   |  |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>685.905</b>   |  | <b>(866.976)</b>  |  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                 | Vermögenswerte  |  |  |                                 | Verbindlichkeiten   |   |  |                                 |
|-----------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
|                             | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ |
| Goldman Sachs International | 9.083   | (9.083)  | –  | –                               | (9.271)   | 9.083   | –  | (188)                           |
| UBS AG                      | 422.895   | (422.895)  | –  | –                               | (557.299)   | 422.895                                       | –  | (134.404)                       |
| Westpac Banking Corp        | 253.927   | (253.927)  | –  | –                               | (300.406)   | 253.927                                       | –  | (46.479)                        |
| <b>Insgesamt</b>            | <b>685.905</b>  | <b>(685.905)</b>                                 | <b>–</b>                                   | <b>–</b>                        | <b>(866.976)</b>  | <b>685.905</b>                                | <b>–</b>                                     | <b>(181.071)</b>                |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

China Equity (Fortsetzung)

31. Dezember 2023

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 547.220  | (423.344)   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>547.220</b>   | <b>(423.344)</b>  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                 | Vermögenswerte   |   |                                       |                            | Verbindlichkeiten  |  |   |                            |
|-----------------------------|--|---|---------------------------------------|----------------------------|--|--|---|----------------------------|
|                             | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> | Nettobetrag <sup>(b)</sup> | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> | Nettobetrag <sup>(b)</sup> |
|                             |  |   |                                       |                            |  |  |   |                            |
| Goldman Sachs International | 185.443  | (149.854)                                   | –                                     | 35.589                     | (149.854)  | 149.854                                  | –                                       | –                          |
| UBS AG                      | 166.978  | (129.390)                                   | –                                     | 37.588                     | (129.390)  | 129.390                                  | –                                       | –                          |
| Westpac Banking Corp        | 194.799  | (144.100)                                   | –                                     | 50.699                     | (144.100)  | 144.100                                  | –                                       | –                          |
| <b>Insgesamt</b>            | <b>547.220</b>   | <b>(423.344)</b>                            | <b>–</b>                              | <b>123.876</b>             | <b>(423.344)</b>   | <b>423.344</b>                           | <b>–</b>                                | <b>–</b>                   |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

CLO Income

31. Dezember 2024

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte |  | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |  |
|------------------------|--|--|---|--|
|                        | US\$   |  | US\$  |  |
| Devisenterminkontrakte | 28.699.677   |  | (8.100.316)   |  |
| OTC-Kontrakt           | –  |  | (194.289)   |  |
| Pensionsgeschäfte      | 84.500.000   |  | –   |  |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>113.199.677</b>   |  | <b>(8.294.605)</b>  |  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                    | Vermögenswerte  |  |  |                                 | Verbindlichkeiten   |   |  |                                 |
|--------------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
|                                | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ |
| Citibank NA                    | 810.508   | –  | –  | 810.508                         | –   | –   | –  | –                               |
| Goldman Sachs International    | 150.234   | (150.234)  | –  | –                               | (158.231)   | 150.234                                       | –  | (7.997)                         |
| JPMorgan Chase Bank            | –   | –  | –  | –                               | (142.724)   | –   | 142.724                                      | –                               |
| State Street Bank and Trust Co | 110.394.704   | (1.202.498)                                      | (86.190.114)                               | 23.002.092                      | (1.202.498)   | 1.202.498                                     | –  | –                               |
| UBS AG                         | –   | –  | –  | –                               | (5.597.214)   | –   | –  | (5.597.214)                     |
| Westpac Banking Corp           | 1.844.231   | (1.193.938)                                      | –  | 650.293                         | (1.193.938)   | 1.193.938                                     | –  | –                               |
| <b>Insgesamt</b>               | <b>113.199.677</b>  | <b>(2.546.670)</b>                               | <b>(86.190.114)</b>                        | <b>24.462.893</b>               | <b>(8.294.605)</b>  | <b>2.546.670</b>                              | <b>142.724</b>                               | <b>(5.605.211)</b>              |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

CLO Income (Fortsetzung)

31. Dezember 2023

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 2.345.289  | (2.570.754)   |
| OTC-Kontrakt           | 48.732   | –   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>2.394.021</b>   | <b>(2.570.754)</b>  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                    | Vermögenswerte   |   |   |                                    | Verbindlichkeiten  |  |   |                                    |
|--------------------------------|--|---|---|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|
|                                | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge<br>US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten<br>US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup><br>US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge<br>US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte<br>US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup><br>US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>US\$ |
| Goldman Sachs International    | 175.123  | (7.243)   | –   | 167.880                            | (7.243)  | 7.243  | –   | –                                  |
| State Street Bank and Trust Co | 337.885  | (337.885)   | –   | –                                  | (1.885.494)  | 337.885  | –   | (1.547.609)                        |
| UBS AG                         | 353.824  | (343.797)   | –   | 10.027                             | (343.797)  | 343.797  | –   | –                                  |
| Westpac Banking Corp           | 1.527.189  | (334.220)   | –   | 1.192.969                          | (334.220)  | 334.220  | –   | –                                  |
| <b>Insgesamt</b>               | <b>2.394.021</b>   | <b>(1.023.145)</b>                                  | <b>–</b>                                      | <b>1.370.876</b>                   | <b>(2.570.754)</b>   | <b>1.023.145</b>                                 | <b>–</b>  | <b>(1.547.609)</b>                 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Commodities

31. Dezember 2024

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 329.265  | (1.617.307)   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>329.265</b>   | <b>(1.617.307)</b>  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                    | Vermögenswerte  |  |  |                                 | Verbindlichkeiten   |   |  |                                 |
|--------------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
|                                | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ |
| Standard Chartered Bank        | 29.296  | (7.813)  | –  | 21.483                          | (7.813)   | 7.813   | –  | –                               |
| State Street Bank and Trust Co | 81.753  | (81.753)   | –  | –                               | (1.512.260)   | 81.753  | –  | (1.430.507)                     |
| Westpac Banking Corp           | 218.216   | (97.234)   | –  | 120.982                         | (97.234)  | 97.234  | –  | –                               |
| <b>Insgesamt</b>               | <b>329.265</b>  | <b>(186.800)</b>                                 | <b>–</b>                                   | <b>142.465</b>                  | <b>(1.617.307)</b>  | <b>186.800</b>                                | <b>–</b>                                     | <b>(1.430.507)</b>              |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Commodities (Fortsetzung)

31. Dezember 2023

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 1.573.388  | (210.126)   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>1.573.388</b>   | <b>(210.126)</b>  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                    | Vermögenswerte  |  |  |                                 | Verbindlichkeiten   |   |  |                                 |
|--------------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
|                                | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ |
| Standard Chartered Bank        | 1.405.179   | (54.235)   | –  | 1.350.944                       | (54.235)  | 54.235  | –  | –                               |
| State Street Bank and Trust Co | 42.435  | (14.392)   | –  | 28.043                          | (14.392)  | 14.392  | –  | –                               |
| Westpac Banking Corp           | 125.774   | (125.774)  | –  | –                               | (141.499)   | 125.774                                       | –  | (15.725)                        |
| <b>Insgesamt</b>               | <b>1.573.388</b>  | <b>(194.401)</b>                                 | <b>–</b>                                   | <b>1.378.987</b>                | <b>(210.126)</b>  | <b>194.401</b>                                | <b>–</b>                                     | <b>(15.725)</b>                 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Corporate Hybrid Bond

31. Dezember 2024

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | EUR  | EUR   |
| Devisenterminkontrakte | 19.233.303   | (27.715.188)  |
| Pensionsgeschäfte      | 14.002.897   | –   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>33.236.200</b>  | <b>(27.715.188)</b>   |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                    | Vermögenswerte   |   |   |                                | Verbindlichkeiten  |  |   |                                |
|--------------------------------|--|---|---|--------------------------------|--|--|---|--------------------------------|
|                                | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten EUR | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> EUR | Nettobetrag <sup>(b)</sup> EUR | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte EUR | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> EUR | Nettobetrag <sup>(b)</sup> EUR |
| Goldman Sachs International    | 15.710.758   | (1.360.226)                                     | –   | 14.350.532                     | (1.360.226)  | 1.360.226                                    | –   | –                              |
| State Street Bank and Trust Co | 14.002.897   | –   | (14.002.897)                              | –                              | –  | –  | –   | –                              |
| UBS AG                         | 17.266   | (17.266)  | –   | –                              | (19.884.345)   | 17.266                                       | –   | (19.867.079)                   |
| Westpac Banking Corp           | 3.505.279  | (3.505.279)                                     | –   | –                              | (6.470.617)  | 3.505.279                                    | –   | (2.965.338)                    |
| <b>Insgesamt</b>               | <b>33.236.200</b>  | <b>(4.882.771)</b>                              | <b>(14.002.897)</b>                       | <b>14.350.532</b>              | <b>(27.715.188)</b>  | <b>4.882.771</b>                             | <b>–</b>                                    | <b>(22.832.417)</b>            |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

31. Dezember 2023

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | EUR  | EUR   |
| Devisenterminkontrakte | 12.101.176   | (7.732.130)   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>12.101.176</b>  | <b>(7.732.130)</b>  |

## Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                 | Vermögenswerte   |   |   |                                | Verbindlichkeiten  |  |   |                                |
|-----------------------------|--|---|---|--------------------------------|--|--|---|--------------------------------|
|                             | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten EUR | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> EUR | Nettobetrag <sup>(b)</sup> EUR | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte EUR | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> EUR | Nettobetrag <sup>(b)</sup> EUR |
| Goldman Sachs International | 360.537  | (360.537)                                       | –   | –                              | (659.450)  | 360.537                                      | –   | (298.913)                      |
| UBS AG                      | 601.277  | (601.277)                                       | –   | –                              | (6.754.447)  | 601.277                                      | –   | (6.153.170)                    |
| Westpac Banking Corp        | 11.139.362   | (318.233)                                       | –   | 10.821.129                     | (318.233)  | 318.233                                      | –   | –                              |
| <b>Insgesamt</b>            | <b>12.101.176</b>  | <b>(1.280.047)</b>                              | <b>–</b>                                  | <b>10.821.129</b>              | <b>(7.732.130)</b>   | <b>1.280.047</b>                             | <b>–</b>                                    | <b>(6.452.083)</b>             |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Developed Market FMP – 2027<sup>1</sup>

31. Dezember 2024

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 619  | (69.447)  |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>619</b>   | <b>(69.447)</b>   |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                 | Vermögenswerte   |   |                                       |                            | Verbindlichkeiten  |  |   |                            |
|-----------------------------|--|---|---------------------------------------|----------------------------|--|--|---|----------------------------|
|                             | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> | Nettobetrag <sup>(b)</sup> | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> | Nettobetrag <sup>(b)</sup> |
|                             |  |   |                                       |                            |  |  |   |                            |
| Goldman Sachs International | –  | –   | –                                     | –                          | (654)  | –  | –                                       | (654)                      |
| UBS AG                      | 364  | –   | –                                     | 364                        | –  | –  | –                                       | –                          |
| Westpac Banking Corp        | 255  | (255)                                       | –                                     | –                          | (68.793)   | 255                                      | –                                       | (68.538)                   |
| <b>Insgesamt</b>            | <b>619</b>   | <b>(255)</b>                                | <b>–</b>                              | <b>364</b>                 | <b>(69.447)</b>  | <b>255</b>                               | <b>–</b>                                | <b>(69.192)</b>            |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Developed Market FMP – 2027<sup>1</sup> (Fortsetzung)

31. Dezember 2023

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 39.869   | (393)   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>39.869</b>  | <b>(393)</b>  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                    | Vermögenswerte   |   |   |                                    | Verbindlichkeiten  |  |   |                                    |
|--------------------------------|--|---|---|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|
|                                | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge<br>US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten<br>US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup><br>US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge<br>US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte<br>US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup><br>US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>US\$ |
|                                |  |   |   |                                    |  |  |   |                                    |
| Goldman Sachs International    | 145  | (145)   | –   | –                                  | (372)  | 145  | –   | (227)                              |
| State Street Bank and Trust Co | 20.072   | –   | –   | 20.072                             | –  | –  | –   | –                                  |
| UBS AG                         | 19.624   | (21)  | –   | 19.603                             | (21)   | 21   | –   | –                                  |
| Westpac Banking Corp           | 28   | –   | –   | 28                                 | –  | –  | –   | –                                  |
| <b>Insgesamt</b>               | <b>39.869</b>  | <b>(166)</b>  | <b>–</b>                                      | <b>39.703</b>                      | <b>(393)</b>   | <b>166</b>                                       | <b>–</b>  | <b>(227)</b>                       |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

EMD Corporate – Social and Environmental Transition

31. Dezember 2024

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 268.863  | (2.500.151)   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>268.863</b>   | <b>(2.500.151)</b>  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                 | Vermögenswerte  |  |  |                                 | Verbindlichkeiten   |   |  |                                 |
|-----------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
|                             | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ |
| Citibank NA                 | 106.649   | (106.649)  | –  | –                               | (1.630.808)   | 106.649                                       | –  | (1.524.159)                     |
| Goldman Sachs International | 3.598   | (3.598)  | –  | –                               | (14.441)  | 3.598   | –  | (10.843)                        |
| HSBC Bank Plc               | 47.168  | –  | –  | 47.168                          | –   | –   | –  | –                               |
| UBS AG                      | 99.958  | (22.680)   | –  | 77.278                          | (22.680)  | 22.680  | –  | –                               |
| Westpac Banking Corp        | 11.490  | (11.490)   | –  | –                               | (832.222)   | 11.490  | –  | (820.732)                       |
| <b>Insgesamt</b>            | <b>268.863</b>  | <b>(144.417)</b>                                 | <b>–</b>                                   | <b>124.446</b>                  | <b>(2.500.151)</b>  | <b>144.417</b>                                | <b>–</b>                                     | <b>(2.355.734)</b>              |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

EMD Corporate – Social and Environmental Transition (Fortsetzung)

31. Dezember 2023

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 1.906.675  | (235.957)   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>1.906.675</b>   | <b>(235.957)</b>  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                 | Vermögenswerte   |   |   |                                    | Verbindlichkeiten  |  |   |                                    |
|-----------------------------|--|---|---|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|
|                             | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge<br>US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten<br>US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup><br>US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge<br>US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte<br>US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup><br>US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>US\$ |
| Citibank NA                 | 1.408  | (1.408)   | –   | –                                  | (2.055)  | 1.408  | –   | (647)                              |
| Goldman Sachs International | 16.405   | (16.405)  | –   | –                                  | (203.177)  | 16.405   | –   | (186.772)                          |
| HSBC Bank Plc               | –  | –   | –   | –                                  | (27.498)   | –  | –   | (27.498)                           |
| UBS AG                      | 1.856.149  | (3.024)   | –   | 1.853.125                          | (3.024)  | 3.024  | –   | –                                  |
| Westpac Banking Corp        | 32.713   | (203)   | –   | 32.510                             | (203)  | 203  | –   | –                                  |
| <b>Insgesamt</b>            | <b>1.906.675</b>   | <b>(21.040)</b>                                     | <b>–</b>                                      | <b>1.885.635</b>                   | <b>(235.957)</b>   | <b>21.040</b>                                    | <b>–</b>  | <b>(214.917)</b>                   |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt – Hard Currency

31. Dezember 2024

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 9.083.011  | (22.032.237)  |
| Pensionsgeschäfte      | 60.000.000   | –   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>69.083.011</b>  | <b>(22.032.237)</b>   |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                    | Vermögenswerte   |   |                                       |                            | Verbindlichkeiten  |  |   |                            |
|--------------------------------|--|---|---------------------------------------|----------------------------|--|--|---|----------------------------|
|                                | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> | Nettobetrag <sup>(b)</sup> | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> | Nettobetrag <sup>(b)</sup> |
|                                | US\$   | US\$  | US\$                                  | US\$                       | US\$   | US\$                                     | US\$                                    | US\$                       |
| Citibank NA                    | 187  | (187)                                       | –                                     | –                          | (15.456.169)   | 187                                      | –                                       | (15.455.982)               |
| Goldman Sachs International    | 34.507   | (34.507)                                    | –                                     | –                          | (2.056.959)  | 34.507                                   | –                                       | (2.022.452)                |
| HSBC Bank Plc                  | 8.129.493  | –   | (4.740.000)                           | 3.389.493                  | –  | –  | –                                       | –                          |
| State Street Bank and Trust Co | 60.000.000   | –   | (60.000.000)                          | –                          | –  | –  | –                                       | –                          |
| UBS AG                         | 69.321   | (69.321)                                    | –                                     | –                          | (259.005)  | 69.321                                   | –                                       | (189.684)                  |
| Westpac Banking Corp           | 849.503  | (849.503)                                   | –                                     | –                          | (4.260.104)  | 849.503                                  | –                                       | (3.410.601)                |
| <b>Insgesamt</b>               | <b>69.083.011</b>  | <b>(953.518)</b>                            | <b>(64.740.000)</b>                   | <b>3.389.493</b>           | <b>(22.032.237)</b>  | <b>953.518</b>                           | <b>–</b>                                | <b>(21.078.719)</b>        |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt – Hard Currency (Fortsetzung)

31. Dezember 2023

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 24.839.124   | (5.652.118)   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>24.839.124</b>  | <b>(5.652.118)</b>  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                 | Vermögenswerte   |   |   |                                    | Verbindlichkeiten  |  |   |                                    |
|-----------------------------|--|---|---|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|
|                             | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge<br>US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten<br>US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup><br>US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge<br>US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte<br>US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup><br>US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>US\$ |
| Citibank NA                 | 261.317  | (261.317)   | –   | –                                  | (322.041)  | 261.317  | –   | (60.724)                           |
| Deutsche Bank AG            | –  | –   | –   | –                                  | (140.358)  | –  | –   | (140.358)                          |
| Goldman Sachs International | 572.854  | (14.397)  | –   | 558.457                            | (14.397)   | 14.397   | –   | –                                  |
| HSBC Bank Plc               | –  | –   | –   | –                                  | (4.877.290)  | –  | 4.877.290                                       | –                                  |
| UBS AG                      | 20.827.597   | (1.415)   | –   | 20.826.182                         | (1.415)  | 1.415  | –   | –                                  |
| Westpac Banking Corp        | 3.177.356  | (296.617)   | –   | 2.880.739                          | (296.617)  | 296.617  | –   | –                                  |
| <b>Insgesamt</b>            | <b>24.839.124</b>  | <b>(573.746)</b>                                    | <b>–</b>                                      | <b>24.265.378</b>                  | <b>(5.652.118)</b>   | <b>573.746</b>                                   | <b>4.877.290</b>                                | <b>(201.082)</b>                   |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt – Local Currency

31. Dezember 2024

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte<br>US\$ | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten<br>US\$ |
|------------------------|--|---|
| Devisenterminkontrakte | 12.896.398   | (19.531.329)  |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>12.896.398</b>  | <b>(19.531.329)</b>   |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                    | Vermögenswerte   |   |   |                                    | Verbindlichkeiten  |  |   |                                    |
|--------------------------------|--|---|---|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|
|                                | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge<br>US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten<br>US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup><br>US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge<br>US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte<br>US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup><br>US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>US\$ |
| Bank of America Merrill Lynch  | –  | –   | –   | –                                  | (33.718)   | –  | –   | (33.718)                           |
| Barclays Bank Plc              | 208.810  | (208.810)   | –   | –                                  | (1.532.745)  | 208.810  | –   | (1.323.935)                        |
| BNP Paribas                    | 496.838  | (496.838)   | –   | –                                  | (944.060)  | 496.838  | 447.222   | –                                  |
| Citibank NA                    | 801.345  | (801.345)   | –   | –                                  | (2.056.984)  | 801.345  | –   | (1.255.639)                        |
| Deutsche Bank AG               | 917.533  | (476.585)   | (440.948)                                     | –                                  | (476.585)  | 476.585  | –   | –                                  |
| Goldman Sachs International    | 7.357.465  | (6.077.490)   | –   | 1.279.975                          | (6.077.490)  | 6.077.490  | –   | –                                  |
| HSBC Bank Plc                  | 560.290  | (168.855)   | (180.000)                                     | 211.435                            | (168.855)  | 168.855  | –   | –                                  |
| JPMorgan Chase Bank            | 1.660.128  | (529.153)   | (410.000)                                     | 720.975                            | (529.153)  | 529.153  | –   | –                                  |
| Morgan Stanley                 | 2.694  | (2.694)   | –   | –                                  | (6.657.576)  | 2.694  | 6.654.882                                       | –                                  |
| Standard Chartered Bank        | 620.194  | (198.836)   | –   | 421.358                            | (198.836)  | 198.836  | –   | –                                  |
| State Street Bank and Trust Co | 184.722  | (184.722)   | –   | –                                  | (453.686)  | 184.722  | –   | (268.964)                          |
| UBS AG                         | 14.739   | (14.739)  | –   | –                                  | (26.647)   | 14.739   | –   | (11.908)                           |
| Westpac Banking Corp           | 71.640   | (71.640)  | –   | –                                  | (374.994)  | 71.640   | –   | (303.354)                          |
| <b>Insgesamt</b>               | <b>12.896.398</b>  | <b>(9.231.707)</b>                                  | <b>(1.030.948)</b>                            | <b>2.633.743</b>                   | <b>(19.531.329)</b>  | <b>9.231.707</b>                                 | <b>7.102.104</b>                                | <b>(3.197.518)</b>                 |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt – Local Currency (Fortsetzung)

## 31. Dezember 2023

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 17.116.276   | (12.281.584)  |
| OTC-Kontrakt           | 3.085  | (2.136.323)   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>17.119.361</b>  | <b>(14.417.907)</b>   |

## Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                    | Vermögenswerte   |   |                                       |                            | Verbindlichkeiten  |  |   |                            |
|--------------------------------|--|---|---------------------------------------|----------------------------|--|--|---|----------------------------|
|                                | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> | Nettobetrag <sup>(b)</sup> | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> | Nettobetrag <sup>(b)</sup> |
|                                |  |   |                                       |                            |  |  |   |                            |
| Barclays Bank Plc              | 667.762  | (299.724)                                   | (300.000)                             | 68.038                     | (299.724)  | 299.724                                  | –                                       | –                          |
| BNP Paribas                    | –  | –   | –                                     | –                          | (49.809)   | –  | –                                       | (49.809)                   |
| Citibank NA                    | 2.231.444  | (1.759.641)                                 | (230.000)                             | 241.803                    | (1.759.641)  | 1.759.641                                | –                                       | –                          |
| Deutsche Bank AG               | 173.188  | (173.188)                                   | –                                     | –                          | (349.625)  | 173.188                                  | 100.000                                 | (76.437)                   |
| Goldman Sachs International    | 2.999.104  | (2.999.104)                                 | –                                     | –                          | (4.210.723)  | 2.999.104                                | 1.211.619                               | –                          |
| HSBC Bank Plc                  | 965.768  | (568.492)                                   | (397.276)                             | –                          | (568.492)  | 568.492                                  | –                                       | –                          |
| JPMorgan Chase Bank            | 2.252.252  | (1.514.023)                                 | (738.229)                             | –                          | (1.514.023)  | 1.514.023                                | –                                       | –                          |
| Morgan Stanley                 | 630.393  | (470.787)                                   | (120.000)                             | 39.606                     | (470.787)  | 470.787                                  | –                                       | –                          |
| Standard Chartered Bank        | 1.617.740  | (426.665)                                   | (290.000)                             | 901.075                    | (426.665)  | 426.665                                  | –                                       | –                          |
| State Street Bank and Trust Co | 35.221   | (35.221)                                    | –                                     | –                          | (602.118)  | 35.221                                   | 530.000                                 | (36.897)                   |
| UBS AG                         | 646.651  | (153)                                       | –                                     | 646.498                    | (153)  | 153                                      | –                                       | –                          |
| Westpac Banking Corp           | 4.899.838  | (4.166.147)                                 | –                                     | 733.691                    | (4.166.147)  | 4.166.147                                | –                                       | –                          |
| <b>Insgesamt</b>               | <b>17.119.361</b>  | <b>(12.413.145)</b>                         | <b>(2.075.505)</b>                    | <b>2.630.711</b>           | <b>(14.417.907)</b>  | <b>12.413.145</b>                        | <b>1.841.619</b>                        | <b>(163.143)</b>           |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend

31. Dezember 2024

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 3.978.941  | (9.007.086)   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>3.978.941</b>   | <b>(9.007.086)</b>  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                    | Vermögenswerte  |  |  |                                 | Verbindlichkeiten   |   |  |                                 |
|--------------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
|                                | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ |
| Barclays Bank Plc              | 328.377   | (328.377)  | –  | –                               | (450.711)   | 328.377                                       | –  | (122.334)                       |
| BNP Paribas                    | 244.173   | (244.173)  | –  | –                               | (388.580)   | 244.173                                       | 144.407                                      | –                               |
| Citibank NA                    | 586.800   | (586.800)  | –  | –                               | (5.324.517)   | 586.800                                       | –  | (4.737.717)                     |
| Deutsche Bank AG               | 251.576   | (139.023)  | (112.553)                                  | –                               | (139.023)   | 139.023                                       | –  | –                               |
| Goldman Sachs International    | 1.303.601   | (486.657)  | –  | 816.944                         | (486.657)   | 486.657                                       | –  | –                               |
| HSBC Bank Plc                  | 313.916   | (23.273)   | (290.643)                                  | –                               | (23.273)  | 23.273  | –  | –                               |
| JPMorgan Chase Bank            | 713.099   | (175.167)  | (100.000)                                  | 437.932                         | (175.167)   | 175.167                                       | –  | –                               |
| Morgan Stanley                 | 13.278  | (13.278)   | –  | –                               | (1.746.025)   | 13.278  | 1.732.747                                    | –                               |
| Standard Chartered Bank        | 136.375   | (47.549)   | –  | 88.826                          | (47.549)  | 47.549  | –  | –                               |
| State Street Bank and Trust Co | 55.105  | (55.105)   | –  | –                               | (120.774)   | 55.105  | –  | (65.669)                        |
| UBS AG                         | 9.683   | –  | –  | 9.683                           | –   | –   | –  | –                               |
| Westpac Banking Corp           | 22.958  | (22.958)   | –  | –                               | (104.810)   | 22.958  | –  | (81.852)                        |
| <b>Insgesamt</b>               | <b>3.978.941</b>  | <b>(2.122.360)</b>                               | <b>(503.196)</b>                           | <b>1.353.385</b>                | <b>(9.007.086)</b>  | <b>2.122.360</b>                              | <b>1.877.154</b>                             | <b>(5.007.572)</b>              |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

31. Dezember 2023

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 6.637.946  | (2.075.226)   |
| OTC-Kontrakt           | 701  | (627.829)   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>6.638.647</b>   | <b>(2.703.055)</b>  |

## Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                    | Vermögenswerte   |   |                                       |                            | Verbindlichkeiten  |  |   |                            |
|--------------------------------|--|---|---------------------------------------|----------------------------|--|--|---|----------------------------|
|                                | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> | Nettobetrag <sup>(b)</sup> | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> | Nettobetrag <sup>(b)</sup> |
|                                |  |   |                                       |                            |  |  |   |                            |
| Barclays Bank Plc              | 230.287  | (111.942)                                   | –                                     | 118.345                    | (111.942)  | 111.942                                  | –                                       | –                          |
| BNP Paribas                    | 9.403  | (2.582)                                     | –                                     | 6.821                      | (2.582)  | 2.582                                    | –                                       | –                          |
| Brown Brothers Harriman        | –  | –   | –                                     | –                          | (5.632)  | –  | –                                       | (5.632)                    |
| Citibank NA                    | 316.590  | (316.590)                                   | –                                     | –                          | (491.860)  | 316.590                                  | 175.270                                 | –                          |
| Deutsche Bank AG               | 32.343   | –   | –                                     | 32.343                     | –  | –  | –                                       | –                          |
| Goldman Sachs International    | 4.403.030  | (1.112.359)                                 | –                                     | 3.290.671                  | (1.112.359)  | 1.112.359                                | –                                       | –                          |
| HSBC Bank Plc                  | 203.668  | (108.659)                                   | –                                     | 95.009                     | (108.659)  | 108.659                                  | –                                       | –                          |
| JPMorgan Chase Bank            | 165.310  | (165.310)                                   | –                                     | –                          | (264.497)  | 165.310                                  | 99.187                                  | –                          |
| Morgan Stanley                 | 598.073  | (138.351)                                   | (390.000)                             | 69.722                     | (138.351)  | 138.351                                  | –                                       | –                          |
| Standard Chartered Bank        | 387.662  | (274.429)                                   | –                                     | 113.233                    | (274.429)  | 274.429                                  | –                                       | –                          |
| State Street Bank and Trust Co | 14.466   | (14.466)                                    | –                                     | –                          | (128.391)  | 14.466                                   | –                                       | (113.925)                  |
| UBS AG                         | 92.872   | –   | –                                     | 92.872                     | –  | –  | –                                       | –                          |
| Westpac Banking Corp           | 184.943  | (64.353)                                    | –                                     | 120.590                    | (64.353)   | 64.353                                   | –                                       | –                          |
| <b>Insgesamt</b>               | <b>6.638.647</b>   | <b>(2.309.041)</b>                          | <b>(390.000)</b>                      | <b>3.939.606</b>           | <b>(2.703.055)</b>   | <b>2.309.041</b>                         | <b>274.457</b>                          | <b>(119.557)</b>           |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend

31. Dezember 2024

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte<br>US\$ | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten<br>US\$ |
|------------------------|--|---|
| Devisenterminkontrakte | 370.527  | (1.223.159)   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>370.527</b>   | <b>(1.223.159)</b>  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                    | Vermögenswerte   |   |   |                                    | Verbindlichkeiten  |  |   |                                    |
|--------------------------------|--|---|---|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|
|                                | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge<br>US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten<br>US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup><br>US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge<br>US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte<br>US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup><br>US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>US\$ |
| Barclays Bank Plc              | 9.482  | (9.482)   | –   | –                                  | (14.969)   | 9.482  | –   | (5.487)                            |
| BNP Paribas                    | 7.637  | (7.637)   | –   | –                                  | (21.516)   | 7.637  | –   | (13.879)                           |
| Citibank NA                    | 40.174   | (40.174)  | –   | –                                  | (1.121.625)  | 40.174   | –   | (1.081.451)                        |
| Deutsche Bank AG               | 16.647   | (8.181)   | –   | 8.466                              | (8.181)  | 8.181  | –   | –                                  |
| Goldman Sachs International    | 11.055   | (11.055)  | –   | –                                  | (25.672)   | 11.055   | –   | (14.617)                           |
| HSBC Bank Plc                  | 11.178   | (8.467)   | –   | 2.711                              | (8.467)  | 8.467  | –   | –                                  |
| JPMorgan Chase Bank            | 43.081   | (2.155)   | –   | 40.926                             | (2.155)  | 2.155  | –   | –                                  |
| Standard Chartered Bank        | 216.972  | (5.937)   | –   | 211.035                            | (5.937)  | 5.937  | –   | –                                  |
| State Street Bank and Trust Co | 14.301   | (14.301)  | –   | –                                  | (14.357)   | 14.301   | –   | (56)                               |
| Westpac Banking Corp           | –  | –   | –   | –                                  | (280)  | –  | –   | (280)                              |
| <b>Insgesamt</b>               | <b>370.527</b>   | <b>(107.389)</b>                                    | <b>–</b>                                      | <b>263.138</b>                     | <b>(1.223.159)</b>   | <b>107.389</b>                                   | <b>–</b>  | <b>(1.115.770)</b>                 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend (Fortsetzung)

31. Dezember 2023

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 2.325.031  | (284.238)   |
| OTC-Kontrakt           | 57   | –   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>2.325.088</b>   | <b>(284.238)</b>  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                    | Vermögenswerte  |  |  |                                 | Verbindlichkeiten   |   |  |                                 |
|--------------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
|                                | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ |
| Barclays Bank Plc              | 17.042  | (8.742)  | –  | 8.300                           | (8.742)   | 8.742   | –  | –                               |
| BNP Paribas                    | 359.821   | –  | –  | 359.821                         | –   | –   | –  | –                               |
| Citibank NA                    | 24.963  | (23.177)   | –  | 1.786                           | (23.177)  | 23.177  | –  | –                               |
| Deutsche Bank AG               | 2.346   | (2.058)  | –  | 288                             | (2.058)   | 2.058   | –  | –                               |
| Goldman Sachs International    | 15.848  | (15.848)   | –  | –                               | (34.123)  | 15.848  | –  | (18.275)                        |
| HSBC Bank Plc                  | 17.027  | (8.071)  | –  | 8.956                           | (8.071)   | 8.071   | –  | –                               |
| JPMorgan Chase Bank            | 15.993  | (7.035)  | –  | 8.958                           | (7.035)   | 7.035   | –  | –                               |
| Morgan Stanley                 | 6.332   | (5.193)  | –  | 1.139                           | (5.193)   | 5.193   | –  | –                               |
| Standard Chartered Bank        | 29.241  | (29.241)   | –  | –                               | (159.276)   | 29.241  | –  | (130.035)                       |
| State Street Bank and Trust Co | 32.234  | (13.021)   | –  | 19.213                          | (13.021)  | 13.021  | –  | –                               |
| Westpac Banking Corp           | 1.804.241   | (23.542)   | –  | 1.780.699                       | (23.542)  | 23.542  | –  | –                               |
| <b>Insgesamt</b>               | <b>2.325.088</b>  | <b>(135.928)</b>                                 | <b>–</b>                                   | <b>2.189.160</b>                | <b>(284.238)</b>  | <b>135.928</b>                                | <b>–</b>                                     | <b>(148.310)</b>                |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Emerging Markets Equity

31. Dezember 2024

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 874.873  | (1.965.401)   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>874.873</b>   | <b>(1.965.401)</b>  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                 | Vermögenswerte  |  |  |                                 | Verbindlichkeiten   |   |  |                                 |
|-----------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
|                             | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ |
| Goldman Sachs International | 148.227   | (148.227)  | –  | –                               | (872.769)   | 148.227                                       | –  | (724.542)                       |
| Royal Bank of Canada        | 27.526  | (2.238)  | –  | 25.288                          | (2.238)   | 2.238   | –  | –                               |
| UBS AG                      | 358.088   | (358.088)  | –  | –                               | (992.934)   | 358.088                                       | –  | (634.846)                       |
| Westpac Banking Corp        | 341.032   | (97.460)   | –  | 243.572                         | (97.460)  | 97.460  | –  | –                               |
| <b>Insgesamt</b>            | <b>874.873</b>  | <b>(606.013)</b>                                 | <b>–</b>                                   | <b>268.860</b>                  | <b>(1.965.401)</b>  | <b>606.013</b>                                | <b>–</b>                                     | <b>(1.359.388)</b>              |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Emerging Markets Equity (Fortsetzung)

31. Dezember 2023

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 1.272.409  | (787.152)   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>1.272.409</b>   | <b>(787.152)</b>  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                 | Vermögenswerte  |  |  |                                 | Verbindlichkeiten   |   |  |                                 |
|-----------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
|                             | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ |
| Goldman Sachs International | 220.656   | (110.722)  | –  | 109.934                         | (110.722)   | 110.722                                       | –  | –                               |
| Royal Bank of Canada        | 11.819  | (11.819)   | –  | –                               | (20.649)  | 11.819  | –  | (8.830)                         |
| UBS AG                      | 370.440   | (79.813)   | –  | 290.627                         | (79.813)  | 79.813  | –  | –                               |
| Westpac Banking Corp        | 669.494   | (575.968)  | –  | 93.526                          | (575.968)   | 575.968                                       | –  | –                               |
| <b>Insgesamt</b>            | <b>1.272.409</b>  | <b>(778.322)</b>                                 | <b>–</b>                                   | <b>494.087</b>                  | <b>(787.152)</b>  | <b>778.322</b>                                | <b>–</b>                                     | <b>(8.830)</b>                  |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Euro Bond Absolute Return

31. Dezember 2024

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | EUR  | EUR   |
| Devisenterminkontrakte | 1.998.238  | (172.800)   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>1.998.238</b>   | <b>(172.800)</b>  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                    | Vermögenswerte   |   |   |                                | Verbindlichkeiten  |  |   |                                |
|--------------------------------|--|---|---|--------------------------------|--|--|---|--------------------------------|
|                                | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten EUR | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> EUR | Nettobetrag <sup>(b)</sup> EUR | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte EUR | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> EUR | Nettobetrag <sup>(b)</sup> EUR |
| BNP Paribas                    | 19.242   | (19.242)  | –   | –                              | (20.912)   | 19.242                                       | –   | (1.670)                        |
| Citibank NA                    | 6.444  | (6.444)   | –   | –                              | (24.377)   | 6.444  | –   | (17.933)                       |
| Deutsche Bank AG               | 3.300  | (3.300)   | –   | –                              | (10.994)   | 3.300  | –   | (7.694)                        |
| Goldman Sachs International    | 1.925.520  | (11.605)  | –   | 1.913.915                      | (11.605)   | 11.605                                       | –   | –                              |
| JPMorgan Chase Bank            | 4.203  | (456)   | –   | 3.747                          | (456)  | 456  | –   | –                              |
| Standard Chartered Bank        | 62   | (62)  | –   | –                              | (78.498)   | 62   | –   | (78.436)                       |
| State Street Bank and Trust Co | 4.445  | (4.445)   | –   | –                              | (5.510)  | 4.445  | –   | (1.065)                        |
| Westpac Banking Corp           | 35.022   | (20.448)  | –   | 14.574                         | (20.448)   | 20.448                                       | –   | –                              |
| <b>Insgesamt</b>               | <b>1.998.238</b>   | <b>(66.002)</b>                                 | <b>–</b>                                  | <b>1.932.236</b>               | <b>(172.800)</b>   | <b>66.002</b>                                | <b>–</b>                                    | <b>(106.798)</b>               |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## Euro Bond Absolute Return (Fortsetzung)

## 31. Dezember 2023

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | EUR  | EUR   |
| Devisenterminkontrakte | 25.383   | (1.117.757)   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>25.383</b>  | <b>(1.117.757)</b>  |

## Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                    | Vermögenswerte   |   |   |                                | Verbindlichkeiten  |  |   |                                |
|--------------------------------|--|---|---|--------------------------------|--|--|---|--------------------------------|
|                                | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten EUR | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> EUR | Nettobetrag <sup>(b)</sup> EUR | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte EUR | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> EUR | Nettobetrag <sup>(b)</sup> EUR |
| BNP Paribas                    | 864  | (864)   | –   | –                              | (512.453)  | 864  | –   | (511.589)                      |
| Goldman Sachs International    | –  | –   | –   | –                              | (30.722)   | –  | –   | (30.722)                       |
| Standard Chartered Bank        | 2.193  | (2.193)   | –   | –                              | (32.886)   | 2.193  | –   | (30.693)                       |
| State Street Bank and Trust Co | 178  | (178)   | –   | –                              | (14.181)   | 178  | –   | (14.003)                       |
| Westpac Banking Corp           | 22.148   | (22.148)  | –   | –                              | (527.515)  | 22.148                                       | –   | (505.367)                      |
| <b>Insgesamt</b>               | <b>25.383</b>  | <b>(25.383)</b>                                 | <b>–</b>                                  | <b>–</b>                       | <b>(1.117.757)</b>   | <b>25.383</b>                                | <b>–</b>                                    | <b>(1.092.374)</b>             |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

European High Yield Bond

31. Dezember 2024

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | EUR  | EUR   |
| Devisenterminkontrakte | 2.677.489  | (2.086.588)   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>2.677.489</b>   | <b>(2.086.588)</b>  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                 | Vermögenswerte   |   |   |                                | Verbindlichkeiten  |  |   |                                |
|-----------------------------|--|---|---|--------------------------------|--|--|---|--------------------------------|
|                             | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten EUR | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> EUR | Nettobetrag <sup>(b)</sup> EUR | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte EUR | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> EUR | Nettobetrag <sup>(b)</sup> EUR |
| Goldman Sachs International | 2.435.104  | (930.441)                                       | –   | 1.504.663                      | (930.441)  | 930.441                                      | –   | –                              |
| UBS AG                      | –  | –   | –   | –                              | (1.092.535)  | –  | –   | (1.092.535)                    |
| Westpac Banking Corp        | 242.385  | (63.612)  | –   | 178.773                        | (63.612)   | 63.612                                       | –   | –                              |
| <b>Insgesamt</b>            | <b>2.677.489</b>   | <b>(994.053)</b>                                | <b>–</b>                                  | <b>1.683.436</b>               | <b>(2.086.588)</b>   | <b>994.053</b>                               | <b>–</b>                                    | <b>(1.092.535)</b>             |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

European High Yield Bond (Fortsetzung)

31. Dezember 2023

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | EUR  | EUR   |
| Devisenterminkontrakte | 643.091  | (1.281.452)   |
| OTC-Kontrakt           | 18.355   | –   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>661.446</b>   | <b>(1.281.452)</b>  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                 | Vermögenswerte   |   |                                       |                            | Verbindlichkeiten  |  |   |                            |
|-----------------------------|--|---|---------------------------------------|----------------------------|--|--|---|----------------------------|
|                             | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> | Nettobetrag <sup>(b)</sup> | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> | Nettobetrag <sup>(b)</sup> |
|                             |  |   |                                       |                            |  |  |   |                            |
| Goldman Sachs International | 23.074   | (19.823)                                    | –                                     | 3.251                      | (19.823)   | 19.823                                   | –                                       | –                          |
| UBS AG                      | 596.607  | (596.607)                                   | –                                     | –                          | (1.014.198)  | 596.607                                  | –                                       | (417.591)                  |
| Westpac Banking Corp        | 41.765   | (41.765)                                    | –                                     | –                          | (247.431)  | 41.765                                   | –                                       | (205.666)                  |
| <b>Insgesamt</b>            | <b>661.446</b>   | <b>(658.195)</b>                            | <b>–</b>                              | <b>3.251</b>               | <b>(1.281.452)</b>   | <b>658.195</b>                           | <b>–</b>                                | <b>(623.257)</b>           |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Event Driven

31. Dezember 2024

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 136.424  | (10.107.971)  |
| OTC-Kontrakt           | 139.204  | (527.124)   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>275.628</b>   | <b>(10.635.095)</b>   |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                    | Vermögenswerte  |  |  |                                 | Verbindlichkeiten   |   |  |                                 |
|--------------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
|                                | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ |
| Morgan Stanley                 | 139.204   | (139.204)  | –  | –                               | (527.124)   | 139.204                                       | –  | (387.920)                       |
| State Street Bank and Trust Co | 77.161  | (77.161)   | –  | –                               | (8.231.141)   | 77.161  | –  | (8.153.980)                     |
| Westpac Banking Corp           | 59.263  | (59.263)   | –  | –                               | (1.876.830)   | 59.263  | –  | (1.817.567)                     |
| <b>Insgesamt</b>               | <b>275.628</b>  | <b>(275.628)</b>                                 | <b>–</b>                                   | <b>–</b>                        | <b>(10.635.095)</b>   | <b>275.628</b>                                | <b>–</b>                                     | <b>(10.359.467)</b>             |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Event Driven (Fortsetzung)

31. Dezember 2023

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 4.057.943  | (155.365)   |
| OTC-Kontrakt           | 959.529  | –   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>5.017.472</b>   | <b>(155.365)</b>  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                    | Vermögenswerte  |  |  |                                 | Verbindlichkeiten   |   |  |                                 |
|--------------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
|                                | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ |
| Morgan Stanley                 | 959.529   | –  | –  | 959.529                         | –   | –   | –  | –                               |
| State Street Bank and Trust Co | 3.752.797   | (6)  | –  | 3.752.791                       | (6)   | 6   | –  | –                               |
| Westpac Banking Corp           | 305.146   | (155.359)  | –  | 149.787                         | (155.359)   | 155.359                                       | –  | –                               |
| <b>Insgesamt</b>               | <b>5.017.472</b>  | <b>(155.365)</b>                                 | <b>–</b>                                   | <b>4.862.107</b>                | <b>(155.365)</b>  | <b>155.365</b>                                | <b>–</b>                                     | <b>–</b>                        |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Bond

31. Dezember 2024

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 4.327.396  | (4.564.309)   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>4.327.396</b>   | <b>(4.564.309)</b>  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                        | Vermögenswerte  |  |  |                                 | Verbindlichkeiten   |   |  |                                 |
|------------------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
|                                    | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ |
| BNP Paribas                        | 567.088   | (567.088)  | –  | –                               | (751.385)   | 567.088                                       | –  | (184.297)                       |
| Canadian Imperial Bank of Commerce | 84.783  | (84.783)   | –  | –                               | (714.443)   | 84.783  | –  | (629.660)                       |
| Citibank NA                        | 322.415   | (97.701)   | –  | 224.714                         | (97.701)  | 97.701  | –  | –                               |
| Deutsche Bank AG                   | 67.839  | –  | –  | 67.839                          | –   | –   | –  | –                               |
| Goldman Sachs International        | 596.817   | (492.926)  | –  | 103.891                         | (492.926)   | 492.926                                       | –  | –                               |
| Royal Bank of Canada               | 601.088   | (198.554)  | –  | 402.534                         | (198.554)   | 198.554                                       | –  | –                               |
| Standard Chartered Bank            | 53.200  | (53.200)   | –  | –                               | (279.216)   | 53.200  | –  | (226.016)                       |
| State Street Bank and Trust Co     | 1.268.842   | (1.052.276)                                      | –  | 216.566                         | (1.052.276)   | 1.052.276                                     | –  | –                               |
| UBS AG                             | 360.418   | (342.138)  | –  | 18.280                          | (342.138)   | 342.138                                       | –  | –                               |
| Westpac Banking Corp               | 404.906   | (404.906)  | –  | –                               | (635.670)   | 404.906                                       | –  | (230.764)                       |
| <b>Insgesamt</b>                   | <b>4.327.396</b>  | <b>(3.293.572)</b>                               | <b>–</b>                                   | <b>1.033.824</b>                | <b>(4.564.309)</b>  | <b>3.293.572</b>                              | <b>–</b>                                     | <b>(1.270.737)</b>              |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## Global Bond (Fortsetzung)

## 31. Dezember 2023

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 3.337.129  | (3.195.228)   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>3.337.129</b>   | <b>(3.195.228)</b>  |

## Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

## Vermögenswerte

## Verbindlichkeiten

| Gegenpartei                        | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> | Nettobetrag <sup>(b)</sup> | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> | Nettobetrag <sup>(b)</sup> |
|------------------------------------|--|---|---------------------------------------|----------------------------|--|--|---|----------------------------|
|                                    | US\$   | US\$  | US\$                                  | US\$                       | US\$   | US\$                                     | US\$                                    | US\$                       |
| BNP Paribas                        | 460.011  | (460.011)                                   | –                                     | –                          | (688.009)  | 460.011                                  | –                                       | (227.998)                  |
| Canadian Imperial Bank of Commerce | 28.969   | –   | –                                     | 28.969                     | –  | –  | –                                       | –                          |
| Citibank NA                        | –  | –   | –                                     | –                          | (498)  | –  | –                                       | (498)                      |
| Deutsche Bank AG                   | 39.583   | (18.794)                                    | –                                     | 20.789                     | (18.794)   | 18.794                                   | –                                       | –                          |
| Goldman Sachs International        | 840.078  | (800.823)                                   | –                                     | 39.255                     | (800.823)  | 800.823                                  | –                                       | –                          |
| Royal Bank of Canada               | 327.646  | (21.429)                                    | –                                     | 306.217                    | (21.429)   | 21.429                                   | –                                       | –                          |
| Société Générale                   | 207.886  | (207.886)                                   | –                                     | –                          | (271.737)  | 207.886                                  | –                                       | (63.851)                   |
| Standard Chartered Bank            | 445.291  | (322.164)                                   | –                                     | 123.127                    | (322.164)  | 322.164                                  | –                                       | –                          |
| State Street Bank and Trust Co     | 430.936  | (417.433)                                   | –                                     | 13.503                     | (417.433)  | 417.433                                  | –                                       | –                          |
| UBS AG                             | 291.560  | (291.560)                                   | –                                     | –                          | (456.074)  | 291.560                                  | –                                       | (164.514)                  |
| Westpac Banking Corp               | 265.169  | (198.267)                                   | –                                     | 66.902                     | (198.267)  | 198.267                                  | –                                       | –                          |
| <b>Insgesamt</b>                   | <b>3.337.129</b>   | <b>(2.738.367)</b>                          | <b>–</b>                              | <b>598.762</b>             | <b>(3.195.228)</b>   | <b>2.738.367</b>                         | <b>–</b>                                | <b>(456.861)</b>           |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Diversified Income FMP – 2024\*

31. Dezember 2024

Keine zur Saldierung verfügbaren Vermögenswerte und Verbindlichkeiten aus OTC-Derivaten.

31. Dezember 2023

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 281.732  | –   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>281.732</b>   | <b>–</b>  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei          | Vermögenswerte  |  |  |                                 | Verbindlichkeiten   |   |  |                                 |
|----------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
|                      | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ |
| UBS AG               | 181.693   | –  | –  | 181.693                         | –   | –   | –  | –                               |
| Westpac Banking Corp | 100.039   | –  | –  | 100.039                         | –   | –   | –  | –                               |
| <b>Insgesamt</b>     | <b>281.732</b>  | <b>–</b>   | <b>–</b>                                   | <b>281.732</b>                  | <b>–</b>  | <b>–</b>                                      | <b>–</b>                                     | <b>–</b>                        |

\* Das Portfolio wurde am 28. Juni 2024 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Equity Megatrends

31. Dezember 2024

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 33.919   | (249.051)   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>33.919</b>  | <b>(249.051)</b>  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                    | Vermögenswerte   |   |                                       |                            | Verbindlichkeiten  |  |   |                            |
|--------------------------------|--|---|---------------------------------------|----------------------------|--|--|---|----------------------------|
|                                | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> | Nettobetrag <sup>(b)</sup> | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> | Nettobetrag <sup>(b)</sup> |
|                                | US\$   | US\$  | US\$                                  | US\$                       | US\$   | US\$                                     | US\$                                    | US\$                       |
| Standard Chartered Bank        | 1.009  | (1.009)                                     | –                                     | –                          | (44.410)   | 1.009                                    | –                                       | (43.401)                   |
| State Street Bank and Trust Co | 7.158  | (7.158)                                     | –                                     | –                          | (10.199)   | 7.158                                    | –                                       | (3.041)                    |
| Westpac Banking Corp           | 25.752   | (25.752)                                    | –                                     | –                          | (194.442)  | 25.752                                   | –                                       | (168.690)                  |
| <b>Insgesamt</b>               | <b>33.919</b>  | <b>(33.919)</b>                             | <b>–</b>                              | <b>–</b>                   | <b>(249.051)</b>   | <b>33.919</b>                            | <b>–</b>                                | <b>(215.132)</b>           |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Equity Megatrends (Fortsetzung)

31. Dezember 2023

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 444  | –   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>444</b>   | <b>–</b>  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei          | Vermögenswerte   |   |   |                                    | Verbindlichkeiten  |  |   |                                    |  |
|----------------------|--|---|---|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|--|
|                      | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge<br>US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten<br>US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup><br>US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge<br>US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte<br>US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup><br>US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>US\$ |  |
| Westpac Banking Corp | 444  | –   | –   | 444                                | –  | –  | –   | –                                  |  |
| <b>Insgesamt</b>     | <b>444</b>   | <b>–</b>  | <b>–</b>                                      | <b>444</b>                         | <b>–</b>   | <b>–</b>   | <b>–</b>  | <b>–</b>                           |  |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## Global Flexible Credit Income

## 31. Dezember 2024

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 8.877.042  | (11.858.313)  |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>8.877.042</b>   | <b>(11.858.313)</b>   |

## Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                    | Vermögenswerte  |  |  |                                 | Verbindlichkeiten   |   |  |                                 |
|--------------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
|                                | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ |
| Citibank NA                    | 50.425  | (50.425)   | –  | –                               | (167.614)   | 50.425  | –  | (117.189)                       |
| Goldman Sachs International    | 550   | (550)  | –  | –                               | (536.880)   | 550   | –  | (536.330)                       |
| JPMorgan Chase Bank            | 15.802  | –  | –  | 15.802                          | –   | –   | –  | –                               |
| Royal Bank of Canada           | 1.470.154   | –  | –  | 1.470.154                       | –   | –   | –  | –                               |
| State Street Bank and Trust Co | 6.737.280   | (677.993)  | –  | 6.059.287                       | (677.993)   | 677.993                                       | –  | –                               |
| Westpac Banking Corp           | 602.831   | (602.831)  | –  | –                               | (10.475.826)  | 602.831                                       | –  | (9.872.995)                     |
| <b>Insgesamt</b>               | <b>8.877.042</b>  | <b>(1.331.799)</b>                               | <b>–</b>                                   | <b>7.545.243</b>                | <b>(11.858.313)</b>   | <b>1.331.799</b>                              | <b>–</b>                                     | <b>(10.526.514)</b>             |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Flexible Credit Income (Fortsetzung)

31. Dezember 2023

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 8.130.820  | (3.447.658)   |
| OTC-Kontrakt           | 268.263  | –   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>8.399.083</b>   | <b>(3.447.658)</b>  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                    | Vermögenswerte  |  |  |                                 | Verbindlichkeiten   |   |  |                                 |
|--------------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
|                                | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ |
| Goldman Sachs International    | 112.698   | (112.698)  | –  | –                               | (117.706)   | 112.698                                       | –  | (5.008)                         |
| JPMorgan Chase Bank            | 268.263   | –  | (200.000)                                  | 68.263                          | –   | –   | –  | –                               |
| Royal Bank of Canada           | 214.612   | (214.612)  | –  | –                               | (562.562)   | 214.612                                       | –  | (347.950)                       |
| State Street Bank and Trust Co | 3.658.224   | (2.539.881)                                      | –  | 1.118.343                       | (2.539.881)   | 2.539.881                                     | –  | –                               |
| Westpac Banking Corp           | 4.145.286   | (227.509)  | –  | 3.917.777                       | (227.509)   | 227.509                                       | –  | –                               |
| <b>Insgesamt</b>               | <b>8.399.083</b>  | <b>(3.094.700)</b>                               | <b>(200.000)</b>                           | <b>5.104.383</b>                | <b>(3.447.658)</b>  | <b>3.094.700</b>                              | <b>–</b>                                     | <b>(352.958)</b>                |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## Global High Yield Engagement

31. Dezember 2024

| Beschreibung                 | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------------|--|---|
|                              | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte       | 15.450.103   | (17.319.842)  |
| Pensionsgeschäfte            | 15.500.000   | –   |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | –  | (999.796)   |
| <b>Insgesamt</b>             | <b>30.950.103</b>  | <b>(18.319.638)</b>   |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                    | Vermögenswerte   |   |   |                                    | Verbindlichkeiten  |  |   |                                    |
|--------------------------------|--|---|---|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|
|                                | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge<br>US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten<br>US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup><br>US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge<br>US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte<br>US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup><br>US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>US\$ |
| Bank of America Merrill Lynch  | –  | –   | –   | –                                  | (999.796)  | –  | 999.796   | –                                  |
| Goldman Sachs International    | 205.725  | (169.349)   | –   | 36.376                             | (169.349)  | 169.349  | –   | –                                  |
| State Street Bank and Trust Co | 15.500.000   | –   | (15.500.000)                                  | –                                  | –  | –  | –   | –                                  |
| UBS AG                         | 14.581.582   | (14.581.582)  | –   | –                                  | (16.367.892)   | 14.581.582                                       | –   | (1.786.310)                        |
| Westpac Banking Corp           | 662.796  | (662.796)   | –   | –                                  | (782.601)  | 662.796  | –   | (119.805)                          |
| <b>Insgesamt</b>               | <b>30.950.103</b>  | <b>(15.413.727)</b>                                 | <b>(15.500.000)</b>                           | <b>36.376</b>                      | <b>(18.319.638)</b>  | <b>15.413.727</b>                                | <b>999.796</b>                                  | <b>(1.906.115)</b>                 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global High Yield Engagement (Fortsetzung)

31. Dezember 2023

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 11.935.674   | (6.738.234)   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>11.935.674</b>  | <b>(6.738.234)</b>  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                 | Vermögenswerte   |   |   |                                    | Verbindlichkeiten  |  |   |                                    |
|-----------------------------|--|---|---|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|
|                             | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge<br>US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten<br>US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup><br>US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge<br>US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte<br>US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup><br>US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>US\$ |
| Goldman Sachs International | 131.470  | (131.470)   | –   | –                                  | (166.547)  | 131.470  | –   | (35.077)                           |
| UBS AG                      | 3.486.572  | (3.486.572)   | –   | –                                  | (5.647.348)  | 3.486.572  | –   | (2.160.776)                        |
| Westpac Banking Corp        | 8.317.632  | (924.339)   | –   | 7.393.293                          | (924.339)  | 924.339  | –   | –                                  |
| <b>Insgesamt</b>            | <b>11.935.674</b>  | <b>(4.542.381)</b>                                  | <b>–</b>                                      | <b>7.393.293</b>                   | <b>(6.738.234)</b>   | <b>4.542.381</b>                                 | <b>–</b>  | <b>(2.195.853)</b>                 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Investment Grade Credit

31. Dezember 2024

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 3.851.457  | (3.686.902)   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>3.851.457</b>   | <b>(3.686.902)</b>  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei             | Vermögenswerte  |  |  |                                 | Verbindlichkeiten   |   |  |                                 |
|-------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
|                         | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ |
| Citibank NA             | 243.637   | –  | –  | 243.637                         | –   | –   | –  | –                               |
| JPMorgan Chase Bank     | 124.507   | –  | –  | 124.507                         | –   | –   | –  | –                               |
| Standard Chartered Bank | 366.485   | (38.085)   | –  | 328.400                         | (38.085)  | 38.085  | –  | –                               |
| UBS AG                  | 796.305   | –  | –  | 796.305                         | –   | –   | –  | –                               |
| Westpac Banking Corp    | 2.320.523   | (2.320.523)                                      | –  | –                               | (3.648.817)   | 2.320.523                                     | –  | (1.328.294)                     |
| <b>Insgesamt</b>        | <b>3.851.457</b>  | <b>(2.358.608)</b>                               | <b>–</b>                                   | <b>1.492.849</b>                | <b>(3.686.902)</b>  | <b>2.358.608</b>                              | <b>–</b>                                     | <b>(1.328.294)</b>              |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Investment Grade Credit (Fortsetzung)

31. Dezember 2023

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 1.115  | (1.107.450)   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>1.115</b>   | <b>(1.107.450)</b>  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                    | Vermögenswerte  |  |  |                                 | Verbindlichkeiten   |   |  |                                 |
|--------------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
|                                | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ |
| Standard Chartered Bank        | 1.101   | (191)  | –  | 910                             | (191)   | 191   | –  | –                               |
| State Street Bank and Trust Co | –   | –  | –  | –                               | (314.049)   | –   | –  | (314.049)                       |
| UBS AG                         | –   | –  | –  | –                               | (63.314)  | –   | –  | (63.314)                        |
| Westpac Banking Corp           | 14  | (14)   | –  | –                               | (729.896)   | 14  | –  | (729.882)                       |
| <b>Insgesamt</b>               | <b>1.115</b>  | <b>(205)</b>                                     | <b>–</b>                                   | <b>910</b>                      | <b>(1.107.450)</b>  | <b>205</b>                                    | <b>–</b>                                     | <b>(1.107.245)</b>              |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## Global Opportunistic Bond

## 31. Dezember 2024

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 6.280.307  | (3.105.825)   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>6.280.307</b>   | <b>(3.105.825)</b>  |

## Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                        | Vermögenswerte  |  |  |                                 | Verbindlichkeiten   |   |  |                                 |
|------------------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
|                                    | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ |
| BNP Paribas                        | 340.103   | (340.103)  | –  | –                               | (563.335)   | 340.103                                       | –  | (223.232)                       |
| Canadian Imperial Bank of Commerce | 312.734   | (218.000)  | –  | 94.734                          | (218.000)   | 218.000                                       | –  | –                               |
| Citibank NA                        | 118.102   | (31.399)   | –  | 86.703                          | (31.399)  | 31.399  | –  | –                               |
| Deutsche Bank AG                   | 107.374   | (4.425)  | –  | 102.949                         | (4.425)   | 4.425   | –  | –                               |
| Goldman Sachs International        | 453.828   | (390.635)  | –  | 63.193                          | (390.635)   | 390.635                                       | –  | –                               |
| JPMorgan Chase Bank                | 11  | (11)   | –  | –                               | (2.847)   | 11  | –  | (2.836)                         |
| Royal Bank of Canada               | 781.661   | (142.863)  | –  | 638.798                         | (142.863)   | 142.863                                       | –  | –                               |
| Standard Chartered Bank            | 20.585  | (4.143)  | –  | 16.442                          | (4.143)   | 4.143   | –  | –                               |
| State Street Bank and Trust Co     | 916.498   | (900.241)  | –  | 16.257                          | (900.241)   | 900.241                                       | –  | –                               |
| UBS AG                             | 2.908.518   | (606.187)  | –  | 2.302.331                       | (606.187)   | 606.187                                       | –  | –                               |
| Westpac Banking Corp               | 320.893   | (241.750)  | –  | 79.143                          | (241.750)   | 241.750                                       | –  | –                               |
| <b>Insgesamt</b>                   | <b>6.280.307</b>  | <b>(2.879.757)</b>                               | <b>–</b>                                   | <b>3.400.550</b>                | <b>(3.105.825)</b>  | <b>2.879.757</b>                              | <b>–</b>                                     | <b>(226.068)</b>                |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Opportunistic Bond (Fortsetzung)

31. Dezember 2023

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte<br>US\$ | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten<br>US\$ |
|------------------------|--|---|
| Devisenterminkontrakte | 4.673.609  | (6.577.836)   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>4.673.609</b>   | <b>(6.577.836)</b>  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                    | Vermögenswerte   |   |   |                                    | Verbindlichkeiten  |  |   |                                    |
|--------------------------------|--|---|---|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|
|                                | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge<br>US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten<br>US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup><br>US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge<br>US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte<br>US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup><br>US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>US\$ |
| BNP Paribas                    | 978.221  | (978.221)   | –   | –                                  | (1.289.214)  | 978.221  | –   | (310.993)                          |
| Citibank NA                    | –  | –   | –   | –                                  | (925)  | –  | –   | (925)                              |
| Deutsche Bank AG               | 10.673   | (10.673)  | –   | –                                  | (139.651)  | 10.673   | –   | (128.978)                          |
| Goldman Sachs International    | 1.615.491  | (1.324.027)   | –   | 291.464                            | (1.324.027)  | 1.324.027  | –   | –                                  |
| JPMorgan Chase Bank            | 45.426   | –   | –   | 45.426                             | –  | –  | –   | –                                  |
| Royal Bank of Canada           | 15.527   | (15.527)  | –   | –                                  | (148.425)  | 15.527   | –   | (132.898)                          |
| Société Générale               | 78.724   | (78.724)  | –   | –                                  | (153.133)  | 78.724   | –   | (74.409)                           |
| Standard Chartered Bank        | 308.710  | (308.710)   | –   | –                                  | (541.519)  | 308.710  | –   | (232.809)                          |
| State Street Bank and Trust Co | 660.093  | (660.093)   | –   | –                                  | (1.678.714)  | 660.093  | –   | (1.018.621)                        |
| UBS AG                         | 521.044  | (521.044)   | –   | –                                  | (809.174)  | 521.044  | –   | (288.130)                          |
| Westpac Banking Corp           | 439.700  | (439.700)   | –   | –                                  | (493.054)  | 439.700  | –   | (53.354)                           |
| <b>Insgesamt</b>               | <b>4.673.609</b>   | <b>(4.336.719)</b>                                  | <b>–</b>                                      | <b>336.890</b>                     | <b>(6.577.836)</b>   | <b>4.336.719</b>                                 | <b>–</b>  | <b>(2.241.117)</b>                 |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## Global Real Estate Securities\*

31. Dezember 2024

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte |  | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |  |
|------------------------|--|--|---|--|
|                        | US\$   |  | US\$  |  |
| Devisenterminkontrakte | 7.820  |  | (65.379)  |  |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>7.820</b>   |  | <b>(65.379)</b>   |  |

## Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                 | Vermögenswerte   |   |   |                                    | Verbindlichkeiten  |  |   |                                    |
|-----------------------------|--|---|---|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|
|                             | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge<br>US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten<br>US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup><br>US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge<br>US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte<br>US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup><br>US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>US\$ |
|                             |  |   |   |                                    |  |  |   |                                    |
| Goldman Sachs International | 1.410  | (1.045)   | –   | 365                                | (1.045)  | 1.045  | –   | –                                  |
| UBS AG                      | 3.546  | (2.614)   | –   | 932                                | (2.614)  | 2.614  | –   | –                                  |
| Westpac Banking Corp        | 2.864  | (2.864)   | –   | –                                  | (61.720)   | 2.864  | –   | (58.856)                           |
| <b>Insgesamt</b>            | <b>7.820</b>   | <b>(6.523)</b>                                      | <b>–</b>                                      | <b>1.297</b>                       | <b>(65.379)</b>  | <b>6.523</b>                                     | <b>–</b>  | <b>(58.856)</b>                    |

\* Das Portfolio wurde am 31. Dezember 2024 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Real Estate Securities\* (Fortsetzung)

31. Dezember 2023

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 422.478  | (250.684)   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>422.478</b>   | <b>(250.684)</b>  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                 | Vermögenswerte  |  |  |                                 | Verbindlichkeiten   |   |  |                                 |
|-----------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
|                             | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ |
| Goldman Sachs International | 10.067  | (10.067)   | –  | –                               | (13.728)  | 10.067  | –  | (3.661)                         |
| UBS AG                      | 211.249   | (7.649)  | –  | 203.600                         | (7.649)   | 7.649   | –  | –                               |
| Westpac Banking Corp        | 201.162   | (201.162)  | –  | –                               | (229.307)   | 201.162                                       | –  | (28.145)                        |
| <b>Insgesamt</b>            | <b>422.478</b>  | <b>(218.878)</b>                                 | <b>–</b>                                   | <b>203.600</b>                  | <b>(250.684)</b>  | <b>218.878</b>                                | <b>–</b>                                     | <b>(31.806)</b>                 |

\* Das Portfolio wurde am 31. Dezember 2024 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Value

31. Dezember 2024

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 77.347   | (106.217)   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>77.347</b>  | <b>(106.217)</b>  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                 | Vermögenswerte   |   |                                       |                            | Verbindlichkeiten  |  |   |                            |
|-----------------------------|--|---|---------------------------------------|----------------------------|--|--|---|----------------------------|
|                             | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> | Nettobetrag <sup>(b)</sup> | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> | Nettobetrag <sup>(b)</sup> |
|                             | US\$   | US\$  | US\$                                  | US\$                       | US\$   | US\$                                     | US\$                                    | US\$                       |
| Goldman Sachs International | 339  | (339)                                       | –                                     | –                          | (898)  | 339                                      | –                                       | (559)                      |
| UBS AG                      | 798  | (555)                                       | –                                     | 243                        | (555)  | 555                                      | –                                       | –                          |
| Westpac Banking Corp        | 76.210   | (76.210)                                    | –                                     | –                          | (104.764)  | 76.210                                   | –                                       | (28.554)                   |
| <b>Insgesamt</b>            | <b>77.347</b>  | <b>(77.104)</b>                             | <b>–</b>                              | <b>243</b>                 | <b>(106.217)</b>   | <b>77.104</b>                            | <b>–</b>                                | <b>(29.113)</b>            |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Value (Fortsetzung)

31. Dezember 2023

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 66.448   | (46.897)  |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>66.448</b>  | <b>(46.897)</b>   |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                 | Vermögenswerte  |  |  |                                 | Verbindlichkeiten   |   |  |                                 |
|-----------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
|                             | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ |
| Goldman Sachs International | 512   | (454)  | –  | 58                              | (454)   | 454   | –  | –                               |
| UBS AG                      | 32.773  | (22.275)   | –  | 10.498                          | (22.275)  | 22.275  | –  | –                               |
| Westpac Banking Corp        | 33.163  | (24.168)   | –  | 8.995                           | (24.168)  | 24.168  | –  | –                               |
| <b>Insgesamt</b>            | <b>66.448</b>   | <b>(46.897)</b>                                  | <b>–</b>                                   | <b>19.551</b>                   | <b>(46.897)</b>   | <b>46.897</b>                                 | <b>–</b>                                     | <b>–</b>                        |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## High Yield Bond

31. Dezember 2024

| Beschreibung                 | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------------|--|---|
|                              | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte       | 20.418.669   | (61.211.609)  |
| Pensionsgeschäfte            | 66.000.000   | –   |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | –  | (3.063.764)   |
| <b>Insgesamt</b>             | <b>86.418.669</b>  | <b>(64.275.373)</b>   |

## Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                    | Vermögenswerte   |   |   |                                    | Verbindlichkeiten  |  |   |                                    |
|--------------------------------|--|---|---|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|
|                                | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge<br>US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten<br>US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup><br>US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge<br>US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte<br>US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup><br>US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>US\$ |
| Bank of America Merrill Lynch  | –  | –   | –   | –                                  | (3.063.764)  | –  | 2.850.768                                       | (212.996)                          |
| Goldman Sachs International    | 1.430.773  | (1.430.773)   | –   | –                                  | (8.039.565)  | 1.430.773  | –   | (6.608.792)                        |
| State Street Bank and Trust Co | 66.000.000   | –   | (66.000.000)                                  | –                                  | –  | –  | –   | –                                  |
| UBS AG                         | 17.026.453   | (17.026.453)  | –   | –                                  | (45.677.989)   | 17.026.453                                       | –   | (28.651.536)                       |
| Westpac Banking Corp           | 1.961.443  | (1.961.443)   | –   | –                                  | (7.494.055)  | 1.961.443  | –   | (5.532.612)                        |
| <b>Insgesamt</b>               | <b>86.418.669</b>  | <b>(20.418.669)</b>                                 | <b>(66.000.000)</b>                           | <b>–</b>                           | <b>(64.275.373)</b>  | <b>20.418.669</b>                                | <b>2.850.768</b>                                | <b>(41.005.936)</b>                |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

31. Dezember 2023

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte |  | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |  |
|------------------------|--|--|---|--|
|                        | US\$   |  | US\$  |  |
| Devisenterminkontrakte | 40.709.223   |  | (15.391.406)  |  |
| OTC-Kontrakt           | –  |  | (51.928)  |  |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>40.709.223</b>  |  | <b>(15.443.334)</b>   |  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                 | Vermögenswerte   |   |                                       |                                    | Verbindlichkeiten  |  |   |                                    |
|-----------------------------|--|---|---------------------------------------|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|
|                             | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge<br>US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten<br>US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> |                                    | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge<br>US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte<br>US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> |                                    |
|                             |  |   | US\$                                  | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>US\$ |  |  | US\$                                    | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>US\$ |
| Goldman Sachs International | 8.518.424  | (1.130.109)   | –                                     | 7.388.315                          | (1.130.109)  | 1.130.109  | –                                       | –                                  |
| JPMorgan Chase Bank         | –  | –   | –                                     | –                                  | (51.928)   | –  | –                                       | (51.928)                           |
| UBS AG                      | 18.392.576   | (8.661.964)   | –                                     | 9.730.612                          | (8.661.964)  | 8.661.964  | –                                       | –                                  |
| Westpac Banking Corp        | 13.798.223   | (5.599.333)   | –                                     | 8.198.890                          | (5.599.333)  | 5.599.333  | –                                       | –                                  |
| <b>Insgesamt</b>            | <b>40.709.223</b>  | <b>(15.391.406)</b>                                 | <b>–</b>                              | <b>25.317.817</b>                  | <b>(15.443.334)</b>  | <b>15.391.406</b>                                | <b>–</b>                                | <b>(51.928)</b>                    |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## InnovAsia

## 31. Dezember 2024

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte |  | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |  |
|------------------------|--|--|---|--|
|                        | US\$   |  | US\$  |  |
| Devisenterminkontrakte | 46.906   |  | (452.531)   |  |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>46.906</b>  |  | <b>(452.531)</b>  |  |

## Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                    | Vermögenswerte  |  |  |                                 | Verbindlichkeiten   |   |  |                                 |
|--------------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
|                                | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ |
| Citibank NA                    | 1.182   | (1.182)  | –  | –                               | (373.407)   | 1.182   | –  | (372.225)                       |
| JPMorgan Chase Bank            | 7.592   | (7.592)  | –  | –                               | (43.361)  | 7.592   | –  | (35.769)                        |
| Standard Chartered Bank        | 2.781   | (438)  | –  | 2.343                           | (438)   | 438   | –  | –                               |
| State Street Bank and Trust Co | 1.846   | (1.194)  | –  | 652                             | (1.194)   | 1.194   | –  | –                               |
| UBS AG                         | 23.687  | (23.682)   | –  | 5                               | (23.682)  | 23.682  | –  | –                               |
| Westpac Banking Corp           | 9.818   | (9.818)  | –  | –                               | (10.449)  | 9.818   | –  | (631)                           |
| <b>Insgesamt</b>               | <b>46.906</b>   | <b>(43.906)</b>                                  | <b>–</b>                                   | <b>3.000</b>                    | <b>(452.531)</b>  | <b>43.906</b>                                 | <b>–</b>                                     | <b>(408.625)</b>                |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

InnovAsia (Fortsetzung)

31. Dezember 2023

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 299.135  | (60.136)  |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>299.135</b>   | <b>(60.136)</b>   |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                    | Vermögenswerte  |  |  |                                 | Verbindlichkeiten   |   |  |                                 |
|--------------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
|                                | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ |
| Standard Chartered Bank        | 6.569   | (5.960)  | –  | 609                             | (5.960)   | 5.960   | –  | –                               |
| State Street Bank and Trust Co | 38.240  | (1.950)  | –  | 36.290                          | (1.950)   | 1.950   | –  | –                               |
| UBS AG                         | 207.008   | (14.058)   | –  | 192.950                         | (14.058)  | 14.058  | –  | –                               |
| Westpac Banking Corp           | 47.318  | (38.168)   | –  | 9.150                           | (38.168)  | 38.168  | –  | –                               |
| <b>Insgesamt</b>               | <b>299.135</b>  | <b>(60.136)</b>                                  | <b>–</b>                                   | <b>238.999</b>                  | <b>(60.136)</b>   | <b>60.136</b>                                 | <b>–</b>                                     | <b>–</b>                        |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## Japan Equity Engagement

## 31. Dezember 2024

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte |  | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |  |
|------------------------|--|--|---|--|
|                        | JPY  |  | JPY   |  |
| Devisenterminkontrakte | 860.770  |  | (132.669)   |  |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>860.770</b>   |  | <b>(132.669)</b>  |  |

## Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                    | Vermögenswerte   |   |   |                                | Verbindlichkeiten  |  |   |                                |
|--------------------------------|--|---|---|--------------------------------|--|--|---|--------------------------------|
|                                | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge JPY | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten JPY | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> JPY | Nettobetrag <sup>(b)</sup> JPY | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge JPY | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte JPY | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> JPY | Nettobetrag <sup>(b)</sup> JPY |
| Brown Brothers Harriman        | 8.328  | (8.328)   | –   | –                              | (38.978)   | 8.328  | –   | (30.650)                       |
| Citibank NA                    | 3.534  | (884)   | –   | 2.650                          | (884)  | 884  | –   | –                              |
| Goldman Sachs International    | –  | –   | –   | –                              | (3.140)  | –  | –   | (3.140)                        |
| JPMorgan Chase Bank            | 61.451   | –   | –   | 61.451                         | –  | –  | –   | –                              |
| Standard Chartered Bank        | 683.701  | (35.246)  | –   | 648.455                        | (35.246)   | 35.246                                       | –   | –                              |
| State Street Bank and Trust Co | 81.316   | (35.707)  | –   | 45.609                         | (35.707)   | 35.707                                       | –   | –                              |
| UBS AG                         | –  | –   | –   | –                              | (773)  | –  | –   | (773)                          |
| Westpac Banking Corp           | 22.440   | (17.941)  | –   | 4.499                          | (17.941)   | 17.941                                       | –   | –                              |
| <b>Insgesamt</b>               | <b>860.770</b>   | <b>(98.106)</b>                                 | <b>–</b>                                  | <b>762.664</b>                 | <b>(132.669)</b>   | <b>98.106</b>                                | <b>–</b>                                    | <b>(34.563)</b>                |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Japan Equity Engagement (Fortsetzung)

31. Dezember 2023

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | JPY  | JPY   |
| Devisenterminkontrakte | 128.484.079  | (42.002.252)  |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>128.484.079</b>   | <b>(42.002.252)</b>   |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                    | Vermögenswerte   |   |   |                                | Verbindlichkeiten  |  |   |                                |
|--------------------------------|--|---|---|--------------------------------|--|--|---|--------------------------------|
|                                | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge JPY | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten JPY | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> JPY | Nettobetrag <sup>(b)</sup> JPY | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge JPY | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte JPY | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> JPY | Nettobetrag <sup>(b)</sup> JPY |
| Brown Brothers Harriman        | 69.722   | (23.619)  | –   | 46.103                         | (23.619)   | 23.619                                       | –   | –                              |
| Standard Chartered Bank        | 2.860.241  | (1.032.189)                                     | –   | 1.828.052                      | (1.032.189)  | 1.032.189                                    | –   | –                              |
| State Street Bank and Trust Co | 3.449.741  | (3.449.741)                                     | –   | –                              | (39.519.881)   | 3.449.741                                    | –   | (36.070.140)                   |
| Westpac Banking Corp           | 122.104.375  | (1.426.563)                                     | –   | 120.677.812                    | (1.426.563)  | 1.426.563                                    | –   | –                              |
| <b>Insgesamt</b>               | <b>128.484.079</b>   | <b>(5.932.112)</b>                              | <b>–</b>                                  | <b>122.551.967</b>             | <b>(42.002.252)</b>  | <b>5.932.112</b>                             | <b>–</b>                                    | <b>(36.070.140)</b>            |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## Macro Opportunities FX\*

## 31. Dezember 2024

Keine zur Saldierung verfügbaren Vermögenswerte und Verbindlichkeiten aus OTC-Derivaten.

## 31. Dezember 2023

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | EUR  | EUR   |
| Devisenterminkontrakte | 4.627.295  | (4.613.695)   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>4.627.295</b>   | <b>(4.613.695)</b>  |

## Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                    | Vermögenswerte   |   |   |                                | Verbindlichkeiten  |  |   |                                |
|--------------------------------|--|---|---|--------------------------------|--|--|---|--------------------------------|
|                                | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten EUR | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> EUR | Nettobetrag <sup>(b)</sup> EUR | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte EUR | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> EUR | Nettobetrag <sup>(b)</sup> EUR |
| BNP Paribas                    | 915.663  | (915.663)                                       | –   | –                              | (1.216.937)  | 915.663                                      | –   | (301.274)                      |
| Citibank NA                    | –  | –   | –   | –                              | (286)  | –  | –   | (286)                          |
| Deutsche Bank AG               | 565.493  | (187.451)                                       | –   | 378.042                        | (187.451)  | 187.451                                      | –   | –                              |
| Goldman Sachs International    | 1.337.289  | (852.517)                                       | –   | 484.772                        | (852.517)  | 852.517                                      | –   | –                              |
| Standard Chartered Bank        | 221.272  | (221.272)                                       | –   | –                              | (612.890)  | 221.272                                      | –   | (391.618)                      |
| State Street Bank and Trust Co | 663.217  | (663.217)                                       | –   | –                              | (697.543)  | 663.217                                      | –   | (34.326)                       |
| UBS AG                         | 478.535  | (478.535)                                       | –   | –                              | (592.588)  | 478.535                                      | –   | (114.053)                      |
| Westpac Banking Corp           | 445.826  | (445.826)                                       | –   | –                              | (453.483)  | 445.826                                      | –   | (7.657)                        |
| <b>Insgesamt</b>               | <b>4.627.295</b>   | <b>(3.764.481)</b>                              | <b>–</b>                                  | <b>862.814</b>                 | <b>(4.613.695)</b>   | <b>3.764.481</b>                             | <b>–</b>                                    | <b>(849.214)</b>               |

\* Das Portfolio wurde am 8. Februar 2024 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Next Generation Connectivity

31. Dezember 2024

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 2.683.376  | (12.934.421)  |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>2.683.376</b>   | <b>(12.934.421)</b>   |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                    | Vermögenswerte   |   |                                       |                            | Verbindlichkeiten  |  |   |                            |
|--------------------------------|--|---|---------------------------------------|----------------------------|--|--|---|----------------------------|
|                                | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> | Nettobetrag <sup>(b)</sup> | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> | Nettobetrag <sup>(b)</sup> |
|                                |  |   |                                       |                            |  |  |   |                            |
| BNP Paribas                    | 211  | (211)                                       | –                                     | –                          | (308)  | 211                                      | –                                       | (97)                       |
| Citibank NA                    | 15.057   | (15.057)                                    | –                                     | –                          | (10.181.707)   | 15.057                                   | –                                       | (10.166.650)               |
| Goldman Sachs International    | 690.836  | (338.338)                                   | –                                     | 352.498                    | (338.338)  | 338.338                                  | –                                       | –                          |
| JPMorgan Chase Bank            | 42.476   | (42.476)                                    | –                                     | –                          | (306.191)  | 42.476                                   | –                                       | (263.715)                  |
| Standard Chartered Bank        | 8.482  | (8.482)                                     | –                                     | –                          | (422.008)  | 8.482                                    | –                                       | (413.526)                  |
| State Street Bank and Trust Co | 46.981   | (46.981)                                    | –                                     | –                          | (106.970)  | 46.981                                   | –                                       | (59.989)                   |
| UBS AG                         | 296.132  | (296.132)                                   | –                                     | –                          | (528.717)  | 296.132                                  | –                                       | (232.585)                  |
| Westpac Banking Corp           | 1.583.201  | (1.050.182)                                 | –                                     | 533.019                    | (1.050.182)  | 1.050.182                                | –                                       | –                          |
| <b>Insgesamt</b>               | <b>2.683.376</b>   | <b>(1.797.859)</b>                          | <b>–</b>                              | <b>885.517</b>             | <b>(12.934.421)</b>  | <b>1.797.859</b>                         | <b>–</b>                                | <b>(11.136.562)</b>        |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## Next Generation Connectivity (Fortsetzung)

## 31. Dezember 2023

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 6.342.222  | (1.033.321)   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>6.342.222</b>   | <b>(1.033.321)</b>  |

## Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                    | Vermögenswerte  |  |  |                                 | Verbindlichkeiten   |   |  |                                 |
|--------------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
|                                | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ |
| BNP Paribas                    | –   | –  | –  | –                               | (58)  | –   | –  | (58)                            |
| Goldman Sachs International    | 370.835   | (215.169)  | –  | 155.666                         | (215.169)   | 215.169                                       | –  | –                               |
| Standard Chartered Bank        | 16.571  | (16.571)   | –  | –                               | (85.735)  | 16.571  | –  | (69.164)                        |
| State Street Bank and Trust Co | 40.673  | (40.673)   | –  | –                               | (63.143)  | 40.673  | –  | (22.470)                        |
| UBS AG                         | 3.896.298   | (69.056)   | –  | 3.827.242                       | (69.056)  | 69.056  | –  | –                               |
| Westpac Banking Corp           | 2.017.845   | (600.160)  | –  | 1.417.685                       | (600.160)   | 600.160                                       | –  | –                               |
| <b>Insgesamt</b>               | <b>6.342.222</b>  | <b>(941.629)</b>                                 | <b>–</b>                                   | <b>5.400.593</b>                | <b>(1.033.321)</b>  | <b>941.629</b>                                | <b>–</b>                                     | <b>(91.692)</b>                 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Next Generation Mobility

31. Dezember 2024

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 1.574  | (12.261)  |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>1.574</b>   | <b>(12.261)</b>   |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                 | Vermögenswerte   |   |                                       |                            | Verbindlichkeiten  |  |   |                            |
|-----------------------------|--|---|---------------------------------------|----------------------------|--|--|---|----------------------------|
|                             | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> | Nettobetrag <sup>(b)</sup> | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> | Nettobetrag <sup>(b)</sup> |
|                             |  |   |                                       |                            |  |  |   |                            |
| Citibank NA                 | 140  | (115)                                       | –                                     | 25                         | (115)  | 115                                      | –                                       | –                          |
| Goldman Sachs International | 380  | (380)                                       | –                                     | –                          | (476)  | 380                                      | –                                       | (96)                       |
| UBS AG                      | 771  | (255)                                       | –                                     | 516                        | (255)  | 255                                      | –                                       | –                          |
| Westpac Banking Corp        | 283  | (283)                                       | –                                     | –                          | (11.415)   | 283                                      | –                                       | (11.132)                   |
| <b>Insgesamt</b>            | <b>1.574</b>   | <b>(1.033)</b>                              | <b>–</b>                              | <b>541</b>                 | <b>(12.261)</b>  | <b>1.033</b>                             | <b>–</b>                                | <b>(11.228)</b>            |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Next Generation Mobility (Fortsetzung)

31. Dezember 2023

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 20.789   | (10.365)  |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>20.789</b>  | <b>(10.365)</b>   |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                 | Vermögenswerte   |   |                                       |                            | Verbindlichkeiten  |  |   |                            |
|-----------------------------|--|---|---------------------------------------|----------------------------|--|--|---|----------------------------|
|                             | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> | Nettobetrag <sup>(b)</sup> | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> | Nettobetrag <sup>(b)</sup> |
|                             |  |   |                                       |                            |  |  |   |                            |
| Goldman Sachs International | 510  | (510)                                       | –                                     | –                          | (820)  | 510                                      | –                                       | (310)                      |
| UBS AG                      | 10.281   | (55)  | –                                     | 10.226                     | (55)   | 55                                       | –                                       | –                          |
| Westpac Banking Corp        | 9.998  | (9.490)                                     | –                                     | 508                        | (9.490)  | 9.490                                    | –                                       | –                          |
| <b>Insgesamt</b>            | <b>20.789</b>  | <b>(10.055)</b>                             | <b>–</b>                              | <b>10.734</b>              | <b>(10.365)</b>  | <b>10.055</b>                            | <b>–</b>                                | <b>(310)</b>               |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt

31. Dezember 2024

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 9.042.854  | (68.781.224)  |
| Pensionsgeschäfte      | 9.000.000  | –   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>18.042.854</b>  | <b>(68.781.224)</b>   |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                    | Vermögenswerte  |  |  |                                 | Verbindlichkeiten   |   |  |                                 |
|--------------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
|                                | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ |
| Citibank NA                    | 1   | (1)  | –  | –                               | (4.248.358)   | 1   | –  | (4.248.357)                     |
| Goldman Sachs International    | 8.396   | (8.396)  | –  | –                               | (13.154.263)  | 8.396   | –  | (13.145.867)                    |
| HSBC Bank Plc                  | 3.851.486   | (289.423)  | (2.100.000)                                | 1.462.063                       | (289.423)   | 289.423                                       | –  | –                               |
| Royal Bank of Canada           | 2.410.278   | (2.410.278)                                      | –  | –                               | (30.994.914)  | 2.410.278                                     | –  | (28.584.636)                    |
| State Street Bank and Trust Co | 9.000.000   | –  | (9.000.000)                                | –                               | –   | –   | –  | –                               |
| UBS AG                         | 2.509.445   | (2.509.445)                                      | –  | –                               | (18.880.986)  | 2.509.445                                     | –  | (16.371.541)                    |
| Westpac Banking Corp           | 263.248   | (263.248)  | –  | –                               | (1.213.280)   | 263.248                                       | –  | (950.032)                       |
| <b>Insgesamt</b>               | <b>18.042.854</b>   | <b>(5.480.791)</b>                               | <b>(11.100.000)</b>                        | <b>1.462.063</b>                | <b>(68.781.224)</b>   | <b>5.480.791</b>                              | <b>–</b>                                     | <b>(63.300.433)</b>             |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

31. Dezember 2023

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte |  | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |  |
|------------------------|--|--|---|--|
|                        | US\$   |  | US\$  |  |
| Devisenterminkontrakte | 64.552.046   |  | (9.131.675)   |  |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>64.552.046</b>  |  | <b>(9.131.675)</b>  |  |

## Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                 | Vermögenswerte   |   |                                       |                                    | Verbindlichkeiten  |  |   |                                    |
|-----------------------------|--|---|---------------------------------------|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|
|                             | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge<br>US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten<br>US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> |                                    | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge<br>US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte<br>US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> |                                    |
|                             |  |   | US\$                                  | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>US\$ |  |  | US\$                                    | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>US\$ |
| Citibank NA                 | 106.705  | (106.705)   | –                                     | –                                  | (147.411)  | 106.705  | –                                       | (40.706)                           |
| Goldman Sachs International | 36.534.923   | –   | –                                     | 36.534.923                         | –  | –  | –                                       | –                                  |
| HSBC Bank Plc               | 36.950   | (36.950)  | –                                     | –                                  | (3.382.906)  | 36.950   | 3.345.956                               | –                                  |
| Royal Bank of Canada        | 18.468.179   | –   | –                                     | 18.468.179                         | –  | –  | –                                       | –                                  |
| UBS AG                      | 8.810.283  | (4.951.663)   | –                                     | 3.858.620                          | (4.951.663)  | 4.951.663  | –                                       | –                                  |
| Westpac Banking Corp        | 595.006  | (595.006)   | –                                     | –                                  | (649.695)  | 595.006  | –                                       | (54.689)                           |
| <b>Insgesamt</b>            | <b>64.552.046</b>  | <b>(5.690.324)</b>                                  | <b>–</b>                              | <b>58.861.722</b>                  | <b>(9.131.675)</b>   | <b>5.690.324</b>                                 | <b>3.345.956</b>                        | <b>(95.395)</b>                    |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Short Duration Euro Bond

31. Dezember 2024

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | EUR  | EUR   |
| Devisenterminkontrakte | 1.543.824  | (1.449.270)   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>1.543.824</b>   | <b>(1.449.270)</b>  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                 | Vermögenswerte  |  |  |                                   | Verbindlichkeiten   |   |  |                                   |
|-----------------------------|---|--|--|-----------------------------------|---|---|--|-----------------------------------|
|                             | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge<br>EUR | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten<br>EUR | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup><br>EUR | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>EUR | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge<br>EUR | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte<br>EUR | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup><br>EUR | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>EUR |
| Citibank NA                 | –   | –  | –  | –                                 | (19.435)  | –   | –  | (19.435)                          |
| Goldman Sachs International | 1.540.271   | (1.427.208)  | –  | 113.063                           | (1.427.208)   | 1.427.208                                       | –  | –                                 |
| Westpac Banking Corp        | 3.553   | (2.627)  | –  | 926                               | (2.627)   | 2.627   | –  | –                                 |
| <b>Insgesamt</b>            | <b>1.543.824</b>  | <b>(1.429.835)</b>                                 | <b>–</b>                                     | <b>113.989</b>                    | <b>(1.449.270)</b>  | <b>1.429.835</b>                                | <b>–</b>                                       | <b>(19.435)</b>                   |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Short Duration Euro Bond (Fortsetzung)

31. Dezember 2023

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der                                    | Bruttobeträge der in der Aufstellung der                                       |
|------------------------|---|--|
|                        | Vermögenswerte und Verbindlichkeiten<br>ausgewiesenen Vermögenswerte<br>EUR | Vermögenswerte und Verbindlichkeiten<br>ausgewiesenen Verbindlichkeiten<br>EUR |
| Devisenterminkontrakte | 235.719   | (2.512.078)  |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>235.719</b>  | <b>(2.512.078)</b>   |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                 | Vermögenswerte  |   |   |                                   | Verbindlichkeiten   |   |   |                                   |
|-----------------------------|---|---|---|-----------------------------------|---|---|---|-----------------------------------|
|                             | In der Aufstellung der<br>Vermögenswerte und<br>Verbindlichkeiten<br>ausgewiesene Brutto-<br>beträge<br>EUR | Zur Saldierung<br>verfügbare<br>Verbindlich-<br>keiten<br>EUR | Erhaltene<br>Sicherheiten <sup>(a)</sup><br>EUR | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>EUR | In der Aufstellung der<br>Vermögenswerte und<br>Verbindlichkeiten<br>ausgewiesene Brutto-<br>beträge<br>EUR | Zur Saldierung<br>verfügbare<br>Vermögenswerte<br>EUR | Verpfändete<br>Sicherheiten <sup>(a)</sup><br>EUR | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>EUR |
| Goldman Sachs International | 1.594   | (1.594)   | –   | –                                 | (42.515)  | 1.594   | –   | (40.921)                          |
| Westpac Banking Corp        | 234.125   | (234.125)   | –   | –                                 | (2.469.563)   | 234.125   | –   | (2.235.438)                       |
| <b>Insgesamt</b>            | <b>235.719</b>  | <b>(235.719)</b>  | <b>–</b>  | <b>–</b>                          | <b>(2.512.078)</b>  | <b>235.719</b>  | <b>–</b>  | <b>(2.276.359)</b>                |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Short Duration High Yield Engagement

31. Dezember 2024

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte<br>US\$ | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten<br>US\$ |
|------------------------|--|---|
| Devisenterminkontrakte | 5.924.937  | (22.583.571)  |
| Pensionsgeschäfte      | 16.000.000   | –   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>21.924.937</b>  | <b>(22.583.571)</b>   |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                    | Vermögenswerte   |   |   |                                    | Verbindlichkeiten  |  |   |                                    |
|--------------------------------|--|---|---|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|
|                                | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge<br>US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten<br>US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup><br>US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge<br>US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte<br>US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup><br>US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>US\$ |
| Goldman Sachs International    | 72.850   | (72.850)  | –   | –                                  | (8.203.070)  | 72.850   | –   | (8.130.220)                        |
| State Street Bank and Trust Co | 16.000.000   | –   | (16.000.000)                                  | –                                  | –  | –  | –   | –                                  |
| UBS AG                         | 111.783  | (111.783)   | –   | –                                  | (13.468.855)   | 111.783  | –   | (13.357.072)                       |
| Westpac Banking Corp           | 5.740.304  | (911.646)   | –   | 4.828.658                          | (911.646)  | 911.646  | –   | –                                  |
| <b>Insgesamt</b>               | <b>21.924.937</b>  | <b>(1.096.279)</b>                                  | <b>(16.000.000)</b>                           | <b>4.828.658</b>                   | <b>(22.583.571)</b>  | <b>1.096.279</b>                                 | <b>–</b>  | <b>(21.487.292)</b>                |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Short Duration High Yield Engagement (Fortsetzung)

31. Dezember 2023

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 15.254.920   | (3.114.085)   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>15.254.920</b>  | <b>(3.114.085)</b>  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                 | Vermögenswerte   |   |                                       |                                    | Verbindlichkeiten  |  |   |                                    |
|-----------------------------|--|---|---------------------------------------|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|
|                             | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge<br>US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten<br>US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> |                                    | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge<br>US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte<br>US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> |                                    |
|                             |  |   | US\$                                  | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>US\$ |  |  | US\$                                    | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>US\$ |
| Goldman Sachs International | 134.884  | (69.533)  | –                                     | 65.351                             | (69.533)   | 69.533   | –                                       | –                                  |
| UBS AG                      | 6.142.919  | (1.376.770)   | –                                     | 4.766.149                          | (1.376.770)  | 1.376.770  | –                                       | –                                  |
| Westpac Banking Corp        | 8.977.117  | (1.667.782)   | –                                     | 7.309.335                          | (1.667.782)  | 1.667.782  | –                                       | –                                  |
| <b>Insgesamt</b>            | <b>15.254.920</b>  | <b>(3.114.085)</b>                                  | <b>–</b>                              | <b>12.140.835</b>                  | <b>(3.114.085)</b>   | <b>3.114.085</b>                                 | <b>–</b>                                | <b>–</b>                           |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Strategic Income

31. Dezember 2024

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 39.661.388   | (78.113.648)  |
| Pensionsgeschäfte      | 82.500.000   | –   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>122.161.388</b>   | <b>(78.113.648)</b>   |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                    | Vermögenswerte  |  |  |                                 | Verbindlichkeiten   |   |  |                                 |
|--------------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
|                                | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ |
| Barclays Bank Plc              | 4.123   | (4.123)  | –  | –                               | (5.559)   | 4.123   | –  | (1.436)                         |
| Citibank NA                    | 14.098.823  | (230.956)  | –  | 13.867.867                      | (230.956)   | 230.956                                       | –  | –                               |
| Goldman Sachs International    | 2.981.574   | (2.981.574)                                      | –  | –                               | (20.815.632)  | 2.981.574                                     | 70.000                                       | (17.764.058)                    |
| JPMorgan Chase Bank            | 14.952.026  | (3.012.148)                                      | –  | 11.939.878                      | (3.012.148)   | 3.012.148                                     | –  | –                               |
| Morgan Stanley                 | –   | –  | –  | –                               | (10.487)  | –   | 10.487                                       | –                               |
| Royal Bank of Canada           | 5.498.393   | (41)   | –  | 5.498.352                       | (41)  | 41  | –  | –                               |
| Standard Chartered Bank        | 924   | –  | –  | 924                             | –   | –   | –  | –                               |
| State Street Bank and Trust Co | 82.500.000  | –  | (82.500.000)                               | –                               | –   | –   | –  | –                               |
| UBS AG                         | 565.738   | (565.738)  | –  | –                               | (40.944.387)  | 565.738                                       | –  | (40.378.649)                    |
| Westpac Banking Corp           | 1.559.787   | (1.559.787)                                      | –  | –                               | (13.094.438)  | 1.559.787                                     | –  | (11.534.651)                    |
| <b>Insgesamt</b>               | <b>122.161.388</b>  | <b>(8.354.367)</b>                               | <b>(82.500.000)</b>                        | <b>31.307.021</b>               | <b>(78.113.648)</b>   | <b>8.354.367</b>                              | <b>80.487</b>                                | <b>(69.678.794)</b>             |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## Strategic Income (Fortsetzung)

## 31. Dezember 2023

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 20.251.351   | (5.513.615)   |
| OTC-Kontrakt           | 461.585  | –   |
| OTC Swaptions          | 15.122   | –   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>20.728.058</b>  | <b>(5.513.615)</b>  |

## Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                 | Vermögenswerte   |   |   |                                    | Verbindlichkeiten  |  |   |                                    |
|-----------------------------|--|---|---|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|
|                             | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge<br>US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten<br>US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup><br>US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge<br>US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte<br>US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup><br>US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>US\$ |
| Barclays Bank Plc           | 50.289   | (14.141)  | –   | 36.148                             | (14.141)   | 14.141   | –   | –                                  |
| Citibank NA                 | 231.474  | (61.555)  | –   | 169.919                            | (61.555)   | 61.555   | –   | –                                  |
| Goldman Sachs International | 2.664.490  | (1.338.617)   | (520.000)                                     | 805.873                            | (1.338.617)  | 1.338.617  | –   | –                                  |
| HSBC Bank Plc               | 13.642   | (3.157)   | –   | 10.485                             | (3.157)  | 3.157  | –   | –                                  |
| JPMorgan Chase Bank         | 38.574   | (8.209)   | –   | 30.365                             | (8.209)  | 8.209  | –   | –                                  |
| Morgan Stanley              | 38.972   | (8.589)   | –   | 30.383                             | (8.589)  | 8.589  | –   | –                                  |
| Royal Bank of Canada        | 109.028  | (109.028)   | –   | –                                  | (2.607.384)  | 109.028  | –   | (2.498.356)                        |
| Standard Chartered Bank     | 20.617   | (11.152)  | –   | 9.465                              | (11.152)   | 11.152   | –   | –                                  |
| UBS AG                      | 2.146.973  | (92.890)  | –   | 2.054.083                          | (92.890)   | 92.890   | –   | –                                  |
| Westpac Banking Corp        | 15.413.999   | (1.367.921)   | –   | 14.046.078                         | (1.367.921)  | 1.367.921  | –   | –                                  |
| <b>Insgesamt</b>            | <b>20.728.058</b>  | <b>(3.015.259)</b>                                  | <b>(520.000)</b>                              | <b>17.192.799</b>                  | <b>(5.513.615)</b>   | <b>3.015.259</b>                                 | <b>–</b>  | <b>(2.498.356)</b>                 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Sustainable Asia High Yield

31. Dezember 2024

Es gab keine zur Saldierung verfügbaren Vermögenswerte und Verbindlichkeiten aus OTC-Derivaten.

31. Dezember 2023

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 16.926   | (496)   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>16.926</b>  | <b>(496)</b>  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                    | Vermögenswerte  |  |  |                                 | Verbindlichkeiten   |   |  |                                 |
|--------------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
|                                | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ |
| Goldman Sachs International    | 105   | (105)  | –  | –                               | (126)   | 105   | –  | (21)                            |
| Standard Chartered Bank        | 15  | –  | –  | 15                              | –   | –   | –  | –                               |
| State Street Bank and Trust Co | 843   | –  | –  | 843                             | –   | –   | –  | –                               |
| UBS AG                         | 1.040   | –  | –  | 1.040                           | –   | –   | –  | –                               |
| Westpac Banking Corp           | 14.923  | (370)  | –  | 14.553                          | (370)   | 370   | –  | –                               |
| <b>Insgesamt</b>               | <b>16.926</b>   | <b>(475)</b>                                     | <b>–</b>                                   | <b>16.451</b>                   | <b>(496)</b>  | <b>475</b>                                    | <b>–</b>                                     | <b>(21)</b>                     |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency

31. Dezember 2024

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 3.522.333  | (12.284.478)  |
| Pensionsgeschäfte      | 13.000.000   | –   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>16.522.333</b>  | <b>(12.284.478)</b>   |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                    | Vermögenswerte   |   |   |                                    | Verbindlichkeiten  |  |   |                                    |
|--------------------------------|--|---|---|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|
|                                | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge<br>US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten<br>US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup><br>US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge<br>US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte<br>US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup><br>US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>US\$ |
| Citibank NA                    | –  | –   | –   | –                                  | (112.143)  | –  | –   | (112.143)                          |
| Standard Chartered Bank        | 3.157.635  | (3.157.635)   | –   | –                                  | (12.155.551)   | 3.157.635  | –   | (8.997.916)                        |
| State Street Bank and Trust Co | 13.041.649   | –   | (13.041.649)                                  | –                                  | –  | –  | –   | –                                  |
| Westpac Banking Corp           | 323.049  | (16.784)  | –   | 306.265                            | (16.784)   | 16.784   | –   | –                                  |
| <b>Insgesamt</b>               | <b>16.522.333</b>  | <b>(3.174.419)</b>                                  | <b>(13.041.649)</b>                           | <b>306.265</b>                     | <b>(12.284.478)</b>  | <b>3.174.419</b>                                 | <b>–</b>  | <b>(9.110.059)</b>                 |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

31. Dezember 2023

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 8.781.301  | (2.051.066)   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>8.781.301</b>   | <b>(2.051.066)</b>  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                    | Vermögenswerte  |  |  |                                 | Verbindlichkeiten   |   |  |                                 |
|--------------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
|                                | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ |
| Citibank NA                    | 117.098   | (88.311)   | –  | 28.787                          | (88.311)  | 88.311  | –  | –                               |
| Standard Chartered Bank        | 8.367.376   | (1.499.461)                                      | –  | 6.867.915                       | (1.499.461)   | 1.499.461                                     | –  | –                               |
| State Street Bank and Trust Co | 116.450   | (29.672)   | –  | 86.778                          | (29.672)  | 29.672  | –  | –                               |
| Westpac Banking Corp           | 180.377   | (180.377)  | –  | –                               | (433.622)   | 180.377                                       | –  | (253.245)                       |
| <b>Insgesamt</b>               | <b>8.781.301</b>  | <b>(1.797.821)</b>                               | <b>–</b>                                   | <b>6.983.480</b>                | <b>(2.051.066)</b>  | <b>1.797.821</b>                              | <b>–</b>                                     | <b>(253.245)</b>                |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Tactical Macro<sup>1</sup>

31. Dezember 2024

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 67.183   | (296.634)   |
| OTC-Optionen           | 294.752  | (294.752)   |
| OTC-Kontrakt           | 21.388   | (39.190)  |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>383.323</b>   | <b>(630.576)</b>  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                 | Vermögenswerte   |   |   |                                    | Verbindlichkeiten  |  |   |                                    |
|-----------------------------|--|---|---|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|
|                             | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge<br>US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten<br>US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup><br>US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge<br>US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte<br>US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup><br>US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>US\$ |
| Goldman Sachs International | 380.690  | (380.690)   | –   | –                                  | (420.006)  | 380.690  | –   | (39.316)                           |
| Standard Chartered Bank     | –  | –   | –   | –                                  | (1.534)  | –  | –   | (1.534)                            |
| Westpac Banking Corp        | 2.633  | (2.633)   | –   | –                                  | (209.036)  | 2.633  | –   | (206.403)                          |
| <b>Insgesamt</b>            | <b>383.323</b>   | <b>(383.323)</b>                                    | <b>–</b>                                      | <b>–</b>                           | <b>(630.576)</b>   | <b>383.323</b>                                   | <b>–</b>  | <b>(247.253)</b>                   |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Tactical Macro<sup>1</sup> (Fortsetzung)

31. Dezember 2023

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 67.331   | (36.811)  |
| OTC-Optionen           | 81.790   | (81.790)  |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>149.121</b>   | <b>(118.601)</b>  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                 | Vermögenswerte   |   |                                       |                                    | Verbindlichkeiten  |  |   |                                    |
|-----------------------------|--|---|---------------------------------------|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|
|                             | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge<br>US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten<br>US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge<br>US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte<br>US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup><br>US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>US\$ |
|                             |  |   | US\$                                  |                                    |  |  |   |                                    |
| Goldman Sachs International | 149.121  | (118.601)   | –                                     | 30.520                             | (118.601)  | 118.601  | –   | –                                  |
| <b>Insgesamt</b>            | <b>149.121</b>   | <b>(118.601)</b>                                    | <b>–</b>                              | <b>30.520</b>                      | <b>(118.601)</b>   | <b>118.601</b>                                   | <b>–</b>  | <b>–</b>                           |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## Uncorrelated Strategies

## 31. Dezember 2024

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte |  | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |  |
|------------------------|--|--|---|--|
|                        | US\$   |  | US\$  |  |
| Devisenterminkontrakte | 25.462.747   |  | (45.926.653)  |  |
| OTC-Optionen           | 65.619.906   |  | (65.236.685)  |  |
| OTC-Kontrakt           | 12.020.926   |  | (4.798.682)   |  |
| OTC Swaptions          | 9.599  |  | –   |  |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>103.113.178</b>   |  | <b>(115.962.020)</b>  |  |

## Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                   | Vermögenswerte   |   |                                       |                            | Verbindlichkeiten  |  |   |                            |
|-------------------------------|--|---|---------------------------------------|----------------------------|--|--|---|----------------------------|
|                               | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> | Nettobetrag <sup>(b)</sup> | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> | Nettobetrag <sup>(b)</sup> |
|                               |  |   |                                       |                            |  |  |   |                            |
| Banco Santander SA            | 115.307  | –   | –                                     | 115.307                    | –  | –  | –                                       | –                          |
| Bank of America Merrill Lynch | 557.810  | (557.810)                                   | –                                     | –                          | (801.509)  | 557.810                                  | 243.699                                 | –                          |
| Barclays Bank Plc             | 487.871  | (41.734)                                    | –                                     | 446.137                    | (41.734)   | 41.734                                   | –                                       | –                          |
| BNP Paribas                   | 2.579.004  | (1.038.875)                                 | –                                     | 1.540.129                  | (1.038.875)  | 1.038.875                                | –                                       | –                          |
| Citibank NA                   | 1.137.489  | (200.618)                                   | –                                     | 936.871                    | (200.618)  | 200.618                                  | –                                       | –                          |
| Daiwa                         | 213.020  | –   | –                                     | 213.020                    | –  | –  | –                                       | –                          |
| Deutsche Bank AG              | 340.543  | (19.520)                                    | –                                     | 321.023                    | (19.520)   | 19.520                                   | –                                       | –                          |
| Goldman Sachs International   | 14.515.993   | (12.987.419)                                | (1.528.574)                           | –                          | (12.987.419)   | 12.987.419                               | –                                       | –                          |
| HSBC Bank Plc                 | 121.905  | (17.263)                                    | –                                     | 104.642                    | (17.263)   | 17.263                                   | –                                       | –                          |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

31. Dezember 2024

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge (Fortsetzung):

| Gegenpartei                    | Vermögenswerte   |   |   |                                    | Verbindlichkeiten  |  |   |                                    |
|--------------------------------|--|---|---|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|
|                                | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge<br>US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten<br>US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup><br>US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge<br>US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte<br>US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup><br>US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>US\$ |
| JPMorgan Chase Bank            | 60.230.634   | (57.362.772)  | –   | 2.867.862                          | (57.362.772)   | 57.362.772                                       | –   | –                                  |
| Morgan Stanley                 | 1.765.941  | (1.765.941)   | –   | –                                  | (2.454.299)  | 1.765.941  | 688.358   | –                                  |
| Nomura                         | 2.963.272  | (6.571)   | –   | 2.956.701                          | (6.571)  | 6.571  | –   | –                                  |
| Royal Bank of Canada           | 1.309.894  | (591.463)   | –   | 718.431                            | (591.463)  | 591.463  | –   | –                                  |
| Royal Bank of Scotland         | 34.545   | (18.949)  | –   | 15.596                             | (18.949)   | 18.949   | –   | –                                  |
| SMBC Nikko Capital Markets Ltd | 27.838   | –   | –   | 27.838                             | –  | –  | –   | –                                  |
| Société Générale               | 1.846.759  | (52.011)  | –   | 1.794.748                          | (52.011)   | 52.011   | –   | –                                  |
| State Street Bank and Trust Co | 2.781.884  | (2.781.884)   | –   | –                                  | (31.002.373)   | 2.781.884  | –   | (28.220.489)                       |
| UBS AG                         | 6.200.652  | (4.421.340)   | –   | 1.779.312                          | (4.421.340)  | 4.421.340  | –   | –                                  |
| Westpac Banking Corp           | 5.882.817  | (4.945.304)   | –   | 937.513                            | (4.945.304)  | 4.945.304  | –   | –                                  |
| <b>Insgesamt</b>               | <b>103.113.178</b>   | <b>(86.809.474)</b>                                 | <b>(1.528.574)</b>                            | <b>14.775.130</b>                  | <b>(115.962.020)</b>   | <b>86.809.474</b>                                | <b>932.057</b>                                  | <b>(28.220.489)</b>                |

31. Dezember 2023

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte<br>US\$ | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten<br>US\$ |
|------------------------|--|---|
| Devisenterminkontrakte | 91.871.867   | (53.084.382)  |
| OTC-Optionen           | 207.424.442  | (356.216.715)   |
| OTC-Kontrakt           | 134.147.954  | (36.578.579)  |
| OTC Swaptions          | 40.202   | (29.043)  |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>433.484.465</b>   | <b>(445.908.719)</b>  |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

31. Dezember 2023

## Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                    | Vermögenswerte   |   |   |                                    | Verbindlichkeiten  |  |   |                                    |
|--------------------------------|--|---|---|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|
|                                | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge<br>US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten<br>US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup><br>US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge<br>US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte<br>US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup><br>US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>US\$ |
| Barclays Bank Plc              | 268.757  | (60.423)  | –   | 208.334                            | (60.423)   | 60.423   | –   | –                                  |
| Bank of America Merrill Lynch  | 4.895.611  | (4.895.611)   | –   | –                                  | (5.073.462)  | 4.895.611  | 177.851   | –                                  |
| BNP Paribas                    | 13.781.080   | (3.460.943)   | –   | 10.320.137                         | (3.460.943)  | 3.460.943  | –   | –                                  |
| Citibank NA                    | 3.965.367  | (848.919)   | –   | 3.116.448                          | (848.919)  | 848.919  | –   | –                                  |
| Daiwa                          | 1.777.376  | –   | –   | 1.777.376                          | –  | –  | –   | –                                  |
| Deutsche Bank AG               | 57.980   | (57.980)  | –   | –                                  | (68.611)   | 57.980   | –   | (10.631)                           |
| Goldman Sachs International    | 165.131.686  | (165.131.686)                                       | –   | –                                  | (188.950.111)  | 165.131.686                                      | –   | (23.818.425)                       |
| HSBC Bank Plc                  | 1.687.310  | (1.687.310)   | –   | –                                  | (3.179.642)  | 1.687.310  | –   | (1.492.332)                        |
| JPMorgan Chase Bank            | 67.750.448   | (67.750.448)  | –   | –                                  | (204.346.512)  | 67.750.448                                       | –   | (136.596.064)                      |
| Morgan Stanley                 | 11.818.255   | (11.818.255)  | –   | –                                  | (15.261.190)   | 11.818.255                                       | 3.442.935                                       | –                                  |
| Nomura                         | 38.780.664   | (2.711.483)   | –   | 36.069.181                         | (2.711.483)  | 2.711.483  | –   | –                                  |
| Royal Bank of Scotland         | 29.607   | (13.466)  | –   | 16.141                             | (13.466)   | 13.466   | –   | –                                  |
| SMBC Nikko Capital Markets Ltd | 1.726.344  | –   | –   | 1.726.344                          | –  | –  | –   | –                                  |
| Société Générale               | 50.986.074   | (773.632)   | –   | 50.212.442                         | (773.632)  | 773.632  | –   | –                                  |
| State Street Bank and Trust Co | 1.726.917  | (1.469.262)   | –   | 257.655                            | (1.469.262)  | 1.469.262  | –   | –                                  |
| UBS AG                         | 65.878.290   | (2.623.895)   | –   | 63.254.395                         | (2.623.895)  | 2.623.895  | –   | –                                  |
| Westpac Banking Corp           | 3.222.699  | (3.222.699)   | –   | –                                  | (17.067.168)   | 3.222.699  | –   | (13.844.469)                       |
| <b>Insgesamt</b>               | <b>433.484.465</b>   | <b>(266.526.012)</b>                                | <b>–</b>                                      | <b>166.958.453</b>                 | <b>(445.908.719)</b>   | <b>266.526.012</b>                               | <b>3.620.786</b>                                | <b>(175.761.921)</b>               |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Equity

31. Dezember 2024

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 490.960  | (1.588.964)   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>490.960</b>   | <b>(1.588.964)</b>  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                 | Vermögenswerte  |  |  |                                 | Verbindlichkeiten   |   |  |                                 |
|-----------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
|                             | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ |
| Citibank NA                 | 42.220  | (19.821)   | –  | 22.399                          | (19.821)  | 19.821  | –  | –                               |
| Goldman Sachs International | 1.509   | (35)   | –  | 1.474                           | (35)  | 35  | –  | –                               |
| Royal Bank of Canada        | –   | –  | –  | –                               | (36.969)  | –   | –  | (36.969)                        |
| UBS AG                      | 25.487  | (12.860)   | –  | 12.627                          | (12.860)  | 12.860  | –  | –                               |
| Westpac Banking Corp        | 421.744   | (421.744)  | –  | –                               | (1.519.279)   | 421.744                                       | –  | (1.097.535)                     |
| <b>Insgesamt</b>            | <b>490.960</b>  | <b>(454.460)</b>                                 | <b>–</b>                                   | <b>36.500</b>                   | <b>(1.588.964)</b>  | <b>454.460</b>                                | <b>–</b>                                     | <b>(1.134.504)</b>              |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Equity (Fortsetzung)

31. Dezember 2023

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 1.253.492  | (118.963)   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>1.253.492</b>   | <b>(118.963)</b>  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei          | Vermögenswerte  |  |  |                                 | Verbindlichkeiten   |   |  |                                 |
|----------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
|                      | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ |
| Royal Bank of Canada | 103.962   | (35.323)   | –  | 68.639                          | (35.323)  | 35.323  | –  | –                               |
| UBS AG               | 1.114.639   | (46.969)   | –  | 1.067.670                       | (46.969)  | 46.969  | –  | –                               |
| Westpac Banking Corp | 34.891  | (34.891)   | –  | –                               | (36.671)  | 34.891  | –  | (1.780)                         |
| <b>Insgesamt</b>     | <b>1.253.492</b>  | <b>(117.183)</b>                                 | <b>–</b>                                   | <b>1.136.309</b>                | <b>(118.963)</b>  | <b>117.183</b>                                | <b>–</b>                                     | <b>(1.780)</b>                  |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Equity Premium

31. Dezember 2024

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 541.191  | (8.824.034)   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>541.191</b>   | <b>(8.824.034)</b>  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                 | Vermögenswerte  |  |  |                                 | Verbindlichkeiten   |   |  |                                 |
|-----------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
|                             | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ |
| Citibank NA                 | –   | –  | –  | –                               | (4.690)   | –   | –  | (4.690)                         |
| Goldman Sachs International | 180.845   | (96.654)   | –  | 84.191                          | (96.654)  | 96.654  | –  | –                               |
| Westpac Banking Corp        | 360.346   | (360.346)  | –  | –                               | (8.722.690)   | 360.346                                       | –  | (8.362.344)                     |
| <b>Insgesamt</b>            | <b>541.191</b>  | <b>(457.000)</b>                                 | <b>–</b>                                   | <b>84.191</b>                   | <b>(8.824.034)</b>  | <b>457.000</b>                                | <b>–</b>                                     | <b>(8.367.034)</b>              |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Equity Premium (Fortsetzung)

31. Dezember 2023

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 12.128.805   | (538.104)   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>12.128.805</b>  | <b>(538.104)</b>  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                 | Vermögenswerte  |  |  |                                 | Verbindlichkeiten   |   |  |                                 |
|-----------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
|                             | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ |
| Goldman Sachs International | 92.390  | (92.390)   | –  | –                               | (278.135)   | 92.390  | –  | (185.745)                       |
| Westpac Banking Corp        | 12.036.415  | (259.969)  | –  | 11.776.446                      | (259.969)   | 259.969                                       | –  | –                               |
| <b>Insgesamt</b>            | <b>12.128.805</b>   | <b>(352.359)</b>                                 | <b>–</b>                                   | <b>11.776.446</b>               | <b>(538.104)</b>  | <b>352.359</b>                                | <b>–</b>                                     | <b>(185.745)</b>                |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Large Cap Value

31. Dezember 2024

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 163.005  | (1.856.005)   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>163.005</b>   | <b>(1.856.005)</b>  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei             | Vermögenswerte  |  |  |                                 | Verbindlichkeiten   |   |  |                                 |
|-------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
|                         | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ |
| Citibank NA             | 20.648  | (20.648)   | –  | –                               | (31.741)  | 20.648  | –  | (11.093)                        |
| Standard Chartered Bank | 47.456  | (47.456)   | –  | –                               | (1.744.674)   | 47.456  | –  | (1.697.218)                     |
| Westpac Banking Corp    | 94.901  | (79.590)   | –  | 15.311                          | (79.590)  | 79.590  | –  | –                               |
| <b>Insgesamt</b>        | <b>163.005</b>  | <b>(147.694)</b>                                 | <b>–</b>                                   | <b>15.311</b>                   | <b>(1.856.005)</b>  | <b>147.694</b>                                | <b>–</b>                                     | <b>(1.708.311)</b>              |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Large Cap Value (Fortsetzung)

31. Dezember 2023

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 1.119.012  | (115.827)   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>1.119.012</b>   | <b>(115.827)</b>  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei             | Vermögenswerte  |  |  |                                 | Verbindlichkeiten   |   |  |                                 |
|-------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
|                         | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ |
| Standard Chartered Bank | 1.032.749   | (35.893)   | –  | 996.856                         | (35.893)  | 35.893  | –  | –                               |
| Westpac Banking Corp    | 86.263  | (79.934)   | –  | 6.329                           | (79.934)  | 79.934  | –  | –                               |
| <b>Insgesamt</b>        | <b>1.119.012</b>  | <b>(115.827)</b>                                 | <b>–</b>                                   | <b>1.003.185</b>                | <b>(115.827)</b>  | <b>115.827</b>                                | <b>–</b>                                     | <b>–</b>                        |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Long Short Equity

31. Dezember 2024

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 460.982  | (5.681.909)   |
| OTC-Kontrakt           | 9.764  | (882.248)   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>470.746</b>   | <b>(6.564.157)</b>  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                 | Vermögenswerte  |  |  |                                 | Verbindlichkeiten   |   |  |                                 |
|-----------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
|                             | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ |
| Citibank NA                 | –   | –  | –  | –                               | (1.213)   | –   | 1.213  | –                               |
| Goldman Sachs International | 44.239  | (44.239)   | –  | –                               | (90.924)  | 44.239  | 46.685                                       | –                               |
| JPMorgan Chase Bank         | 9.764   | (9.764)  | –  | –                               | (882.248)   | 9.764   | 872.484                                      | –                               |
| UBS AG                      | 37.508  | (37.508)   | –  | –                               | (5.229.038)   | 37.508  | –  | (5.191.530)                     |
| Westpac Banking Corp        | 379.235   | (360.734)  | –  | 18.501                          | (360.734)   | 360.734                                       | –  | –                               |
| <b>Insgesamt</b>            | <b>470.746</b>  | <b>(452.245)</b>                                 | <b>–</b>                                   | <b>18.501</b>                   | <b>(6.564.157)</b>  | <b>452.245</b>                                | <b>920.382</b>                               | <b>(5.191.530)</b>              |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Long Short Equity (Fortsetzung)

31. Dezember 2023

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte |  | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |  |
|------------------------|--|--|---|--|
|                        | US\$   |  | US\$  |  |
| Devisenterminkontrakte | 3.283.704  |  | (342.870)   |  |
| OTC-Kontrakt           | 624.429  |  | (7.376.089)   |  |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>3.908.133</b>   |  | <b>(7.718.959)</b>  |  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                 | Vermögenswerte  |  |  |                                 | Verbindlichkeiten   |   |  |                                 |
|-----------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
|                             | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ |
| Citibank NA                 | 59.547  | (41.584)   | –  | 17.963                          | (41.584)  | 41.584  | –  | –                               |
| Goldman Sachs International | 544.502   | (544.502)  | –  | –                               | (4.944.489)   | 544.502                                       | 4.399.987                                    | –                               |
| JPMorgan Chase Bank         | 60.931  | (60.931)   | –  | –                               | (2.392.877)   | 60.931  | 2.331.946                                    | –                               |
| UBS AG                      | 1.621.720   | (80.607)   | –  | 1.541.113                       | (80.607)  | 80.607  | –  | –                               |
| Westpac Banking Corp        | 1.621.433   | (259.402)  | –  | 1.362.031                       | (259.402)   | 259.402                                       | –  | –                               |
| <b>Insgesamt</b>            | <b>3.908.133</b>  | <b>(987.026)</b>                                 | <b>–</b>                                   | <b>2.921.107</b>                | <b>(7.718.959)</b>  | <b>987.026</b>                                | <b>6.731.933</b>                             | <b>–</b>                        |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Multi Cap Opportunities

31. Dezember 2024

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 500.460  | (3.544.061)   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>500.460</b>   | <b>(3.544.061)</b>  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                 | Vermögenswerte   |   |                                       |                            | Verbindlichkeiten  |  |   |                            |
|-----------------------------|--|---|---------------------------------------|----------------------------|--|--|---|----------------------------|
|                             | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> | Nettobetrag <sup>(b)</sup> | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> | Nettobetrag <sup>(b)</sup> |
|                             |  |   |                                       |                            |  |  |   |                            |
| Goldman Sachs International | 44.041   | (44.041)                                    | –                                     | –                          | (416.813)  | 44.041                                   | –                                       | (372.772)                  |
| UBS AG                      | 184.621  | (184.621)                                   | –                                     | –                          | (310.463)  | 184.621                                  | –                                       | (125.842)                  |
| Westpac Banking Corp        | 271.798  | (271.798)                                   | –                                     | –                          | (2.816.785)  | 271.798                                  | –                                       | (2.544.987)                |
| <b>Insgesamt</b>            | <b>500.460</b>   | <b>(500.460)</b>                            | <b>–</b>                              | <b>–</b>                   | <b>(3.544.061)</b>   | <b>500.460</b>                           | <b>–</b>                                | <b>(3.043.601)</b>         |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

31. Dezember 2023

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 1.843.892  | (325.170)   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>1.843.892</b>   | <b>(325.170)</b>  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                 | Vermögenswerte   |   |   |                                    | Verbindlichkeiten  |  |   |                                    |
|-----------------------------|--|---|---|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|
|                             | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge<br>US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten<br>US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup><br>US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge<br>US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte<br>US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup><br>US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>US\$ |
|                             |  |   |   |                                    |  |  |   |                                    |
| Goldman Sachs International | 1.114.025  | (44.932)  | –   | 1.069.093                          | (44.932)   | 44.932   | –   | –                                  |
| UBS AG                      | 178.194  | (24.196)  | –   | 153.998                            | (24.196)   | 24.196   | –   | –                                  |
| Westpac Banking Corp        | 551.673  | (256.042)   | –   | 295.631                            | (256.042)  | 256.042  | –   | –                                  |
| <b>Insgesamt</b>            | <b>1.843.892</b>   | <b>(325.170)</b>                                    | <b>–</b>                                      | <b>1.518.722</b>                   | <b>(325.170)</b>   | <b>325.170</b>                                   | <b>–</b>  | <b>–</b>                           |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities

31. Dezember 2024

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 1.269.806  | (4.322.763)   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>1.269.806</b>   | <b>(4.322.763)</b>  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                 | Vermögenswerte  |  |  |                                 | Verbindlichkeiten   |   |  |                                 |
|-----------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
|                             | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ |
| Goldman Sachs International | 296.062   | (296.062)  | –  | –                               | (1.353.665)   | 296.062                                       | –  | (1.057.603)                     |
| UBS AG                      | 116.181   | (116.181)  | –  | –                               | (2.120.807)   | 116.181                                       | –  | (2.004.626)                     |
| Westpac Banking Corp        | 857.563   | (848.291)  | –  | 9.272                           | (848.291)   | 848.291                                       | –  | –                               |
| <b>Insgesamt</b>            | <b>1.269.806</b>  | <b>(1.260.534)</b>                               | <b>–</b>                                   | <b>9.272</b>                    | <b>(4.322.763)</b>  | <b>1.260.534</b>                              | <b>–</b>                                     | <b>(3.062.229)</b>              |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

31. Dezember 2023

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte |  | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |  |
|------------------------|--|--|---|--|
|                        | US\$   |  | US\$  |  |
| Devisenterminkontrakte | 2.358.847  |  | (441.683)   |  |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>2.358.847</b>   |  | <b>(441.683)</b>  |  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                 | Vermögenswerte   |   |   |                                    | Verbindlichkeiten  |  |   |                                    |
|-----------------------------|--|---|---|------------------------------------|--|--|---|------------------------------------|
|                             | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge<br>US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten<br>US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup><br>US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge<br>US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte<br>US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup><br>US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup><br>US\$ |
|                             |  |   |   |                                    |  |  |   |                                    |
| Goldman Sachs International | 935.666  | (123.497)   | –   | 812.169                            | (123.497)  | 123.497  | –   | –                                  |
| UBS AG                      | 321.901  | (132.714)   | –   | 189.187                            | (132.714)  | 132.714  | –   | –                                  |
| Westpac Banking Corp        | 1.101.280  | (185.472)   | –   | 915.808                            | (185.472)  | 185.472  | –   | –                                  |
| <b>Insgesamt</b>            | <b>2.358.847</b>   | <b>(441.683)</b>                                    | <b>–</b>                                      | <b>1.917.164</b>                   | <b>(441.683)</b>   | <b>441.683</b>                                   | <b>–</b>  | <b>–</b>                           |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Small Cap

31. Dezember 2024

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 281.334  | (1.942.634)   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>281.334</b>   | <b>(1.942.634)</b>  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                 | Vermögenswerte  |  |  |                                 | Verbindlichkeiten   |   |  |                                 |
|-----------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
|                             | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ |
| Goldman Sachs International | 45.132  | (45.132)   | –  | –                               | (114.030)   | 45.132  | –  | (68.898)                        |
| UBS AG                      | 32.333  | (32.333)   | –  | –                               | (310.666)   | 32.333  | –  | (278.333)                       |
| Westpac Banking Corp        | 203.869   | (203.869)  | –  | –                               | (1.517.938)   | 203.869                                       | –  | (1.314.069)                     |
| <b>Insgesamt</b>            | <b>281.334</b>  | <b>(281.334)</b>                                 | <b>–</b>                                   | <b>–</b>                        | <b>(1.942.634)</b>  | <b>281.334</b>                                | <b>–</b>                                     | <b>(1.661.300)</b>              |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Small Cap (Fortsetzung)

31. Dezember 2023

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 747.370  | (137.144)   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>747.370</b>   | <b>(137.144)</b>  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                 | Vermögenswerte  |  |  |                                 | Verbindlichkeiten   |   |  |                                 |
|-----------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
|                             | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ |
| Goldman Sachs International | 110.085   | (31.210)   | –  | 78.875                          | (31.210)  | 31.210  | –  | –                               |
| UBS AG                      | 209.485   | (22.829)   | –  | 186.656                         | (22.829)  | 22.829  | –  | –                               |
| Westpac Banking Corp        | 427.800   | (83.105)   | –  | 344.695                         | (83.105)  | 83.105  | –  | –                               |
| <b>Insgesamt</b>            | <b>747.370</b>  | <b>(137.144)</b>                                 | <b>–</b>                                   | <b>610.226</b>                  | <b>(137.144)</b>  | <b>137.144</b>                                | <b>–</b>                                     | <b>–</b>                        |

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Small Cap Intrinsic Value

31. Dezember 2024

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | 42.287   | (547.761)   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>42.287</b>  | <b>(547.761)</b>  |

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei                 | Vermögenswerte  |  |  |                                 | Verbindlichkeiten   |   |  |                                 |
|-----------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
|                             | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ |
| Goldman Sachs International | 30.885  | (30.885)   | –  | –                               | (32.426)  | 30.885  | –  | (1.541)                         |
| UBS AG                      | 9.583   | (9.583)  | –  | –                               | (21.052)  | 9.583   | –  | (11.469)                        |
| Westpac Banking Corp        | 1.819   | (1.819)  | –  | –                               | (494.283)   | 1.819   | –  | (492.464)                       |
| <b>Insgesamt</b>            | <b>42.287</b>   | <b>(42.287)</b>                                  | <b>–</b>                                   | <b>–</b>                        | <b>(547.761)</b>  | <b>42.287</b>                                 | <b>–</b>                                     | <b>(505.474)</b>                |

## FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

## 26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

## US Small Cap Intrinsic Value (Fortsetzung)

## 31. Dezember 2023

| Beschreibung           | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte | Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten |
|------------------------|--|---|
|                        | US\$   | US\$  |
| Devisenterminkontrakte | –  | (398)   |
| <b>Insgesamt</b>       | <b>–</b>   | <b>(398)</b>  |

## Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

| Gegenpartei             | Vermögenswerte  |  |  |                                 | Verbindlichkeiten   |   |  |                                 |
|-------------------------|---|--|--|---------------------------------|---|---|--|---------------------------------|
|                         | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US\$ | Erhaltene Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ | In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US\$ | Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US\$ | Verpfändete Sicherheiten <sup>(a)</sup> US\$ | Nettobetrag <sup>(b)</sup> US\$ |
| Brown Brothers Harriman | –   | –  | –  | –                               | (398)   | –   | –  | (398)                           |
| <b>Insgesamt</b>        | <b>–</b>  | <b>–</b>   | <b>–</b>                                   | <b>–</b>                        | <b>(398)</b>  | <b>–</b>                                      | <b>–</b>                                     | <b>(398)</b>                    |

a) Die erhaltenen (oder verpfändeten) Sicherheiten sind auf einen Betrag begrenzt, der 100 % des Nettobetrags der Vermögenswerte (oder Verbindlichkeiten) in den oben dargestellten Tabellen für die jeweilige Gegenpartei nicht überschreiten darf.

b) Ein Nettobetrag größer als null entspricht den Beträgen, die bei einem Ausfall einer Gegenpartei zum 31. Dezember 2024 bzw. zum 31. Dezember 2023 einem Verlust unterliegen. Ein Nettobetrag kleiner als null entspricht für jede Gegenpartei unterbesicherten Beträgen zum 31. Dezember 2024 bzw. zum 31. Dezember 2023.

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

**FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2024 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR**

**27. GESCHLOSSENE FONDS**

Neben den in diesem Bericht aufgeführten Fonds gibt es eine Reihe geschlossener Teilfonds, deren Zulassung noch nicht zurückgenommen wurde. Eine vollständige Liste dieser Fonds ist nachstehend angegeben. Am Ende des Geschäftsjahres zum 31. Dezember 2024 hielt einer dieser Teilfonds, der Lehman Brothers Commodity Plus Fund, einen Betrag in Höhe von 2,02 Mio. US\$ (31. Dezember 2023: 1,93 Mio. US\$) auf einem Konto bei der Verwahrstelle in Zusammenhang mit einem noch nicht beigelegten Rechtsstreit hinsichtlich einer Derivate-Transaktion.

- Lehman Brothers Commodity Plus Fund
- Lehman Brothers Alpha Select 2 Fund
- Lehman Brothers Alpha Select 4 Fund

# Anhang I

## GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT)

Für das zum 31. Dezember 2024 endende Geschäftsjahr basieren die Gesamtkostenquoten („TERs“) auf die den angegebenen Daten vorangegangenen zwölf Monate.

### 31. Dezember 2024

#### Asia Responsible Transition Bond

| Anteilklasse                            | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|---|---|--|
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)  | 1,64 %  | 1,35 %   |
| Thesaurierende Klasse USD A             | 1,65 %  | 1,35 %   |
| Thesaurierende Klasse USD C1            | 2,63 %  | 2,35 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I             | 1,06 %  | 0,75 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I              | 1,06 %  | 0,75 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich) | 0,81 %  | 0,51 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I4            | 0,89 %  | 0,51 %   |
| Thesaurierende Klasse USD M             | 2,24 %  | 1,95 %   |
| Ausschüttende Klasse USD X (Monatlich)  | 1,55 %  | 1,25 %   |
| Thesaurierende Klasse USD X             | 1,56 %  | 1,25 %   |
| Thesaurierende Klasse USD Z             | 0,41 %  | 0,15 %   |

#### China A-Share Equity

|   |        |        |
|---|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse CNY I                           | 8,01 % | 1,20 % |
| Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) | 8,75 % | 1,20 % |
| Ausschüttende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)  | 8,01 % | 1,20 % |

#### China Bond

|  |        |        |
|--|--------|--------|
| Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)                           | 1,91 % | 1,50 % |
| Ausschüttende Klasse CNY I                                       | 1,27 % | 0,85 % |
| Thesaurierende Klasse CNY Z                                      | 0,60 % | 0,20 % |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) (nicht währungsgesichert) | 1,91 % | 1,50 % |
| Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)            | 1,16 % | 0,85 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z                                      | 0,54 % | 0,20 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z (nicht währungsgesichert)            | 0,55 % | 0,20 % |

#### China Equity

|                             |        |        |
|-----------------------------|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse CHF I | 1,28 % | 1,28 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A | 2,03 % | 2,03 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 1,28 % | 1,28 % |

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2024

## China Equity (Fortsetzung)

| Anteilklasse                 | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|------------------------------|---|--|
| Thesaurierende Klasse EUR Z  | 0,17 %  | 0,17 %   |
| Thesaurierende Klasse SGD A  | 2,04 %  | 2,04 %   |
| Thesaurierende Klasse USD A  | 2,03 %  | 2,03 %   |
| Ausschüttende Klasse USD A   | 2,03 %  | 2,03 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I  | 1,29 %  | 1,29 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 1,07 %  | 1,07 %   |
| Thesaurierende Klasse USD M  | 3,01 %  | 3,01 %   |
| Thesaurierende Klasse USD U  | 1,63 %  | 1,63 %   |
| Thesaurierende Klasse USD Z  | 0,18 %  | 0,18 %   |

Climate Innovation<sup>1</sup>

|                              |        |        |
|------------------------------|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse USD A  | 6,66 % | 1,90 % |
| Thesaurierende Klasse USD I  | 5,80 % | 1,05 % |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 5,37 % | 0,62 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z  | 4,95 % | 0,20 % |

## CLO Income

|  |        |        |
|--|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR A                          | 1,58 % | 1,58 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I                          | 0,84 % | 0,84 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I2                          | 0,69 % | 0,69 % |
| Thesaurierende Klasse EUR X                          | 0,48 % | 0,48 % |
| Ausschüttende Klasse EUR X                           | 0,49 % | 0,49 % |
| Thesaurierende Klasse GBP Z                          | 0,09 % | 0,09 % |
| Ausschüttende Klasse JPY I                           | 0,83 % | 0,83 % |
| Ausschüttende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert) | 0,83 % | 0,83 % |
| Thesaurierende Klasse SEK I                          | 0,83 % | 0,83 % |
| Thesaurierende Klasse USD A                          | 1,58 % | 1,58 % |
| Thesaurierende Klasse USD I                          | 0,84 % | 0,84 % |
| Ausschüttende Klasse USD I                           | 0,84 % | 0,84 % |
| Ausschüttende Klasse USD I2                          | 0,69 % | 0,69 % |
| Thesaurierende Klasse USD I4                         | 0,53 % | 0,53 % |
| Ausschüttende Klasse USD I5                          | 0,47 % | 0,47 % |
| Thesaurierende Klasse USD U                          | 1,23 % | 1,23 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z                          | 0,09 % | 0,09 % |

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2024

## Commodities

| Anteilklasse   | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|--|---|--|
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)  | 0,80 %  | 0,80 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP I2                           | 0,73 %  | 0,72 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert) | 0,64 %  | 0,64 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP I5                           | 0,48 %  | 0,48 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP P                            | 0,76 %  | 0,76 %   |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 1,55 %  | 1,55 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 0,80 %  | 0,80 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I3                           | 0,63 %  | 0,63 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I5                           | 0,48 %  | 0,48 %   |
| Thesaurierende Klasse USD M                            | 2,15 %  | 2,15 %   |
| Thesaurierende Klasse USD Z                            | 0,15 %  | 0,15 %   |

## Corporate Hybrid Bond

|  |        |        |
|--|--------|--------|
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | 1,26 % | 1,26 % |
| Ausschüttende Klasse CHF A             | 1,26 % | 1,26 % |
| Thesaurierende Klasse CHF I3           | 0,48 % | 0,48 % |
| Thesaurierende Klasse CHF P            | 0,63 % | 0,63 % |
| Ausschüttende Klasse CHF P             | 0,63 % | 0,63 % |
| Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) | 1,26 % | 1,26 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A            | 1,26 % | 1,26 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I            | 0,66 % | 0,66 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I             | 0,66 % | 0,66 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I2           | 0,54 % | 0,54 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I2            | 0,54 % | 0,54 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I3           | 0,48 % | 0,48 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I5           | 0,36 % | 0,36 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M            | 1,86 % | 1,86 % |
| Ausschüttende Klasse EUR M             | 1,86 % | 1,86 % |
| Thesaurierende Klasse EUR P            | 0,64 % | 0,64 % |
| Ausschüttende Klasse EUR P             | 0,63 % | 0,63 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I            | 0,66 % | 0,66 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I2           | 0,55 % | 0,55 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I2            | 0,55 % | 0,55 % |
| Thesaurierende Klasse GBP P            | 0,63 % | 0,63 % |

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2024

## Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

| Anteilklasse                           | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|--|---|--|
| Ausschüttende Klasse GBP P             | 0,63 %  | 0,63 %   |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | 1,26 %  | 1,26 %   |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 1,26 %  | 1,26 %   |
| Thesaurierende Klasse USD A            | 1,26 %  | 1,26 %   |
| Ausschüttende Klasse USD A             | 1,26 %  | 1,26 %   |
| Thesaurierende Klasse USD C1           | 2,26 %  | 2,26 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) | 0,65 %  | 0,65 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I            | 0,66 %  | 0,66 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I             | 0,66 %  | 0,66 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I2           | 0,54 %  | 0,54 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I2            | 0,54 %  | 0,54 %   |
| Thesaurierende Klasse USD M            | 1,86 %  | 1,86 %   |
| Ausschüttende Klasse USD M             | 1,86 %  | 1,86 %   |
| Thesaurierende Klasse USD P            | 0,64 %  | 0,64 %   |
| Thesaurierende Klasse USD Z            | 0,07 %  | 0,07 %   |

Developed Market FMP – 2027<sup>1</sup>

|                             |        |        |
|-----------------------------|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR A | 0,80 % | 0,80 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I  | 0,45 % | 0,45 % |
| Thesaurierende Klasse USD A | 0,80 % | 0,80 % |
| Ausschüttende Klasse USD A  | 0,80 % | 0,80 % |
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,45 % | 0,45 % |
| Ausschüttende Klasse USD I  | 0,45 % | 0,45 % |
| Thesaurierende Klasse USD X | 0,55 % | 0,55 % |

## EMD Corporate – Social and Environmental Transition

|                              |        |        |
|------------------------------|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse CHF I  | 1,07 % | 1,00 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A  | 1,87 % | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I  | 1,08 % | 1,00 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I3 | 0,75 % | 0,68 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M  | 2,67 % | 2,60 % |
| Ausschüttende Klasse EUR M   | 2,67 % | 2,60 % |
| Thesaurierende Klasse EUR X  | 0,63 % | 0,45 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I  | 1,04 % | 1,00 % |

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2024

EMD Corporate – Social and Environmental Transition (Fortsetzung)

| Anteilklasse   | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|--|---|--|
| Thesaurierende Klasse SEK A                            | 1,87 %  | 1,80 %   |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)                 | 1,87 %  | 1,80 %   |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 1,87 %  | 1,80 %   |
| Thesaurierende Klasse USD C1                           | 2,87 %  | 2,80 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 1,07 %  | 1,00 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I                             | 1,07 %  | 1,00 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I2                           | 0,91 %  | 0,84 %   |
| Thesaurierende Klasse USD M                            | 2,66 %  | 2,60 %   |
| Ausschüttende Klasse USD M                             | 2,67 %  | 2,60 %   |
| <b>Emerging Market Debt - Hard Currency</b>            |   |  |
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)                 | 1,48 %  | 1,48 %   |
| Ausschüttende Klasse AUD I                             | 0,79 %  | 0,79 %   |
| Thesaurierende Klasse CAD I3 (nicht währungsgesichert) | 0,57 %  | 0,57 %   |
| Thesaurierende Klasse CHF I2                           | 0,64 %  | 0,64 %   |
| Thesaurierende Klasse CHF P                            | 0,74 %  | 0,74 %   |
| Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)                 | 1,48 %  | 1,48 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR A                            | 1,48 %  | 1,48 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I                            | 0,78 %  | 0,78 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)  | 0,77 %  | 0,77 %   |
| Ausschüttende Klasse EUR I                             | 0,78 %  | 0,78 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I2                           | 0,64 %  | 0,64 %   |
| Ausschüttende Klasse EUR I2                            | 0,64 %  | 0,64 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I3                           | 0,57 %  | 0,57 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I4                           | 0,49 %  | 0,49 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert) | 0,43 %  | 0,43 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR M                            | 2,28 %  | 2,28 %   |
| Ausschüttende Klasse EUR M                             | 2,28 %  | 2,28 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR P                            | 0,74 %  | 0,74 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR Z                            | 0,08 %  | 0,08 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP I                            | 0,78 %  | 0,78 %   |
| Ausschüttende Klasse GBP I                             | 0,78 %  | 0,78 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP I2                           | 0,64 %  | 0,64 %   |
| Ausschüttende Klasse GBP I2                            | 0,64 %  | 0,64 %   |

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2024

## Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

| Anteilklasse                           | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|--|---|--|
| Thesaurierende Klasse GBP P            | 0,74 %  | 0,74 %   |
| Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) | 1,47 %  | 1,47 %   |
| Thesaurierende Klasse JPY I            | 0,78 %  | 0,78 %   |
| Thesaurierende Klasse SEK A            | 1,48 %  | 1,48 %   |
| Thesaurierende Klasse SEK I2           | 0,64 %  | 0,64 %   |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | 1,47 %  | 1,47 %   |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 1,48 %  | 1,48 %   |
| Thesaurierende Klasse USD A            | 1,48 %  | 1,48 %   |
| Ausschüttende Klasse USD A             | 1,48 %  | 1,48 %   |
| Thesaurierende Klasse USD C1           | 2,48 %  | 2,48 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I            | 0,78 %  | 0,78 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I             | 0,78 %  | 0,78 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I2           | 0,64 %  | 0,64 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I2            | 0,64 %  | 0,64 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I3            | 0,57 %  | 0,57 %   |
| Thesaurierende Klasse USD M            | 2,28 %  | 2,28 %   |
| Ausschüttende Klasse USD M             | 2,28 %  | 2,28 %   |
| Thesaurierende Klasse USD P            | 0,74 %  | 0,74 %   |
| Thesaurierende Klasse USD X            | 0,45 %  | 0,45 %   |
| Thesaurierende Klasse USD Z            | 0,08 %  | 0,08 %   |

## Emerging Market Debt - Local Currency

|  |        |        |
|--|--------|--------|
| Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich)                 | 2,95 % | 2,95 % |
| Thesaurierende Klasse AUD B                            | 2,95 % | 2,95 % |
| Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)                 | 2,95 % | 2,95 % |
| Thesaurierende Klasse AUD E                            | 2,95 % | 2,95 % |
| Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)                 | 1,95 % | 1,95 % |
| Thesaurierende Klasse AUD T                            | 1,95 % | 1,95 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A                            | 1,65 % | 1,65 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I                            | 0,90 % | 0,90 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)  | 0,90 % | 0,90 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert) | 0,75 % | 0,75 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)  | 0,60 % | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse EUR Y (nicht währungsgesichert)  | 0,51 % | 0,51 % |

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2024

## Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

| Anteilklasse   | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|--|---|--|
| Thesaurierende Klasse GBP I                            | 0,90 %  | 0,90 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) | 0,60 %  | 0,60 %   |
| Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)  | 0,61 %  | 0,61 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)  | 0,51 %  | 0,51 %   |
| Thesaurierende Klasse SEK A                            | 1,65 %  | 1,65 %   |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)                 | 1,65 %  | 1,65 %   |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)                 | 1,65 %  | 1,65 %   |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 1,65 %  | 1,65 %   |
| Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich)                 | 2,95 %  | 2,95 %   |
| Thesaurierende Klasse USD B                            | 2,95 %  | 2,95 %   |
| Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)                 | 2,95 %  | 2,95 %   |
| Thesaurierende Klasse USD E                            | 2,95 %  | 2,95 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)                 | 0,90 %  | 0,90 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 0,90 %  | 0,90 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I                             | 0,90 %  | 0,90 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I2                           | 0,75 %  | 0,75 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I5                           | 0,50 %  | 0,50 %   |
| Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)                 | 1,95 %  | 1,95 %   |
| Thesaurierende Klasse USD T                            | 1,95 %  | 1,95 %   |
| Thesaurierende Klasse USD X                            | 0,52 %  | 0,47 %   |
| Thesaurierende Klasse USD Y                            | 0,51 %  | 0,51 %   |
| Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)                 | 2,95 %  | 2,95 %   |
| Thesaurierende Klasse ZAR B                            | 2,95 %  | 2,95 %   |
| Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)                 | 2,95 %  | 2,95 %   |
| Thesaurierende Klasse ZAR E                            | 2,95 %  | 2,95 %   |
| Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)                 | 1,95 %  | 1,95 %   |
| Thesaurierende Klasse ZAR T                            | 1,95 %  | 1,95 %   |

## Emerging Market Debt Blend

|                              |        |        |
|------------------------------|--------|--------|
| Ausschüttende Klasse AUD I3  | 0,66 % | 0,66 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A  | 1,57 % | 1,57 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I  | 0,87 % | 0,87 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I   | 0,87 % | 0,87 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 | 0,73 % | 0,73 % |

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2024

## Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

| Anteilklasse   | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|--|---|--|
| Ausschüttende Klasse EUR I2                            | 0,73 %  | 0,73 %   |
| Ausschüttende Klasse EUR I3                            | 0,66 %  | 0,66 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert) | 0,59 %  | 0,59 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I5                           | 0,52 %  | 0,52 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR M                            | 2,36 %  | 2,36 %   |
| Ausschüttende Klasse EUR M                             | 2,36 %  | 2,36 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR Z                            | 0,17 %  | 0,17 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP I                            | 0,87 %  | 0,87 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)  | 0,82 %  | 0,82 %   |
| Ausschüttende Klasse GBP I                             | 0,88 %  | 0,88 %   |
| Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)   | 0,86 %  | 0,86 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP P                            | 0,84 %  | 0,84 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)  | 0,84 %  | 0,84 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP Z                            | 0,18 %  | 0,18 %   |
| Thesaurierende Klasse NOK U                            | 1,21 %  | 1,21 %   |
| Thesaurierende Klasse SEK A                            | 1,57 %  | 1,57 %   |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)                 | 1,57 %  | 1,57 %   |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)                 | 1,56 %  | 1,56 %   |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 1,57 %  | 1,57 %   |
| Thesaurierende Klasse USD C1                           | 2,57 %  | 2,57 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 0,87 %  | 0,87 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I                             | 0,87 %  | 0,87 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I2                            | 0,73 %  | 0,73 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I5                           | 0,52 %  | 0,52 %   |
| Thesaurierende Klasse USD M                            | 2,37 %  | 2,37 %   |
| Ausschüttende Klasse USD M                             | 2,37 %  | 2,37 %   |
| Thesaurierende Klasse USD Z                            | 0,17 %  | 0,17 %   |

## Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend

|                              |        |        |
|------------------------------|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse AUD I2 | 0,81 % | 0,68 % |
| Thesaurierende Klasse NOK I  | 0,94 % | 0,80 % |
| Thesaurierende Klasse NOK I3 | 0,75 % | 0,62 % |
| Thesaurierende Klasse USD I  | 0,94 % | 0,80 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z  | 0,35 % | 0,20 % |

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2024

## Emerging Markets Equity

| Anteilklasse   | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|--|---|--|
| Thesaurierende Klasse AUD B                          | 3,46 %  | 3,30 %   |
| Thesaurierende Klasse AUD E                          | 3,51 %  | 3,30 %   |
| Thesaurierende Klasse AUD T                          | 2,46 %  | 2,30 %   |
| Ausschüttende Klasse CAD I (nicht währungsgesichert) | 1,45 %  | 1,30 %   |
| Ausschüttende Klasse CAD I2                          | 1,26 %  | 1,10 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I                          | 1,43 %  | 1,30 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR M                          | 3,46 %  | 3,30 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR Z                          | 0,45 %  | 0,30 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP I                          | 1,57 %  | 1,30 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP Z                          | 0,46 %  | 0,30 %   |
| Thesaurierende Klasse USD A                          | 2,50 %  | 2,30 %   |
| Thesaurierende Klasse USD B                          | 3,43 %  | 3,30 %   |
| Thesaurierende Klasse USD E                          | 3,41 %  | 3,30 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I                          | 1,46 %  | 1,30 %   |
| Thesaurierende Klasse USD M                          | 3,40 %  | 3,30 %   |
| Thesaurierende Klasse USD T                          | 2,47 %  | 2,30 %   |
| Thesaurierende Klasse USD Z                          | 0,45 %  | 0,30 %   |
| Thesaurierende Klasse ZAR B                          | 3,43 %  | 3,30 %   |
| Thesaurierende Klasse ZAR E                          | 3,48 %  | 3,30 %   |
| Thesaurierende Klasse ZAR T                          | 2,45 %  | 2,30 %   |

## Euro Bond

|                             |        |        |
|-----------------------------|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR A | 0,91 % | 0,90 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 0,57 % | 0,55 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I  | 1,03 % | 0,55 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 1,48 % | 1,48 % |
| Thesaurierende Klasse EUR Z | 0,31 % | 0,20 % |

## Euro Bond Absolute Return

|                              |        |        |
|------------------------------|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR A  | 1,08 % | 1,08 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I  | 0,66 % | 0,65 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I   | 0,71 % | 0,65 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 | 0,53 % | 0,53 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 | 0,48 % | 0,43 % |

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2024

## Euro Bond Absolute Return (Fortsetzung)

| Anteilklasse                | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|-----------------------------|---|--|
| Thesaurierende Klasse EUR Z | 0,21 %  | 0,20 %   |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,28 %  | 0,20 %   |

## European High Yield Bond

|  |        |        |
|--|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse CHF I            | 0,69 % | 0,69 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I            | 0,69 % | 0,69 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I2           | 0,56 % | 0,56 % |
| Ausschüttende EUR I5                   | 0,38 % | 0,38 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M            | 1,89 % | 1,89 % |
| Thesaurierende Klasse EUR X            | 0,29 % | 0,29 % |
| Thesaurierende Klasse EUR Y            | 0,19 % | 0,19 % |
| Ausschüttende Klasse EUR Y             | 0,19 % | 0,19 % |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 1,29 % | 1,29 % |
| Thesaurierende Klasse USD I            | 0,68 % | 0,68 % |
| Thesaurierende Klasse USD X            | 0,29 % | 0,29 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z            | 0,09 % | 0,09 % |

## European Sustainable Equity

|   |        |        |
|---|--------|--------|
| Ausschüttende Klasse EUR A                            | 1,61 % | 1,61 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I                           | 0,71 % | 0,71 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I                            | 0,69 % | 0,69 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I3                           | 0,54 % | 0,54 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I5                          | 0,42 % | 0,42 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M                           | 2,42 % | 2,42 % |
| Thesaurierende Klasse EUR Z                           | 0,12 % | 0,12 % |
| Thesaurierende Klasse USD A (nicht währungsgesichert) | 1,58 % | 1,58 % |
| Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) | 0,68 % | 0,68 % |
| Thesaurierende Klasse USD M (nicht währungsgesichert) | 2,39 % | 2,39 % |

## Event Driven

|                              |        |        |
|------------------------------|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR I  | 1,12 % | 1,12 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I5  | 0,63 % | 0,63 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I5 | 0,65 % | 0,65 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I5  | 0,62 % | 0,62 % |

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2024

## Event Driven (Fortsetzung)

| Anteilklasse                 | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|------------------------------|---|--|
| Thesaurierende Klasse GBP P  | 1,09 %  | 1,09 %   |
| Thesaurierende Klasse JPY I  | 1,09 %  | 1,09 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I  | 1,13 %  | 1,13 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 0,63 %  | 0,63 %   |

## Global Bond

|   |        |        |
|---|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR I Benchmark Währungsgesicherte Klasse | 0,45 % | 0,40 % |
| Ausschüttende Klasse GBP P                                      | 0,41 % | 0,39 % |
| Thesaurierende Klasse USD C1                                    | 1,67 % | 1,60 % |
| Thesaurierende Klasse USD I Benchmark Währungsgesicherte Klasse | 0,46 % | 0,40 % |
| Thesaurierende Klasse USD I                                     | 0,48 % | 0,40 % |
| Thesaurierende Klasse USD M                                     | 1,06 % | 1,00 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z                                     | 0,27 % | 0,20 % |

## Global Equity Megatrends

|  |        |        |
|--|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)  | 1,73 % | 1,73 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I                            | 0,95 % | 0,95 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)  | 2,55 % | 2,55 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) | 0,62 % | 0,62 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)  | 0,61 % | 0,61 % |
| Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)  | 0,90 % | 0,90 % |
| Thesaurierende Klasse HKD A                            | 1,82 % | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse SGD A                            | 1,74 % | 1,74 % |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 1,75 % | 1,75 % |
| Thesaurierende Klasse USD C1                           | 2,76 % | 2,76 % |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 0,95 % | 0,95 % |
| Thesaurierende Klasse USD I4                           | 0,62 % | 0,62 % |
| Thesaurierende Klasse USD M                            | 2,55 % | 2,55 % |
| Thesaurierende Klasse USD U                            | 1,33 % | 1,33 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z                            | 0,15 % | 0,15 % |

## Global Flexible Credit Income

|                              |        |        |
|------------------------------|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse CAD I5 | 0,40 % | 0,40 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I  | 0,70 % | 0,70 % |

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2024

## Global Flexible Credit Income (Fortsetzung)

| Anteilklasse                           | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|--|---|--|
| Thesaurierende Klasse EUR M            | 2,10 %  | 2,10 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP I5           | 0,40 %  | 0,40 %   |
| Ausschüttende Klasse GBP P             | 0,66 %  | 0,66 %   |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 1,29 %  | 1,29 %   |
| Thesaurierende Klasse USD A            | 1,30 %  | 1,30 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I            | 0,70 %  | 0,70 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I             | 0,70 %  | 0,70 %   |
| Thesaurierende Klasse USD M            | 2,10 %  | 2,10 %   |
| Thesaurierende Klasse USD U            | 0,99 %  | 0,99 %   |
| Thesaurierende Klasse USD Z            | 0,10 %  | 0,10 %   |

## Global High Yield Engagement

|                                  |        |        |
|----------------------------------|--------|--------|
| Ausschüttende Klasse AUD I       | 0,68 % | 0,68 % |
| Thesaurierende Klasse AUD I4     | 0,46 % | 0,46 % |
| Thesaurierende Klasse CHF I4     | 0,47 % | 0,47 % |
| Ausschüttende Klasse CHF I4      | 0,47 % | 0,47 % |
| Thesaurierende Klasse CHF X      | 1,19 % | 1,19 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I4     | 0,47 % | 0,47 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I4      | 0,47 % | 0,47 % |
| Thesaurierende Klasse EUR X      | 1,19 % | 1,19 % |
| Thesaurierende Klasse EUR Z (PF) | 0,20 % | 0,20 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I4     | 0,47 % | 0,47 % |
| Thesaurierende Klasse GBP X      | 1,18 % | 1,18 % |
| Thesaurierende Klasse USD A      | 1,29 % | 1,29 % |
| Thesaurierende Klasse USD I      | 0,70 % | 0,70 % |
| Thesaurierende Klasse USD I4     | 0,47 % | 0,47 % |
| Ausschüttende Klasse USD M       | 1,90 % | 1,90 % |
| Thesaurierende Klasse USD X      | 1,18 % | 1,18 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z      | 0,10 % | 0,10 % |

## Global Investment Grade Credit

|                             |        |        |
|-----------------------------|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR I | 0,44 % | 0,20 % |
| Ausschüttende Klasse GBP P  | 0,46 % | 0,44 % |
| Ausschüttende Klasse GBP X  | 0,25 % | 0,20 % |

## Anhang I (Fortsetzung)

### GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2024

#### Global Investment Grade Credit (Fortsetzung)

| Anteilklasse                | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|-----------------------------|---|--|
| Thesaurierende Klasse USD I | 0,47 %  | 0,45 %   |
| Thesaurierende Klasse USD X | 0,28 %  | 0,20 %   |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,18 %  | 0,15 %   |

#### Global Opportunistic Bond

|                              |        |        |
|------------------------------|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR I  | 0,69 % | 0,50 % |
| Thesaurierende Klasse GBP P  | 0,69 % | 0,48 % |
| Thesaurierende Klasse USD A  | 1,00 % | 0,80 % |
| Thesaurierende Klasse USD I  | 0,69 % | 0,50 % |
| Ausschüttende Klasse USD I   | 0,70 % | 0,50 % |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 0,65 % | 0,44 % |
| Ausschüttende Klasse USD I2  | 0,62 % | 0,44 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z  | 0,40 % | 0,20 % |

#### Global Sustainable Equity

|  |        |        |
|--|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert) | 0,42 % | 0,42 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)  | 2,43 % | 2,43 % |
| Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert)  | 0,13 % | 0,13 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)  | 0,73 % | 0,73 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert) | 0,43 % | 0,43 % |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 1,61 % | 1,61 % |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 0,72 % | 0,72 % |
| Ausschüttende Klasse USD I                             | 0,72 % | 0,72 % |
| Thesaurierende Klasse USD M                            | 2,41 % | 2,41 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z                            | 0,13 % | 0,13 % |

#### Global Value

|  |        |        |
|--|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR M                            | 2,05 % | 1,90 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert) | 0,55 % | 0,43 % |
| Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)  | 0,75 % | 0,63 % |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 1,24 % | 1,10 % |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 0,80 % | 0,65 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z                            | 0,34 % | 0,20 % |

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2024

## High Yield Bond

| Anteilklasse                             | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|--|---|--|
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)   | 1,29 %  | 1,29 %   |
| Thesaurierende Klasse AUD A              | 1,29 %  | 1,29 %   |
| Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich)   | 2,89 %  | 2,89 %   |
| Thesaurierende Klasse AUD B              | 2,89 %  | 2,89 %   |
| Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)   | 2,89 %  | 2,89 %   |
| Thesaurierende Klasse AUD E              | 2,89 %  | 2,89 %   |
| Ausschüttende Klasse AUD I               | 0,69 %  | 0,69 %   |
| Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)   | 1,89 %  | 1,89 %   |
| Ausschüttende Klasse AUD T (Wöchentlich) | 1,89 %  | 1,89 %   |
| Thesaurierende Klasse AUD T              | 1,89 %  | 1,89 %   |
| Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich)   | 1,29 %  | 1,29 %   |
| Thesaurierende Klasse CHF A              | 1,29 %  | 1,29 %   |
| Thesaurierende Klasse CHF I              | 0,69 %  | 0,69 %   |
| Thesaurierende Klasse CHF I2             | 0,59 %  | 0,59 %   |
| Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)   | 1,29 %  | 1,29 %   |
| Ausschüttende Klasse CNY I (Monatlich)   | 0,69 %  | 0,69 %   |
| Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)   | 1,29 %  | 1,29 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR A              | 1,29 %  | 1,29 %   |
| Ausschüttende Klasse EUR A               | 1,29 %  | 1,29 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I              | 0,69 %  | 0,69 %   |
| Ausschüttende Klasse EUR I               | 0,69 %  | 0,69 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I2             | 0,59 %  | 0,59 %   |
| Ausschüttende Klasse EUR I2              | 0,59 %  | 0,59 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR M              | 1,89 %  | 1,89 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR Z              | 0,09 %  | 0,09 %   |
| Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich)   | 1,29 %  | 1,29 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP A              | 1,29 %  | 1,29 %   |
| Ausschüttende Klasse GBP A               | 1,29 %  | 1,29 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP I              | 0,69 %  | 0,69 %   |
| Ausschüttende Klasse GBP I               | 0,70 %  | 0,70 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP I2             | 0,59 %  | 0,59 %   |
| Ausschüttende Klasse GBP I2              | 0,59 %  | 0,59 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP Z              | 0,10 %  | 0,10 %   |
| Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)   | 1,29 %  | 1,29 %   |

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2024

High Yield Bond (Fortsetzung)

| Anteilklasse   | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|--|---|--|
| Ausschüttende Klasse JPY A (Monatlich) (nicht währungsgesichert) | 1,28 %  | 1,28 %   |
| Thesaurierende Klasse SEK A                                      | 1,30 %  | 1,30 %   |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)                           | 1,29 %  | 1,29 %   |
| Thesaurierende Klasse SGD A                                      | 1,29 %  | 1,29 %   |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)                           | 1,29 %  | 1,29 %   |
| Ausschüttende Klasse USD A (Wöchentlich)                         | 1,29 %  | 1,29 %   |
| Thesaurierende Klasse USD A                                      | 1,29 %  | 1,29 %   |
| Ausschüttende Klasse USD A                                       | 1,29 %  | 1,29 %   |
| Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich)                           | 2,89 %  | 2,89 %   |
| Thesaurierende Klasse USD B                                      | 2,89 %  | 2,89 %   |
| Thesaurierende Klasse USD C                                      | 1,89 %  | 1,89 %   |
| Thesaurierende Klasse USD C1                                     | 2,29 %  | 2,29 %   |
| Ausschüttende Klasse USD C1                                      | 2,29 %  | 2,29 %   |
| Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)                           | 2,89 %  | 2,89 %   |
| Thesaurierende Klasse USD E                                      | 2,89 %  | 2,89 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)                           | 0,69 %  | 0,69 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I                                      | 0,69 %  | 0,69 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I                                       | 0,69 %  | 0,69 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I2 (Monatlich)                          | 0,59 %  | 0,59 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I2                                     | 0,59 %  | 0,59 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I2                                      | 0,59 %  | 0,59 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich)                          | 0,45 %  | 0,45 %   |
| Thesaurierende Klasse USD M                                      | 1,89 %  | 1,89 %   |
| Ausschüttende Klasse USD M                                       | 1,89 %  | 1,89 %   |
| Thesaurierende Klasse USD P                                      | 0,66 %  | 0,66 %   |
| Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)                           | 1,89 %  | 1,89 %   |
| Ausschüttende Klasse USD T (Wöchentlich)                         | 1,89 %  | 1,89 %   |
| Thesaurierende Klasse USD T                                      | 1,89 %  | 1,89 %   |
| Ausschüttende Klasse USD U (Monatlich)                           | 0,99 %  | 0,99 %   |
| Thesaurierende Klasse USD U                                      | 0,99 %  | 0,99 %   |
| Thesaurierende Klasse USD Z                                      | 0,10 %  | 0,10 %   |
| Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)                           | 2,89 %  | 2,89 %   |
| Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)                           | 2,89 %  | 2,89 %   |
| Thesaurierende Klasse ZAR E                                      | 2,89 %  | 2,89 %   |

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2024

## High Yield Bond (Fortsetzung)

| Anteilklasse                           | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|--|---|--|
| Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) | 1,89 %  | 1,89 %   |
| Thesaurierende Klasse ZAR T            | 1,89 %  | 1,89 %   |

## InnovAsia

|   |        |        |
|---|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse CHF I4                          | 1,77 % | 0,71 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A                           | 2,98 % | 1,90 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I4                          | 1,68 % | 0,71 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) | 3,69 % | 2,70 % |
| Thesaurierende Klasse EUR X                           | 2,73 % | 1,65 % |
| Thesaurierende Klasse SGD A                           | 2,80 % | 1,90 % |
| Thesaurierende Klasse SGD I4                          | 1,71 % | 0,71 % |
| Thesaurierende Klasse SGD X                           | 2,73 % | 1,65 % |
| Thesaurierende Klasse USD A                           | 2,92 % | 1,90 % |
| Thesaurierende Klasse USD I                           | 1,70 % | 1,05 % |
| Thesaurierende Klasse USD I4                          | 1,75 % | 0,71 % |
| Thesaurierende Klasse USD M                           | 4,30 % | 2,70 % |
| Thesaurierende Klasse USD X                           | 2,66 % | 1,65 % |

## Japan Equity Engagement

|  |        |        |
|--|--------|--------|
| Ausschüttende Klasse EUR I5                            | 0,83 % | 0,73 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert) | 0,65 % | 0,65 % |
| Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)  | 1,03 % | 1,03 % |
| Thesaurierende Klasse JPY A                            | 1,94 % | 1,94 % |
| Thesaurierende Klasse JPY I                            | 1,10 % | 1,10 % |
| Ausschüttende Klasse JPY I                             | 1,14 % | 1,14 % |
| Thesaurierende Klasse JPY I5                           | 0,65 % | 0,65 % |
| Thesaurierende Klasse JPY Z                            | 0,21 % | 0,21 % |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 1,94 % | 1,94 % |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 1,08 % | 1,08 % |
| Thesaurierende Klasse USD I5 (nicht währungsgesichert) | 0,74 % | 0,73 % |
| Thesaurierende Klasse USD X (nicht währungsgesichert)  | 0,82 % | 0,45 % |

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2024

Next Generation Connectivity

| Anteilklasse  | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|---|---|--|
| Thesaurierende Klasse AUD A                           | 1,81 %  | 1,81 %   |
| Thesaurierende Klasse AUD E                           | 2,82 %  | 2,82 %   |
| Thesaurierende Klasse AUD I2                          | 0,79 %  | 0,79 %   |
| Thesaurierende Klasse CHF A                           | 1,80 %  | 1,80 %   |
| Thesaurierende Klasse CHF I                           | 0,95 %  | 0,95 %   |
| Thesaurierende Klasse CHF I2                          | 0,79 %  | 0,79 %   |
| Thesaurierende Klasse CNY A                           | 1,81 %  | 1,81 %   |
| Thesaurierende Klasse CNY I2                          | 0,78 %  | 0,78 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR A                           | 1,81 %  | 1,81 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert) | 1,81 %  | 1,81 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I                           | 0,96 %  | 0,96 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) | 0,96 %  | 0,96 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I2                          | 0,79 %  | 0,79 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I5                          | 0,53 %  | 0,53 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) | 2,61 %  | 2,61 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP A                           | 1,81 %  | 1,81 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | 0,96 %  | 0,96 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP I2                          | 0,79 %  | 0,79 %   |
| Thesaurierende Klasse HKD A                           | 1,81 %  | 1,81 %   |
| Thesaurierende Klasse HKD I2                          | 0,79 %  | 0,79 %   |
| Thesaurierende Klasse SGD A                           | 1,81 %  | 1,81 %   |
| Thesaurierende Klasse SGD I2                          | 0,79 %  | 0,79 %   |
| Thesaurierende Klasse USD A                           | 1,81 %  | 1,81 %   |
| Thesaurierende Klasse USD E                           | 2,92 %  | 2,92 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I                           | 0,96 %  | 0,96 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I                            | 0,96 %  | 0,96 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I2                          | 0,79 %  | 0,79 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I3                          | 0,70 %  | 0,70 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I5                          | 0,53 %  | 0,53 %   |
| Thesaurierende Klasse USD M                           | 2,61 %  | 2,61 %   |
| Thesaurierende Klasse USD Z                           | 0,10 %  | 0,10 %   |
| Thesaurierende Klasse ZAR A                           | 1,82 %  | 1,82 %   |
| Thesaurierende Klasse ZAR E                           | 2,91 %  | 2,91 %   |

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2024

## Next Generation Mobility

| Anteilklasse  | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|---|---|--|
| Thesaurierende Klasse EUR A                           | 1,88 %  | 1,88 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I                           | 1,03 %  | 1,03 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) | 1,03 %  | 1,03 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) | 2,68 %  | 2,68 %   |
| Thesaurierende Klasse USD A                           | 1,88 %  | 1,88 %   |
| Thesaurierende Klasse USD C1                          | 2,88 %  | 2,88 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I                           | 1,03 %  | 1,03 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I                            | 1,03 %  | 1,03 %   |
| Thesaurierende Klasse USD M                           | 2,68 %  | 2,68 %   |
| Thesaurierende Klasse USD X                           | 1,73 %  | 1,73 %   |

## Next Generation Space Economy

|  |        |        |
|--|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)  | 1,94 % | 1,90 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert) | 1,13 % | 0,79 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)  | 3,00 % | 2,70 % |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 1,94 % | 1,90 % |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 1,37 % | 1,05 % |

## Short Duration Emerging Market Debt

|  |        |        |
|--|--------|--------|
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | 1,06 % | 1,06 % |
| Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich) | 1,06 % | 1,06 % |
| Thesaurierende Klasse CHF A            | 1,06 % | 1,06 % |
| Ausschüttende Klasse CHF A             | 1,06 % | 1,06 % |
| Thesaurierende Klasse CHF I            | 0,57 % | 0,57 % |
| Ausschüttende Klasse CHF I             | 0,58 % | 0,58 % |
| Thesaurierende Klasse CHF I2           | 0,47 % | 0,47 % |
| Ausschüttende Klasse CHF I2            | 0,47 % | 0,47 % |
| Thesaurierende Klasse CHF I5           | 0,32 % | 0,32 % |
| Thesaurierende Klasse CHF P            | 0,54 % | 0,54 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A            | 1,07 % | 1,07 % |
| Ausschüttende Klasse EUR A             | 1,07 % | 1,07 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I            | 0,56 % | 0,56 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I             | 0,57 % | 0,57 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I2           | 0,46 % | 0,46 % |

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2024

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

| Anteilklasse                           | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|--|---|--|
| Ausschüttende Klasse EUR I2            | 0,47 %  | 0,47 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I5           | 0,32 %  | 0,32 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR M            | 1,66 %  | 1,66 %   |
| Ausschüttende Klasse EUR M             | 1,66 %  | 1,66 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR P            | 0,54 %  | 0,54 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR U            | 0,82 %  | 0,82 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP A            | 1,06 %  | 1,06 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP I            | 0,57 %  | 0,57 %   |
| Ausschüttende Klasse GBP I             | 0,56 %  | 0,56 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP I2           | 0,46 %  | 0,46 %   |
| Ausschüttende Klasse GBP I2            | 0,47 %  | 0,47 %   |
| Ausschüttende Klasse GBP I5            | 0,31 %  | 0,31 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP P            | 0,54 %  | 0,54 %   |
| Thesaurierende Klasse JPY I            | 0,57 %  | 0,57 %   |
| Ausschüttende Klasse JPY I             | 0,56 %  | 0,56 %   |
| Thesaurierende Klasse SEK A            | 1,07 %  | 1,07 %   |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | 1,06 %  | 1,06 %   |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 1,06 %  | 1,06 %   |
| Thesaurierende Klasse USD A            | 1,06 %  | 1,06 %   |
| Ausschüttende Klasse USD A             | 1,07 %  | 1,07 %   |
| Thesaurierende Klasse USD C1           | 2,07 %  | 2,07 %   |
| Ausschüttende Klasse USD C1            | 2,07 %  | 2,07 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I            | 0,56 %  | 0,56 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I             | 0,57 %  | 0,57 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I2           | 0,47 %  | 0,47 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I2            | 0,46 %  | 0,46 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I5           | 0,31 %  | 0,31 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I5            | 0,32 %  | 0,32 %   |
| Thesaurierende Klasse USD M            | 1,66 %  | 1,66 %   |
| Ausschüttende Klasse USD M             | 1,67 %  | 1,67 %   |
| Thesaurierende Klasse USD P            | 0,54 %  | 0,54 %   |
| Thesaurierende Klasse USD Z            | 0,06 %  | 0,06 %   |

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2024

## Short Duration Euro Bond

| Anteilklasse                 | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|------------------------------|---|--|
| Thesaurierende Klasse CHF P  | 0,24 %  | 0,24 %   |
| Thesaurierende Klasse CHF U  | 0,36 %  | 0,36 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR A  | 0,44 %  | 0,44 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I  | 0,25 %  | 0,25 %   |
| Ausschüttende Klasse EUR I   | 0,25 %  | 0,25 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 | 0,21 %  | 0,21 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 | 0,15 %  | 0,15 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR M  | 0,64 %  | 0,64 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR U  | 0,35 %  | 0,35 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR Z  | 0,06 %  | 0,06 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I  | 0,25 %  | 0,25 %   |
| Thesaurierende Klasse USD Z  | 0,07 %  | 0,07 %   |

## Short Duration High Yield Engagement

|  |        |        |
|--|--------|--------|
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | 1,29 % | 1,29 % |
| Thesaurierende Klasse CHF A            | 1,29 % | 1,29 % |
| Thesaurierende Klasse CHF I            | 0,69 % | 0,69 % |
| Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) | 1,29 % | 1,29 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A            | 1,29 % | 1,29 % |
| Ausschüttende Klasse EUR A             | 1,29 % | 1,29 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I            | 0,69 % | 0,69 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I2           | 0,59 % | 0,59 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M            | 1,89 % | 1,89 % |
| Ausschüttende Klasse EUR M             | 1,89 % | 1,89 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I            | 0,69 % | 0,69 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I             | 0,69 % | 0,69 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I2           | 0,59 % | 0,59 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I2            | 0,59 % | 0,59 % |
| Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) | 1,29 % | 1,29 % |
| Thesaurierende Klasse JPY I            | 0,69 % | 0,69 % |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | 1,29 % | 1,29 % |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 1,29 % | 1,29 % |
| Thesaurierende Klasse USD A            | 1,29 % | 1,29 % |
| Ausschüttende Klasse USD A             | 1,29 % | 1,29 % |

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2024

## Short Duration High Yield Engagement (Fortsetzung)

| Anteilklasse                 | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|------------------------------|---|--|
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 2,29 %  | 2,29 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I  | 0,69 %  | 0,69 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I   | 0,69 %  | 0,69 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 0,59 %  | 0,59 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I2  | 0,59 %  | 0,59 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I4 | 0,46 %  | 0,46 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 0,39 %  | 0,39 %   |
| Thesaurierende Klasse USD M  | 1,89 %  | 1,89 %   |
| Ausschüttende Klasse USD M   | 1,90 %  | 1,90 %   |
| Thesaurierende Klasse USD Z  | 0,09 %  | 0,09 %   |

## Strategic Income

|  |        |        |
|--|--------|--------|
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)                           | 1,09 % | 1,09 % |
| Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)                           | 2,10 % | 2,10 % |
| Ausschüttende Klasse AUD Z (Monatlich)                           | 0,09 % | 0,09 % |
| Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)                           | 1,09 % | 1,09 % |
| Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)                           | 1,09 % | 1,09 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A                                      | 1,09 % | 1,09 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I                                      | 0,59 % | 0,59 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M                                      | 1,69 % | 1,69 % |
| Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich)                           | 1,09 % | 1,09 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I (Monatlich)                           | 0,59 % | 0,59 % |
| Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)                           | 1,09 % | 1,09 % |
| Ausschüttende Klasse JPY A (Monatlich)                           | 1,09 % | 1,09 % |
| Ausschüttende Klasse JPY A (Monatlich) (nicht währungsgesichert) | 1,09 % | 1,09 % |
| Ausschüttende Klasse JPY E (Monatlich) (nicht währungsgesichert) | 2,09 % | 2,09 % |
| Thesaurierende Klasse JPY I                                      | 0,59 % | 0,59 % |
| Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert)            | 0,59 % | 0,59 % |
| Ausschüttende Klasse JPY I CG                                    | 0,59 % | 0,59 % |
| Ausschüttende Klasse JPY I                                       | 0,58 % | 0,58 % |
| Thesaurierende Klasse JPY Z                                      | 0,09 % | 0,09 % |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)                           | 1,09 % | 1,09 % |
| Thesaurierende Klasse SGD A                                      | 1,09 % | 1,09 % |
| Ausschüttende Klasse SGD I (Monatlich)                           | 0,59 % | 0,59 % |

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2024

## Strategic Income (Fortsetzung)

| Anteilklasse                            | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|---|---|--|
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)  | 1,09 %  | 1,09 %   |
| Thesaurierende Klasse USD A             | 1,09 %  | 1,09 %   |
| Ausschüttende Klasse USD A              | 1,09 %  | 1,09 %   |
| Thesaurierende Klasse USD C1            | 2,09 %  | 2,09 %   |
| Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)  | 2,10 %  | 2,10 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I             | 0,59 %  | 0,59 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I              | 0,59 %  | 0,59 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich) | 0,39 %  | 0,39 %   |
| Thesaurierende Klasse USD M             | 1,69 %  | 1,69 %   |
| Ausschüttende Klasse USD M              | 1,69 %  | 1,69 %   |
| Thesaurierende Klasse USD Z             | 0,09 %  | 0,09 %   |
| Ausschüttende Klasse ZAR A (Monatlich)  | 1,09 %  | 1,09 %   |
| Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)  | 2,10 %  | 2,10 %   |

## Sustainable Asia High Yield

|  |        |        |
|--|--------|--------|
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 1,63 % | 1,40 % |
| Thesaurierende Klasse USD A            | 1,63 % | 1,40 % |
| Thesaurierende Klasse USD I            | 1,01 % | 0,80 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z            | 0,42 % | 0,20 % |
| Ausschüttende Klasse USD Z             | 0,42 % | 0,20 % |

## Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency

|                              |        |        |
|------------------------------|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR I3 | 0,56 % | 0,56 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I4 | 0,48 % | 0,48 % |
| Thesaurierende Klasse EUR X  | 0,41 % | 0,41 % |
| Thesaurierende Klasse USD I  | 0,75 % | 0,75 % |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 0,41 % | 0,41 % |

Tactical Macro<sup>1</sup>

|                              |        |        |
|------------------------------|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR I5 | 0,89 % | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse USD I  | 1,29 % | 1,00 % |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 0,91 % | 0,60 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z  | 0,49 % | 0,20 % |

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2024

## Uncorrelated Strategies

| Anteilklasse                 | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|------------------------------|---|--|
| Thesaurierende Klasse CHF I  | 1,71 %  | 1,70 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR A  | 2,46 %  | 2,45 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I  | 1,71 %  | 1,70 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 | 1,56 %  | 1,55 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR M  | 3,26 %  | 3,25 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR P  | 1,69 %  | 1,66 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP I  | 1,71 %  | 1,70 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP I2 | 1,56 %  | 1,55 %   |
| Ausschüttende Klasse GBP I2  | 1,58 %  | 1,55 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP I5 | 1,35 %  | 1,32 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP P  | 1,67 %  | 1,66 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP Z  | 0,95 %  | 0,95 %   |
| Thesaurierende Klasse JPY I  | 1,70 %  | 1,70 %   |
| Thesaurierende Klasse SGD A  | 2,41 %  | 2,41 %   |
| Thesaurierende Klasse USD A  | 2,46 %  | 2,45 %   |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 3,47 %  | 3,45 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I  | 1,70 %  | 1,70 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 1,56 %  | 1,55 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 1,32 %  | 1,32 %   |
| Thesaurierende Klasse USD M  | 3,26 %  | 3,25 %   |
| Thesaurierende Klasse USD P  | 1,69 %  | 1,66 %   |
| Thesaurierende Klasse USD Z  | 0,98 %  | 0,95 %   |

## US Equity

|  |        |        |
|--|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)  | 0,96 % | 0,95 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I5                           | 0,80 % | 0,58 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert) | 0,58 % | 0,57 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)  | 0,58 % | 0,57 % |
| Thesaurierende Klasse EUR X (nicht währungsgesichert)  | 0,39 % | 0,25 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)  | 0,58 % | 0,57 % |
| Thesaurierende Klasse GBP X (nicht währungsgesichert)  | 0,45 % | 0,25 % |
| Thesaurierende Klasse JPY I3                           | 0,76 % | 0,73 % |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 1,74 % | 1,70 % |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 0,99 % | 0,95 % |

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2024

## US Equity (Fortsetzung)

| Anteilklasse                 | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|------------------------------|---|--|
| Ausschüttende Klasse USD I   | 0,99 %  | 0,95 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 0,64 %  | 0,58 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I5  | 0,61 %  | 0,57 %   |
| Thesaurierende Klasse USD M  | 2,54 %  | 2,50 %   |
| Thesaurierende Klasse USD X  | 0,35 %  | 0,25 %   |
| Thesaurierende Klasse USD Z  | 0,28 %  | 0,20 %   |

## US Equity Premium

|  |        |        |
|--|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR I                            | 0,68 % | 0,68 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I3                            | 0,50 % | 0,50 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I4                           | 0,44 % | 0,44 % |
| Ausschüttende Klasse EUR I4                            | 0,43 % | 0,43 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M                            | 2,08 % | 2,08 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)  | 0,69 % | 0,69 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I3                           | 0,50 % | 0,50 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I3                            | 0,50 % | 0,50 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert)  | 0,48 % | 0,48 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) | 0,45 % | 0,45 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I4                            | 0,44 % | 0,44 % |
| Ausschüttende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)   | 0,65 % | 0,65 % |
| Thesaurierende Klasse GBP X (nicht währungsgesichert)  | 0,42 % | 0,42 % |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)                 | 1,28 % | 1,28 % |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 1,28 % | 1,28 % |
| Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)                 | 0,67 % | 0,67 % |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 0,68 % | 0,68 % |
| Ausschüttende Klasse USD I3                            | 0,50 % | 0,50 % |
| Thesaurierende Klasse USD I4                           | 0,44 % | 0,44 % |
| Thesaurierende Klasse USD M                            | 2,08 % | 2,08 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z                            | 0,08 % | 0,08 % |

## US Large Cap Value

|   |        |        |
|---|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR A                           | 1,56 % | 1,56 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert) | 1,56 % | 1,56 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I                           | 0,76 % | 0,76 % |

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2024

## US Large Cap Value (Fortsetzung)

| Anteilklasse   | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|--|---|--|
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)  | 0,76 %  | 0,76 %   |
| Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)  | 0,49 %  | 0,49 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert) | 0,41 %  | 0,41 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP I                            | 0,76 %  | 0,76 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)  | 0,77 %  | 0,77 %   |
| Ausschüttende Klasse GBP I                             | 0,77 %  | 0,77 %   |
| Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)   | 0,75 %  | 0,75 %   |
| Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)  | 0,49 %  | 0,49 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)  | 0,73 %  | 0,73 %   |
| Ausschüttende Klasse GBP P                             | 0,73 %  | 0,73 %   |
| Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)  | 0,69 %  | 0,69 %   |
| Ausschüttende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)   | 0,69 %  | 0,69 %   |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 1,56 %  | 1,56 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 0,76 %  | 0,76 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I4                            | 0,49 %  | 0,49 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I5                           | 0,40 %  | 0,40 %   |
| Thesaurierende Klasse USD M                            | 2,36 %  | 2,36 %   |
| Thesaurierende Klasse USD Y                            | 0,69 %  | 0,69 %   |
| Thesaurierende Klasse USD Z                            | 0,06 %  | 0,06 %   |

## US Long Short Equity

|  |        |        |
|--|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR A                            | 2,43 % | 2,43 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I                            | 1,53 % | 1,53 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I3                           | 1,12 % | 1,12 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert) | 1,08 % | 1,08 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M                            | 3,23 % | 3,23 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I3                            | 1,12 % | 1,12 % |
| Thesaurierende Klasse SGD A1                           | 1,98 % | 1,98 % |
| Thesaurierende Klasse USD A (PF)                       | 1,88 % | 1,88 % |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 2,43 % | 2,43 % |
| Thesaurierende Klasse USD A1                           | 1,98 % | 1,98 % |
| Ausschüttende Klasse USD I (PF)                        | 1,18 % | 1,18 % |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 1,53 % | 1,53 % |
| Thesaurierende Klasse USD I3                           | 1,12 % | 1,12 % |

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2024

## US Long Short Equity (Fortsetzung)

| Anteilklasse                | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|-----------------------------|---|--|
| Thesaurierende Klasse USD M | 3,23 %  | 3,23 %   |
| Thesaurierende Klasse USD U | 1,98 %  | 1,98 %   |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 0,18 %  | 0,18 %   |

## US Multi Cap Opportunities

|   |        |        |
|---|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse AUD E                           | 2,98 % | 2,98 % |
| Thesaurierende Klasse AUD T                           | 1,97 % | 1,97 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) | 1,05 % | 1,05 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I3                          | 0,67 % | 0,67 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M                           | 2,87 % | 2,87 % |
| Thesaurierende Klasse EUR1 A                          | 1,87 % | 1,87 % |
| Thesaurierende Klasse EUR1 I                          | 1,02 % | 1,02 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I3                           | 0,64 % | 0,64 % |
| Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert) | 0,66 % | 0,66 % |
| Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) | 0,94 % | 0,94 % |
| Thesaurierende Klasse SGD A                           | 1,87 % | 1,87 % |
| Thesaurierende Klasse USD B                           | 2,98 % | 2,98 % |
| Thesaurierende Klasse USD C1                          | 2,87 % | 2,87 % |
| Thesaurierende Klasse USD E                           | 2,98 % | 2,98 % |
| Thesaurierende Klasse USD I2                          | 0,84 % | 0,84 % |
| Thesaurierende Klasse USD I3                          | 0,67 % | 0,67 % |
| Thesaurierende Klasse USD M                           | 2,87 % | 2,87 % |
| Thesaurierende Klasse USD T                           | 1,97 % | 1,97 % |
| Thesaurierende Klasse USD U                           | 1,42 % | 1,42 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z                           | 0,17 % | 0,17 % |
| Thesaurierende Klasse USD1 A                          | 1,87 % | 1,87 % |
| Thesaurierende Klasse USD1 I                          | 1,02 % | 1,02 % |
| Ausschüttende Klasse USD1 I                           | 1,02 % | 1,02 % |
| Thesaurierende Klasse ZAR B                           | 2,98 % | 2,98 % |
| Thesaurierende Klasse ZAR E                           | 2,98 % | 2,98 % |
| Thesaurierende Klasse ZAR T                           | 1,97 % | 1,97 % |

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2024

US Real Estate Securities

| Anteilklasse                           | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|--|---|--|
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | 1,72 %  | 1,72 %   |
| Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich) | 3,02 %  | 3,02 %   |
| Thesaurierende Klasse AUD B            | 3,02 %  | 3,02 %   |
| Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich) | 3,02 %  | 3,02 %   |
| Thesaurierende Klasse AUD E            | 3,03 %  | 3,03 %   |
| Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) | 2,02 %  | 2,02 %   |
| Thesaurierende Klasse AUD T            | 2,02 %  | 2,02 %   |
| Thesaurierende Klasse CHF A            | 1,72 %  | 1,72 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR A            | 1,70 %  | 1,70 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR I            | 0,97 %  | 0,97 %   |
| Thesaurierende Klasse EUR M            | 2,72 %  | 2,72 %   |
| Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) | 1,72 %  | 1,72 %   |
| Thesaurierende Klasse SGD A            | 1,72 %  | 1,72 %   |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 1,72 %  | 1,72 %   |
| Thesaurierende Klasse USD A            | 1,72 %  | 1,72 %   |
| Ausschüttende Klasse USD A             | 1,72 %  | 1,72 %   |
| Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich) | 3,02 %  | 3,02 %   |
| Thesaurierende Klasse USD B            | 3,02 %  | 3,02 %   |
| Thesaurierende Klasse USD C1           | 2,72 %  | 2,72 %   |
| Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich) | 3,02 %  | 3,02 %   |
| Thesaurierende Klasse USD E            | 3,02 %  | 3,02 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) | 0,97 %  | 0,97 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I            | 0,97 %  | 0,97 %   |
| Ausschüttende Klasse USD I             | 0,97 %  | 0,97 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I2           | 0,77 %  | 0,77 %   |
| Thesaurierende Klasse USD M            | 2,72 %  | 2,72 %   |
| Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) | 2,02 %  | 2,02 %   |
| Thesaurierende Klasse USD T            | 2,02 %  | 2,02 %   |
| Thesaurierende Klasse USD Z            | 0,24 %  | 0,24 %   |
| Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich) | 3,02 %  | 3,02 %   |
| Thesaurierende Klasse ZAR B            | 3,02 %  | 3,02 %   |
| Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich) | 3,02 %  | 3,02 %   |
| Thesaurierende Klasse ZAR E            | 3,02 %  | 3,02 %   |

## Anhang I (Fortsetzung)

## GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2024

## US Real Estate Securities (Fortsetzung)

| Anteilklasse                           | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|--|---|--|
| Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) | 2,02 %  | 2,02 %   |
| Thesaurierende Klasse ZAR T            | 2,02 %  | 2,02 %   |

## US Small Cap

|  |        |        |
|--|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse AUD B                            | 2,91 % | 2,91 % |
| Thesaurierende Klasse AUD E                            | 2,91 % | 2,91 % |
| Thesaurierende Klasse AUD T                            | 1,91 % | 1,91 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A                            | 1,79 % | 1,79 % |
| Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)  | 1,80 % | 1,80 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I                            | 0,96 % | 0,96 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)  | 0,96 % | 0,96 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert) | 0,79 % | 0,79 % |
| Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert) | 0,62 % | 0,62 % |
| Thesaurierende Klasse EUR M                            | 2,81 % | 2,81 % |
| Thesaurierende Klasse EUR Z                            | 0,11 % | 0,11 % |
| Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)  | 0,89 % | 0,89 % |
| Ausschüttende Klasse JPY I                             | 0,96 % | 0,96 % |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 1,81 % | 1,81 % |
| Ausschüttende Klasse USD A                             | 1,81 % | 1,81 % |
| Thesaurierende Klasse USD B                            | 2,91 % | 2,91 % |
| Thesaurierende Klasse USD E                            | 2,90 % | 2,90 % |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 0,96 % | 0,96 % |
| Ausschüttende Klasse USD I                             | 0,96 % | 0,96 % |
| Thesaurierende Klasse USD I3                           | 0,71 % | 0,71 % |
| Thesaurierende Klasse USD M                            | 2,81 % | 2,81 % |
| Thesaurierende Klasse USD T                            | 1,91 % | 1,91 % |
| Thesaurierende Klasse USD Z                            | 0,11 % | 0,11 % |
| Thesaurierende Klasse ZAR E                            | 2,91 % | 2,91 % |
| Thesaurierende Klasse ZAR T                            | 1,91 % | 1,91 % |

## US Small Cap Intrinsic Value

|  |        |        |
|--|--------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR I3                           | 0,69 % | 0,69 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)  | 0,95 % | 0,95 % |
| Thesaurierende Klasse GBP I2 (nicht währungsgesichert) | 0,78 % | 0,78 % |

## Anhang I (Fortsetzung)

### GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2024

US Small Cap Intrinsic Value (Fortsetzung)

| Anteilklasse   | Annualisierte TER in %<br>(Ohne Gebührenverzicht) | Annualisierte TER in %<br>(Mit Gebührenverzicht) |
|--|---|--|
| Thesaurierende Klasse JPY I3 (nicht währungsgesichert) | 0,69 %  | 0,69 %   |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 1,80 %  | 1,80 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 0,95 %  | 0,95 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I2                           | 0,78 %  | 0,78 %   |
| Thesaurierende Klasse USD I3                           | 0,71 %  | 0,71 %   |
| Thesaurierende Klasse USD M                            | 2,80 %  | 2,80 %   |

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

## Anhang II

### PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT)

#### Asia Responsible Transition Bond

| Anteilklasse                            | Auflegungsdatum | ISIN         | Geschäftsjahr zum 31. Dezember |           |           |
|---|-----------------|--------------|--------------------------------|-----------|-----------|
|   |                 |              | 2022<br>%                      | 2023<br>% | 2024<br>% |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)  | 30.06.2015      | IE00BYZS6L96 | (13,91)                        | 5,82      | 4,89      |
| Thesaurierende Klasse USD A             | 30.06.2015      | IE00BYZS6K89 | (13,94)                        | 5,82      | 4,82      |
| Thesaurierende Klasse USD C1            | 15.10.2019      | IE00BJ023P46 | (14,82)                        | 4,72      | 3,74      |
| Thesaurierende Klasse USD I             | 30.06.2015      | IE00BYZS6J74 | (13,50)                        | 6,45      | 5,49      |
| Ausschüttende Klasse USD I              | 30.06.2015      | IE00BYZS6M04 | (13,41)                        | 6,46      | 5,40      |
| Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich) | 23.09.2022      | IE000BMKOID8 | 2,30                           | 6,70      | 5,65      |
| Thesaurierende Klasse USD I4            | 23.09.2022      | IE000D2XZZ12 | 2,30                           | 6,74      | 5,68      |
| Thesaurierende Klasse USD M             | 14.08.2019      | IE00BF47N027 | (14,48)                        | 5,19      | 4,18      |
| Ausschüttende Klasse USD X (Monatlich)  | 23.09.2022      | IE000Q9JOU2  | 2,10                           | 5,97      | 4,90      |
| Thesaurierende Klasse USD X             | 08.06.2021      | IE00BN6JC501 | (13,48)                        | 5,97      | 4,86      |
| Thesaurierende Klasse USD Z             | 12.12.2022      | IE00BYTHKK92 | 0,10                           | 7,09      | 6,06      |

#### China A-Share Equity

|   |            |              |         |         |      |
|---|------------|--------------|---------|---------|------|
| Thesaurierende Klasse CNY I                           | 28.07.2020 | IE00BLPHVV04 | (22,68) | (12,31) | 3,81 |
| Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) | 28.07.2020 | IE00BMD7Z068 | (28,89) | (14,87) | 0,76 |
| Ausschüttende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)  | 28.07.2020 | IE00BMD7Z175 | (28,97) | (14,81) | 0,78 |

#### China Bond

|  |            |              |         |        |      |
|--|------------|--------------|---------|--------|------|
| Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)                           | 04.11.2020 | IE00BF4ZPF56 | (6,70)  | 2,70   | 3,01 |
| Ausschüttende Klasse CNY I                                       | 12.12.2022 | IE00BYRGQM22 | (6,13)  | 3,39   | 3,68 |
| Thesaurierende Klasse CNY Z                                      | 08.09.2015 | IE00BYRGQQ69 | (5,51)  | 4,05   | 4,36 |
| Thesaurierende Klasse GBP I2                                     | 09.02.2021 | IE00BNC26Y00 | (7,12)  | 5,67   | -    |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) (nicht währungsgesichert) | 12.03.2019 | IE00BHXGRN56 | (14,73) | (1,88) | 3,35 |
| Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)            | 08.09.2015 | IE00BYQX7S71 | (13,76) | 0,49   | 0,49 |
| Thesaurierende Klasse USD Z                                      | 29.03.2019 | IE00BYRGQJ92 | (6,32)  | 6,85   | 7,50 |
| Thesaurierende Klasse USD Z (nicht währungsgesichert)            | 10.04.2018 | IE00BYRGQN39 | (13,14) | 1,02   | 1,32 |

#### China Equity

|                              |            |              |         |         |       |
|------------------------------|------------|--------------|---------|---------|-------|
| Thesaurierende Klasse CHF I  | 31.07.2015 | IE00B63FQV68 | (24,04) | (25,51) | 13,94 |
| Thesaurierende Klasse EUR A  | 14.07.2009 | IE00B54BK812 | (24,30) | (24,71) | 15,76 |
| Thesaurierende Klasse EUR I  | 14.07.2009 | IE00B54BLX33 | (23,71) | (24,17) | 16,62 |
| Thesaurierende Klasse EUR Z  | 03.06.2014 | IE00BKJ9MV22 | (22,86) | (23,31) | 17,95 |
| Ausschüttende Klasse GBP A   | 21.05.2015 | IE00BWB9BT54 | (23,19) | (23,54) | -     |
| Thesaurierende Klasse SGD A  | 01.12.2014 | IE00B5MMRT66 | (22,69) | (24,12) | 15,68 |
| Thesaurierende Klasse USD A  | 14.07.2009 | IE00B543WZ88 | (21,93) | (22,83) | 17,92 |
| Ausschüttende Klasse USD A   | 27.08.2014 | IE00BPRC5H50 | (21,94) | (22,81) | 17,81 |
| Thesaurierende Klasse USD I  | 14.07.2009 | IE00B547N797 | (21,33) | (22,22) | 18,77 |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 11.08.2014 | IE00B8BY0V78 | (21,13) | (22,05) | 19,01 |
| Thesaurierende Klasse USD M  | 27.05.2016 | IE00BYVF7440 | (22,70) | (23,52) | 16,70 |
| Thesaurierende Klasse USD U  | 27.06.2014 | IE00BLSP6051 | (21,63) | (22,48) | 18,35 |
| Thesaurierende Klasse USD Z  | 01.08.2014 | IE00BKJ9MZ69 | (20,48) | (21,35) | 20,05 |

## Anhang II (Fortsetzung)

## PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

Climate Innovation<sup>1</sup>

Geschäftsjahr zum 31. Dezember

| Anteilklasse                 | Auflegungsdatum | ISIN         | Geschäftsjahr zum 31. Dezember |        |      |
|------------------------------|-----------------|--------------|--------------------------------|--------|------|
|                              |                 |              | 2022                           | 2023   | 2024 |
|                              |                 |              | %                              | %      | %    |
| Thesaurierende Klasse USD A  | 01.08.2023      | IE0006EGSTJ7 | -                              | (3,40) | 3,31 |
| Thesaurierende Klasse USD I  | 01.08.2023      | IE000UGESYW1 | -                              | (3,00) | 4,12 |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 01.08.2023      | IE000YMVHC49 | -                              | (2,90) | 4,74 |
| Thesaurierende Klasse USD Z  | 01.08.2023      | IE0009Q8TA55 | -                              | (2,70) | 5,14 |

## CLO Income

|  |            |              |        |       |       |
|--|------------|--------------|--------|-------|-------|
| Thesaurierende Klasse EUR A                          | 09.06.2022 | IE000BKR2PI0 | (3,30) | 18,30 | 14,69 |
| Thesaurierende Klasse EUR I                          | 12.07.2018 | IE00BG7PQ018 | (8,74) | 19,26 | 15,49 |
| Ausschüttende Klasse EUR I2                          | 15.11.2018 | IE00BD102V45 | (8,68) | 19,33 | 15,58 |
| Thesaurierende Klasse EUR X                          | 28.03.2024 | IE000IRGE9T8 | -      | -     | 10,10 |
| Ausschüttende Klasse EUR X                           | 12.09.2024 | IE000DI4QG31 | -      | -     | 3,70  |
| Ausschüttende Klasse GBP I2                          | 15.11.2018 | IE00BD102W51 | (7,13) | -     | -     |
| Thesaurierende Klasse GBP Z                          | 12.12.2019 | IE00BHR46W74 | (6,55) | 20,76 | 16,81 |
| Ausschüttende Klasse JPY I                           | 01.08.2024 | IE000N5JVY37 | -      | -     | 2,92  |
| Ausschüttende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert) | 01.08.2024 | IE000MPMZK49 | -      | -     | 10,08 |
| Thesaurierende Klasse SEK I                          | 12.07.2018 | IE00BG7P3L15 | (8,25) | 19,37 | 15,36 |
| Thesaurierende Klasse USD A                          | 09.06.2022 | IE000I861U99 | (1,70) | 20,75 | 16,51 |
| Thesaurierende Klasse USD I                          | 12.07.2018 | IE00BF4NG566 | (6,91) | 21,72 | 17,40 |
| Ausschüttende Klasse USD I                           | 17.08.2023 | IE00BF4NG673 | -      | 5,97  | 17,32 |
| Ausschüttende Klasse USD I2                          | 21.03.2019 | IE00BHXGRM40 | (6,82) | 21,73 | 17,49 |
| Thesaurierende Klasse USD I4                         | 25.04.2024 | IE000VVY0806 | -      | -     | 10,10 |
| Ausschüttende Klasse USD I5                          | 12.07.2018 | IE00BG7P3H78 | (6,54) | 22,04 | 17,77 |
| Thesaurierende Klasse USD U                          | 24.10.2024 | IE000SXD7C73 | -      | -     | 2,40  |
| Thesaurierende Klasse USD Z                          | 18.04.2019 | IE00BG7PPZ91 | (6,26) | 22,72 | 18,30 |

## Commodities

|  |            |              |         |         |      |
|--|------------|--------------|---------|---------|------|
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)  | 14.12.2022 | IE000GZB3BM6 | 4,30    | (11,79) | 8,26 |
| Thesaurierende Klasse GBP I2                           | 04.12.2024 | IE000ZY4ZH13 | -       | -       | 0,80 |
| Thesaurierende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert) | 09.08.2024 | IE000ZGAP0Y2 | -       | -       | 7,40 |
| Thesaurierende Klasse GBP I5                           | 29.03.2022 | IE00079M4L01 | (5,80)  | (7,22)  | 6,29 |
| Thesaurierende Klasse GBP P                            | 05.08.2024 | IE000YTBMG37 | -       | -       | 6,90 |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 15.03.2022 | IE0004O7KK00 | (2,90)  | (7,31)  | 5,56 |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 09.02.2022 | IE000MVZ49F4 | 12,00   | (6,52)  | 6,30 |
| Thesaurierende Klasse USD I3                           | 27.11.2024 | IE000OXC2H4  | -       | -       | 1,10 |
| Thesaurierende Klasse USD I5                           | 04.03.2022 | IE0000TMDNF9 | (2,20)  | (6,24)  | 6,65 |
| Thesaurierende Klasse USD M                            | 14.04.2022 | IE000D1UZ4M5 | (10,90) | (7,86)  | 4,99 |
| Thesaurierende Klasse USD Z                            | 15.02.2022 | IE000K7ZYIB8 | 11,64   | (5,92)  | 6,95 |

## Corporate Hybrid Bond

|  |            |              |         |      |      |
|--|------------|--------------|---------|------|------|
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | 23.09.2016 | IE00BD5YX427 | (13,56) | 8,14 | 9,08 |
| Ausschüttende Klasse CHF A             | 15.02.2024 | IE0002I6PTU2 | -       | -    | 4,80 |

## Anhang II (Fortsetzung)

### PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

#### Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

| Anteilklasse                           | Auflegungsdatum | ISIN         | Geschäftsjahr zum 31. Dezember |           |           |
|--|-----------------|--------------|--------------------------------|-----------|-----------|
|  |                 |              | 2022<br>%                      | 2023<br>% | 2024<br>% |
| Thesaurierende Klasse CHF I3           | 26.06.2024      | IE000GVHJEK8 | -                              | -         | 3,70      |
| Thesaurierende Klasse CHF P            | 27.04.2017      | IE00BD4H0K73 | (14,46)                        | 6,22      | 6,35      |
| Ausschüttende Klasse CHF P             | 17.06.2016      | IE00BDH8H834 | (14,47)                        | 6,09      | 6,42      |
| Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) | 18.07.2016      | IE00BDH8H727 | (14,72)                        | 7,57      | 8,41      |
| Thesaurierende Klasse EUR A            | 03.06.2016      | IE00BYV1RN13 | (14,66)                        | 7,53      | 8,44      |
| Thesaurierende Klasse EUR I            | 19.11.2015      | IE00BZ090894 | (14,13)                        | 8,14      | 9,03      |
| Ausschüttende Klasse EUR I             | 19.11.2015      | IE00BZ090902 | (14,14)                        | 8,17      | 9,08      |
| Thesaurierende Klasse EUR I2           | 03.02.2017      | IE00BYVF7770 | (14,00)                        | 8,24      | 9,24      |
| Ausschüttende Klasse EUR I2            | 24.12.2020      | IE00BD37NF41 | (14,03)                        | 8,24      | 9,19      |
| Thesaurierende Klasse EUR I3           | 13.09.2016      | IE00BD3H7K78 | (13,95)                        | 8,35      | 9,32      |
| Thesaurierende Klasse EUR I5           | 19.11.2015      | IE00BZ090787 | (13,87)                        | 8,50      | 9,38      |
| Thesaurierende Klasse EUR M            | 18.02.2016      | IE00BD9WHQ23 | (15,13)                        | 6,80      | 7,83      |
| Ausschüttende Klasse EUR M             | 13.02.2017      | IE00BZ0BMF67 | (15,17)                        | 6,90      | 7,74      |
| Thesaurierende Klasse EUR P            | 27.04.2017      | IE00BYVF7663 | (14,14)                        | 8,23      | 9,11      |
| Ausschüttende Klasse EUR P             | 24.06.2016      | IE00BD37ND27 | (14,05)                        | 8,07      | 9,10      |
| Thesaurierende Klasse GBP I            | 09.03.2017      | IE00BYMJ8V99 | (12,75)                        | 9,87      | 10,62     |
| Thesaurierende Klasse GBP I2           | 15.05.2017      | IE00BDRKGS35 | (12,63)                        | 10,02     | 10,77     |
| Ausschüttende Klasse GBP I2            | 24.08.2016      | IE00BZCPRS46 | (12,63)                        | 9,95      | 10,89     |
| Thesaurierende Klasse GBP P            | 16.08.2019      | IE00BH3W6W54 | (12,71)                        | 9,92      | 10,65     |
| Ausschüttende Klasse GBP P             | 19.05.2017      | IE00BD4H0M97 | (12,77)                        | 9,96      | 10,67     |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | 02.08.2019      | IE00BJR5T361 | (13,05)                        | 8,32      | 8,24      |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 18.07.2016      | IE00BDH8H610 | (12,77)                        | 9,73      | 10,23     |
| Thesaurierende Klasse USD A            | 10.08.2016      | IE00BD0PCH68 | (12,79)                        | 9,75      | 10,19     |
| Ausschüttende Klasse USD A             | 23.04.2021      | IE00BMT63Q97 | (12,83)                        | 9,67      | 10,27     |
| Thesaurierende Klasse USD C1           | 13.12.2017      | IE00BDFBJ677 | (13,67)                        | 8,70      | 9,05      |
| Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) | 19.09.2024      | IE0009UKJRP9 | -                              | -         | 2,26      |
| Thesaurierende Klasse USD I            | 14.06.2016      | IE00BDH8H503 | (12,29)                        | 10,36     | 10,93     |
| Ausschüttende Klasse USD I             | 23.04.2021      | IE00BMCFKY00 | (12,28)                        | 10,44     | 10,92     |
| Thesaurierende Klasse USD I2           | 03.02.2017      | IE00BDRKGR28 | (12,20)                        | 10,59     | 10,99     |
| Ausschüttende Klasse USD I2            | 03.02.2017      | IE00BD37NK93 | (12,20)                        | 10,45     | 11,01     |
| Thesaurierende Klasse USD M            | 15.12.2017      | IE00BDFBLB65 | (13,36)                        | 9,13      | 9,57      |
| Ausschüttende Klasse USD M             | 15.12.2017      | IE00BDFBJ784 | (13,35)                        | 9,01      | 9,57      |
| Thesaurierende Klasse USD P            | 05.05.2017      | IE00BD4H0L80 | (12,28)                        | 10,36     | 10,96     |
| Thesaurierende Klasse USD Z            | 20.01.2017      | IE00BZ56PT19 | (11,77)                        | 11,06     | 11,56     |

#### Developed Market FMP – 2027<sup>1</sup>

|                             |            |              |   |      |      |
|-----------------------------|------------|--------------|---|------|------|
| Thesaurierende Klasse EUR A | 31.07.2023 | IE0006ZF3U01 | - | 3,10 | 3,01 |
| Ausschüttende Klasse EUR I  | 15.09.2023 | IE000C576DF9 | - | 3,80 | 3,41 |
| Thesaurierende Klasse USD A | 31.07.2023 | IE000VQRCTO1 | - | 3,80 | 4,82 |
| Ausschüttende Klasse USD A  | 31.07.2023 | IE0000H8VV97 | - | 3,80 | 4,84 |
| Thesaurierende Klasse USD I | 31.07.2023 | IE000UVYX3U2 | - | 4,00 | 5,10 |

## Anhang II (Fortsetzung)

## PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

Developed Market FMP – 2027<sup>1</sup> (Fortsetzung)

| Anteilklasse                | Auflegungsdatum | ISIN         | Geschäftsjahr zum 31. Dezember |           |           |
|-----------------------------|-----------------|--------------|--------------------------------|-----------|-----------|
|                             |                 |              | 2022<br>%                      | 2023<br>% | 2024<br>% |
| Ausschüttende Klasse USD I  | 21.08.2023      | IE000ZFOERE3 | -                              | 4,80      | 5,19      |
| Thesaurierende Klasse USD X | 31.07.2023      | IE000JGNBMI5 | -                              | 3,90      | 5,10      |
| Ausschüttende Klasse USD X  | 31.07.2023      | IE000BKPP400 | -                              | 3,90      | -         |

## EMD Corporate – Social and Environmental Transition

|  |            |              |         |      |      |
|--|------------|--------------|---------|------|------|
| Thesaurierende Klasse CHF I            | 28.06.2013 | IE00B97C6C50 | (14,24) | 3,74 | 3,96 |
| Thesaurierende Klasse CHF I4           | 05.11.2019 | IE00BK70Z858 | (13,94) | -    | -    |
| Thesaurierende Klasse EUR A            | 17.12.2015 | IE00B984JD20 | (14,60) | 4,73 | 5,76 |
| Thesaurierende Klasse EUR I            | 28.06.2013 | IE00B984JG50 | (13,94) | 5,69 | 6,63 |
| Thesaurierende Klasse EUR I3           | 29.07.2016 | IE00BD3H7L85 | (13,64) | 5,95 | 7,07 |
| Thesaurierende Klasse EUR M            | 18.02.2016 | IE00BWB97F31 | (15,32) | 3,89 | 5,06 |
| Ausschüttende Klasse EUR M             | 18.02.2016 | IE00BWB97G48 | (15,23) | 3,81 | 4,99 |
| Thesaurierende Klasse EUR X            | 20.07.2015 | IE00BXDZNR08 | (13,59) | 6,08 | 7,19 |
| Thesaurierende Klasse GBP I            | 28.06.2013 | IE00B984KJ54 | (12,60) | 7,29 | 8,23 |
| Thesaurierende Klasse SEK A            | 01.02.2018 | IE00BYMJ8H55 | (14,29) | 4,96 | 5,58 |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 31.10.2014 | IE00B984MC26 | (12,64) | 6,95 | 7,64 |
| Thesaurierende Klasse USD A            | 28.06.2013 | IE00B984MH70 | (12,76) | 7,03 | 7,71 |
| Thesaurierende Klasse USD C1           | 29.08.2017 | IE00BDFBJC35 | (13,70) | 6,01 | 6,58 |
| Thesaurierende Klasse USD I            | 28.06.2013 | IE00B984QG44 | (12,06) | 7,88 | 8,50 |
| Ausschüttende Klasse USD I             | 28.06.2013 | IE00B984QK89 | (12,07) | 7,90 | 8,60 |
| Thesaurierende Klasse USD I2           | 25.03.2015 | IE00B984N180 | (11,89) | 8,05 | 8,77 |
| Thesaurierende Klasse USD I5           | 11.06.2014 | IE00BCFFV006 | (11,68) | -    | -    |
| Thesaurierende Klasse USD M            | 03.10.2017 | IE00BDFBJD42 | (13,39) | 6,08 | 6,83 |
| Ausschüttende Klasse USD M             | 03.11.2017 | IE00BDFBJF65 | (13,41) | 6,16 | 6,82 |

## Emerging Market Debt - Hard Currency

|  |            |              |         |       |       |
|--|------------|--------------|---------|-------|-------|
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)                 | 26.02.2019 | IE00BF0K7B44 | (20,61) | 11,27 | 10,81 |
| Ausschüttende Klasse AUD I                             | 26.05.2020 | IE00B986FB81 | (20,07) | 12,11 | 11,80 |
| Thesaurierende Klasse CAD I3 (nicht währungsgesichert) | 31.10.2022 | IE000ESKKWI7 | 10,40   | 11,05 | 23,65 |
| Thesaurierende Klasse CHF I2                           | 13.01.2020 | IE00BKKL6823 | (21,12) | 9,31  | 8,52  |
| Thesaurierende Klasse CHF P                            | 24.01.2018 | IE00BFNPGF37 | (21,23) | 9,24  | 8,34  |
| Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)                 | 16.04.2018 | IE00B986FR42 | (21,52) | 10,37 | 10,42 |
| Thesaurierende Klasse EUR A                            | 31.05.2013 | IE00B986FT65 | (21,63) | 10,49 | 10,35 |
| Thesaurierende Klasse EUR I                            | 31.05.2013 | IE00B986G486 | (21,06) | 11,15 | 11,17 |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)  | 17.09.2019 | IE00BK5V1269 | (13,70) | 9,98  | 20,93 |
| Ausschüttende Klasse EUR I                             | 07.10.2016 | IE00B986GB56 | (21,04) | 11,36 | 11,12 |
| Thesaurierende Klasse EUR I2                           | 18.12.2019 | IE00B986GC63 | (20,98) | 11,44 | 11,17 |
| Ausschüttende Klasse EUR I2                            | 06.11.2019 | IE00BK6H5655 | (21,02) | 11,56 | 11,27 |
| Thesaurierende Klasse EUR I3                           | 29.07.2016 | IE00BD0PCJ82 | (20,88) | 11,44 | 11,38 |
| Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert) | 06.09.2019 | IE00BJ7VWB39 | (13,44) | -     | -     |
| Thesaurierende Klasse EUR I4                           | 10.12.2015 | IE00BXQ9CQ11 | (20,87) | 11,63 | 11,41 |

## Anhang II (Fortsetzung)

### PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

#### Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

| Anteilklasse   | Auflegungsdatum | ISIN         | Geschäftsjahr zum 31. Dezember |           |           |
|--|-----------------|--------------|--------------------------------|-----------|-----------|
|  |                 |              | 2022<br>%                      | 2023<br>% | 2024<br>% |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert) | 05.07.2022      | IE000EFK10A5 | 0,00                           | 10,40     | 21,20     |
| Thesaurierende Klasse EUR M                            | 18.02.2016      | IE00BSNLZN33 | (22,24)                        | 9,61      | 9,38      |
| Ausschüttende Klasse EUR M                             | 18.02.2016      | IE00BSNLZP56 | (22,23)                        | 9,68      | 9,37      |
| Thesaurierende Klasse EUR P                            | 23.01.2018      | IE00BFNPGG44 | (21,07)                        | 11,28     | 11,26     |
| Thesaurierende Klasse EUR Z                            | 29.12.2017      | IE00BKJB1B19 | (20,56)                        | 12,09     | 11,87     |
| Thesaurierende Klasse GBP I                            | 16.12.2016      | IE00BDDNB708 | (19,88)                        | 12,88     | 12,71     |
| Ausschüttende Klasse GBP I                             | 21.02.2018      | IE00BZ1D2402 | (19,86)                        | 12,97     | 12,74     |
| Thesaurierende Klasse GBP I2                           | 26.01.2018      | IE00B986H344 | (19,71)                        | 12,99     | 12,87     |
| Ausschüttende Klasse GBP I2                            | 06.07.2015      | IE00B986H450 | (19,77)                        | 13,28     | 12,85     |
| Thesaurierende Klasse GBP P                            | 14.03.2018      | IE00BF0V1041 | (19,85)                        | 12,97     | 12,72     |
| Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)                 | 09.01.2019      | IE00BF0K7C50 | (19,74)                        | 11,87     | 11,20     |
| Thesaurierende Klasse JPY I                            | 11.12.2017      | IE00BD4H0D07 | (21,02)                        | 7,41      | 6,63      |
| Thesaurierende Klasse SEK A                            | 05.11.2015      | IE00BYSW3F11 | (21,55)                        | 10,56     | 10,02     |
| Thesaurierende Klasse SEK I2                           | 19.05.2021      | IE00BN92ZN54 | (20,89)                        | 11,51     | 10,95     |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)                 | 17.02.2015      | IE00B99K3R14 | (19,90)                        | 11,36     | 10,18     |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)                 | 31.10.2014      | IE00B986J720 | (19,53)                        | 13,08     | 12,42     |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 31.05.2013      | IE00B986J944 | (19,51)                        | 13,06     | 12,33     |
| Ausschüttende Klasse USD A                             | 30.10.2020      | IE00B986JM76 | (19,54)                        | 13,01     | 12,37     |
| Thesaurierende Klasse USD C1                           | 24.08.2017      | IE00BDFBJ891 | (20,28)                        | 11,95     | 11,21     |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 31.05.2013      | IE00B99K4563 | (18,98)                        | 13,87     | 13,13     |
| Ausschüttende Klasse USD I                             | 31.05.2013      | IE00B99K4670 | (18,95)                        | 13,87     | 13,18     |
| Thesaurierende Klasse USD I2                           | 15.11.2016      | IE00B99K6R29 | (18,80)                        | 13,97     | 13,27     |
| Ausschüttende Klasse USD I2                            | 20.04.2018      | IE00B99K6W71 | (18,74)                        | 14,00     | 13,20     |
| Ausschüttende Klasse USD I3                            | 20.03.2019      | IE00BCFFTG28 | (18,77)                        | 14,22     | 13,26     |
| Thesaurierende Klasse USD M                            | 25.08.2017      | IE00BDFBJ909 | (20,15)                        | 12,21     | 11,40     |
| Ausschüttende Klasse USD M                             | 15.09.2017      | IE00BDFBJB28 | (20,22)                        | 12,26     | 11,52     |
| Thesaurierende Klasse USD P                            | 11.01.2018      | IE00BTKH9G20 | (18,86)                        | 13,85     | 13,15     |
| Thesaurierende Klasse USD X                            | 16.12.2021      | IE000BX4CH70 | (18,74)                        | 14,11     | 13,55     |
| Thesaurierende Klasse USD Z                            | 26.04.2017      | IE00BD4H0C99 | (18,34)                        | 14,67     | 13,93     |

#### Emerging Market Debt - Local Currency

|   |            |              |         |       |        |
|---|------------|--------------|---------|-------|--------|
| Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich)  | 04.06.2015 | IE00BTLWS819 | (15,78) | 9,48  | (6,64) |
| Thesaurierende Klasse AUD B             | 04.06.2015 | IE00BTLWS702 | (15,89) | 9,45  | (6,71) |
| Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich) | 04.06.2015 | IE00BTLWSB42 | (15,84) | -     | -      |
| Thesaurierende Klasse AUD C2            | 04.06.2015 | IE00BTLWS926 | (15,91) | 9,59  | -      |
| Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)  | 04.06.2015 | IE00BTLWSD65 | (15,97) | 9,79  | (6,90) |
| Thesaurierende Klasse AUD E             | 04.06.2015 | IE00BTLWSC58 | (15,91) | 9,46  | (6,60) |
| Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)  | 04.06.2015 | IE00BTLWSG96 | (15,20) | 10,70 | (5,59) |
| Thesaurierende Klasse AUD T             | 04.06.2015 | IE00BTLWSF89 | (15,01) | 10,48 | (5,73) |
| Thesaurierende Klasse EUR A             | 28.06.2013 | IE00B975F382 | (15,87) | 10,28 | (5,98) |
| Thesaurierende Klasse EUR I             | 28.06.2013 | IE00B975F507 | (15,27) | 11,02 | (5,28) |

## Anhang II (Fortsetzung)

## PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

## Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum 31. Dezember

| Anteilklasse   | Auflegungsdatum | ISIN         | Geschäftsjahr zum 31. Dezember |           |           |
|--|-----------------|--------------|--------------------------------|-----------|-----------|
|  |                 |              | 2022<br>%                      | 2023<br>% | 2024<br>% |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)  | 27.06.2017      | IE00BD5BKF38 | (7,15)                         | 10,09     | 3,05      |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert) | 29.12.2015      | IE00BZ1J8T56 | (7,10)                         | 10,22     | 3,26      |
| Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)  | 14.03.2017      | IE00BYX7M324 | (6,87)                         | 10,41     | 3,33      |
| Thesaurierende Klasse EUR Y (nicht währungsgesichert)  | 25.01.2021      | IE00BMY4BL92 | (6,77)                         | 10,41     | 3,54      |
| Thesaurierende Klasse GBP I                            | 22.09.2017      | IE00BDZRNT61 | (13,95)                        | 12,81     | (3,82)    |
| Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) | 02.11.2016      | IE00BYX4Q207 | (1,63)                         | 7,76      | (1,34)    |
| Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)  | 02.11.2016      | IE00BYSW3D96 | (1,63)                         | 7,94      | (1,29)    |
| Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)  | 25.01.2021      | IE00BMY4BM00 | (1,50)                         | 7,92      | (1,31)    |
| Thesaurierende Klasse SEK A                            | 05.11.2015      | IE00BYSW3401 | (15,78)                        | 10,22     | (6,28)    |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)                 | 04.03.2015      | IE00B99K6K59 | (14,02)                        | 11,31     | (6,11)    |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)                 | 31.10.2014      | IE00B99K7G88 | (13,38)                        | 12,99     | (4,03)    |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 28.06.2013      | IE00B99K7H95 | (13,46)                        | 12,98     | (4,10)    |
| Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich)                 | 04.06.2015      | IE00BTLWSH04 | (14,56)                        | 11,71     | (5,40)    |
| Thesaurierende Klasse USD B                            | 04.06.2015      | IE00B99K7M49 | (14,64)                        | 11,51     | (5,39)    |
| Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich)                | 04.06.2015      | IE00BTLWSJ28 | (14,56)                        | 11,71     | -         |
| Thesaurierende Klasse USD C2                           | 04.06.2015      | IE00B99K7Z77 | (14,64)                        | -         | -         |
| Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)                 | 04.06.2015      | IE00BTLWSL40 | (14,56)                        | 11,71     | (5,40)    |
| Thesaurierende Klasse USD E                            | 04.06.2015      | IE00BTLWSK33 | (14,64)                        | 11,64     | (5,38)    |
| Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)                 | 02.09.2021      | IE00080NF9F1 | (12,87)                        | 13,97     | (3,49)    |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 28.06.2013      | IE00B9Z1CL57 | (12,92)                        | 13,88     | (3,36)    |
| Ausschüttende Klasse USD I                             | 14.10.2016      | IE00BYT43784 | (12,85)                        | 13,94     | (3,40)    |
| Thesaurierende Klasse USD I2                           | 13.08.2014      | IE00B9Z1CN71 | (12,69)                        | 14,04     | (3,24)    |
| Thesaurierende Klasse USD I5                           | 26.09.2018      | IE00BYNVFZ74 | (15,46)                        | 12,33     | (3,04)    |
| Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)                 | 31.03.2016      | IE00BTLWSM56 | (13,76)                        | 12,86     | (4,47)    |
| Thesaurierende Klasse USD T                            | 04.06.2015      | IE00B9Z1CQ03 | (13,81)                        | 12,78     | (4,43)    |
| Thesaurierende Klasse USD X                            | 23.10.2013      | IE00B9Z1CS27 | (12,49)                        | 14,39     | (2,96)    |
| Thesaurierende Klasse USD Y                            | 14.01.2021      | IE00BMY4BK85 | (12,53)                        | 14,32     | (2,94)    |
| Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)                 | 05.06.2015      | IE00BTLWSP87 | (12,08)                        | 14,22     | (2,99)    |
| Thesaurierende Klasse ZAR B                            | 05.06.2015      | IE00BTLWSN63 | (12,11)                        | 14,18     | (3,00)    |
| Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich)                | 05.06.2015      | IE00BTLWSR02 | (12,07)                        | 14,29     | -         |
| Thesaurierende Klasse ZAR C2                           | 06.01.2023      | IE00BTLWSQ94 | (12,10)                        | 12,75     | -         |
| Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)                 | 05.06.2015      | IE00BTLWSS19 | (12,07)                        | 14,22     | (2,99)    |
| Thesaurierende Klasse ZAR E                            | 05.06.2015      | IE00BTLWST26 | (12,10)                        | 14,12     | (2,95)    |
| Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)                 | 05.06.2015      | IE00BTLWSW54 | (11,19)                        | 15,36     | (2,02)    |
| Thesaurierende Klasse ZAR T                            | 05.06.2015      | IE00BTLWSV48 | (11,23)                        | 15,33     | (2,02)    |
| <b>Emerging Market Debt Blend</b>                      |                 |              |                                |           |           |
| Ausschüttende Klasse AUD I3                            | 06.11.2019      | IE00BKPHZ39  | (11,15)                        | 11,37     | 7,63      |
| Thesaurierende Klasse EUR A                            | 04.12.2015      | IE00BK4YZ020 | (12,89)                        | 8,28      | 4,68      |
| Thesaurierende Klasse EUR I                            | 08.07.2014      | IE00BK4YYZ03 | (12,29)                        | 8,97      | 5,46      |
| Ausschüttende Klasse EUR I                             | 19.06.2015      | IE00BY7S2G49 | (12,26)                        | 8,97      | 5,52      |

## Anhang II (Fortsetzung)

### PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

#### Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

| Anteilklasse   | Auflegungsdatum | ISIN         | Geschäftsjahr zum 31. Dezember |           |           |
|--|-----------------|--------------|--------------------------------|-----------|-----------|
|  |                 |              | 2022<br>%                      | 2023<br>% | 2024<br>% |
| Thesaurierende Klasse EUR I2                           | 27.05.2014      | IE00BMMV6Y07 | (12,16)                        | 9,13      | 5,58      |
| Ausschüttende Klasse EUR I2                            | 24.02.2015      | IE00BMMV6Z14 | (12,21)                        | 9,24      | 5,68      |
| Ausschüttende Klasse EUR I3                            | 05.11.2019      | IE00BLDYHM63 | (12,11)                        | 9,37      | 5,55      |
| Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert) | 23.03.2017      | IE00BD3WDH16 | (8,23)                         | 8,77      | 10,12     |
| Thesaurierende Klasse EUR I5                           | 23.04.2014      | IE00BLDYHL56 | (11,95)                        | 9,39      | 5,78      |
| Thesaurierende Klasse EUR M                            | 29.01.2016      | IE00BSNLZD35 | (13,62)                        | 7,51      | 3,79      |
| Ausschüttende Klasse EUR M                             | 29.01.2016      | IE00BSNLZF58 | (13,51)                        | 7,29      | 3,93      |
| Thesaurierende Klasse EUR Z                            | 02.06.2014      | IE00BKKN1384 | (11,69)                        | 9,86      | 6,15      |
| Thesaurierende Klasse GBP I                            | 31.03.2016      | IE00BK4YYR29 | (9,05)                         | 8,64      | 3,72      |
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)  | 12.04.2017      | IE00BD3WDG09 | (3,22)                         | 6,04      | 4,84      |
| Ausschüttende Klasse GBP I                             | 22.05.2018      | IE00BK4YYW71 | (9,08)                         | 8,63      | 3,74      |
| Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)   | 22.05.2018      | IE00BF0V1488 | (3,16)                         | 5,83      | 4,81      |
| Thesaurierende Klasse GBP P                            | 13.05.2019      | IE00BGPZW838 | (9,06)                         | 8,68      | 3,65      |
| Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)  | 13.05.2019      | IE00BGPZW721 | (3,24)                         | 5,99      | 4,69      |
| Thesaurierende Klasse GBP Z                            | 17.03.2016      | IE00BKKN1509 | (8,41)                         | 9,36      | 4,44      |
| Thesaurierende Klasse NOK U                            | 13.03.2017      | IE00BZCPRQ22 | (9,72)                         | 12,67     | 7,93      |
| Thesaurierende Klasse SEK A                            | 05.11.2015      | IE00BMN92P65 | (9,24)                         | 8,57      | 5,96      |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)                 | 15.09.2017      | IE00BMN93084 | (15,04)                        | 9,75      | 2,96      |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)                 | 15.09.2017      | IE00BRJTF125 | (14,64)                        | 11,56     | 2,20      |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 04.02.2016      | IE00BK4YYX88 | (14,65)                        | 11,44     | 2,14      |
| Thesaurierende Klasse USD C1                           | 24.08.2017      | IE00BDFBKG46 | (15,50)                        | 10,33     | 1,21      |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 23.04.2014      | IE00BK4YYS36 | (14,12)                        | 12,28     | 2,89      |
| Ausschüttende Klasse USD I                             | 01.06.2016      | IE00BK4YYT43 | (13,98)                        | 12,23     | 2,90      |
| Ausschüttende Klasse USD I2                            | 24.02.2015      | IE00BMN93530 | (13,96)                        | 12,49     | 3,00      |
| Thesaurierende Klasse USD I3                           | 20.12.2017      | IE00BD21NN56 | (13,90)                        | -         | -         |
| Thesaurierende Klasse USD I5                           | 24.07.2023      | IE00BYSW4H00 | -                              | 4,00      | 3,27      |
| Thesaurierende Klasse USD M                            | 25.08.2017      | IE00BF46ZC54 | (15,32)                        | 10,49     | 1,42      |
| Ausschüttende Klasse USD M                             | 26.09.2017      | IE00BDFBKH52 | (15,37)                        | 10,60     | 1,30      |
| Thesaurierende Klasse USD Z                            | 28.09.2015      | IE00BKKN1616 | (13,46)                        | 13,08     | 3,63      |

#### Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend

|                              |            |              |         |      |        |
|------------------------------|------------|--------------|---------|------|--------|
| Thesaurierende Klasse AUD I2 | 16.02.2021 | IE00BM909D01 | (12,69) | 7,15 | 2,26   |
| Thesaurierende Klasse NOK I  | 09.05.2018 | IE00BYT26W83 | (11,43) | 8,34 | 2,74   |
| Thesaurierende Klasse NOK I3 | 05.09.2023 | IE00BYT26Z15 | -       | 3,13 | 2,93   |
| Thesaurierende Klasse USD I  | 10.07.2017 | IE00BD3DV032 | (14,33) | 8,32 | (0,36) |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 16.03.2021 | IE00BMXC7C74 | (14,24) | 8,48 | -      |
| Thesaurierende Klasse USD Z  | 02.11.2017 | IE00BD3DV362 | (13,84) | 9,00 | 0,18   |

#### Emerging Markets Equity

|                              |            |              |         |      |       |
|------------------------------|------------|--------------|---------|------|-------|
| Thesaurierende Klasse AUD B  | 30.11.2016 | IE00BYN4NY18 | (27,37) | 3,18 | 15,18 |
| Thesaurierende Klasse AUD C2 | 30.11.2016 | IE00BYN4NZ25 | (27,37) | 3,29 | -     |

## Anhang II (Fortsetzung)

## PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

## Emerging Markets Equity (Fortsetzung)

| Anteilklasse   | Auflegungsdatum | ISIN         | Geschäftsjahr zum 31. Dezember |           |           |
|--|-----------------|--------------|--------------------------------|-----------|-----------|
|  |                 |              | 2022<br>%                      | 2023<br>% | 2024<br>% |
| Thesaurierende Klasse AUD E                          | 30.11.2016      | IE00BYN4P011 | (27,39)                        | 3,18      | 15,30     |
| Thesaurierende Klasse AUD T                          | 30.11.2016      | IE00BYN4P128 | (26,70)                        | 4,33      | 16,32     |
| Ausschüttende Klasse CAD I (nicht währungsgesichert) | 24.01.2018      | IE00BF8P8L84 | (18,34)                        | 4,89      | 30,24     |
| Ausschüttende Klasse CAD I2                          | 17.12.2021      | IE000TTJ7N81 | (24,79)                        | 6,93      | 18,59     |
| Thesaurierende Klasse EUR I                          | 04.10.2010      | IE00B3SRML86 | (26,37)                        | 5,12      | 17,37     |
| Thesaurierende Klasse EUR M                          | 18.02.2016      | IE00BWB99R92 | (27,80)                        | 3,04      | 15,04     |
| Thesaurierende Klasse EUR Z                          | 05.02.2018      | IE00BKJ9SM50 | (25,58)                        | 6,14      | 18,51     |
| Thesaurierende Klasse GBP I                          | 15.01.2014      | IE00B3SC5588 | (25,19)                        | 6,76      | 18,79     |
| Thesaurierende Klasse GBP Z                          | 17.03.2016      | IE00BKJ9SX65 | (24,48)                        | 7,94      | 19,92     |
| Thesaurierende Klasse USD A                          | 04.10.2010      | IE00B3M56506 | (24,66)                        | 6,78      | 18,25     |
| Thesaurierende Klasse USD B                          | 30.11.2016      | IE00BYN4P235 | (25,34)                        | 5,62      | 17,11     |
| Thesaurierende Klasse USD C2                         | 30.11.2016      | IE00BYN4P342 | (25,36)                        | 5,53      | -         |
| Thesaurierende Klasse USD E                          | 30.11.2016      | IE00BYN4P458 | (25,43)                        | 5,63      | 17,14     |
| Thesaurierende Klasse USD I                          | 04.10.2010      | IE00B3NBSZ12 | (23,86)                        | 7,69      | 19,51     |
| Thesaurierende Klasse USD M                          | 27.05.2016      | IE00BYQQ4J61 | (25,40)                        | 5,66      | 17,14     |
| Thesaurierende Klasse USD T                          | 30.11.2016      | IE00BYN4P565 | (24,72)                        | 6,81      | 18,33     |
| Thesaurierende Klasse USD Z                          | 30.06.2014      | IE00BKJ9TD35 | (23,12)                        | 8,87      | 20,74     |
| Thesaurierende Klasse ZAR B                          | 30.11.2016      | IE00BYN4P672 | (23,78)                        | 7,83      | 19,63     |
| Thesaurierende Klasse ZAR C2                         | 30.11.2016      | IE00BYN4P789 | (23,79)                        | 7,82      | -         |
| Thesaurierende Klasse ZAR E                          | 30.11.2016      | IE00BYN4P896 | (23,78)                        | 7,83      | 19,63     |
| Thesaurierende Klasse ZAR T                          | 30.11.2016      | IE00BYN4P904 | (23,02)                        | 8,92      | 20,84     |

## Emerging Markets Select Equity\*

|   |            |              |         |   |   |
|---|------------|--------------|---------|---|---|
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) | 08.01.2020 | IE00BKLC3T45 | (20,04) | - | - |
| Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert) | 03.12.2018 | IE00BG365X48 | (14,04) | - | - |
| Thesaurierende Klasse USD I                           | 24.10.2017 | IE00BZ3CFW46 | (25,02) | - | - |
| Thesaurierende Klasse USD I5                          | 22.11.2017 | IE00BZ3CFZ76 | (24,71) | - | - |

\* Das Portfolio wurde am 7. September 2023 aufgelöst.

## Euro Bond

|                             |            |              |         |      |        |
|-----------------------------|------------|--------------|---------|------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR A | 19.09.2024 | IE0006FHXI29 | -       | -    | 0,90   |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 13.11.2018 | IE00BD9GYJ62 | (15,59) | 9,94 | 5,75   |
| Ausschüttende Klasse EUR I  | 14.11.2018 | IE00BFZMGH42 | (15,68) | 9,96 | 5,82   |
| Thesaurierende Klasse EUR M | 24.12.2024 | IE00BL3STZ56 | -       | -    | (0,10) |
| Thesaurierende Klasse EUR Z | 12.04.2024 | IE0004C5BIP1 | -       | -    | 5,00   |

## Euro Bond Absolute Return

|                             |            |              |        |      |      |
|-----------------------------|------------|--------------|--------|------|------|
| Thesaurierende Klasse EUR A | 23.12.2024 | IE000FWTH1G0 | -      | -    | 0,00 |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 29.11.2018 | IE00BFZMG962 | (4,71) | 8,17 | 8,17 |
| Ausschüttende Klasse EUR I  | 29.11.2018 | IE00BFZMGB89 | (4,58) | 8,10 | 8,19 |

## Anhang II (Fortsetzung)

### PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

#### Euro Bond Absolute Return (Fortsetzung)

| Anteilklasse                 | Auflegungsdatum | ISIN         | Geschäftsjahr zum 31. Dezember |           |           |
|------------------------------|-----------------|--------------|--------------------------------|-----------|-----------|
|                              |                 |              | 2022<br>%                      | 2023<br>% | 2024<br>% |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 | 20.12.2024      | IE0002AJCKR4 | -                              | -         | 0,00      |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 | 28.03.2019      | IE00BGL9FP72 | (4,44)                         | 8,34      | 8,40      |
| Thesaurierende Klasse EUR Z  | 04.04.2024      | IE0000RGR7Q4 | -                              | -         | 5,80      |
| Thesaurierende Klasse USD Z  | 22.11.2019      | IE00BHXMF734 | (2,25)                         | 10,87     | 10,38     |

#### European High Yield Bond

|  |            |              |         |       |       |
|--|------------|--------------|---------|-------|-------|
| Thesaurierende Klasse CHF I            | 14.03.2023 | IE00BNH72864 | -       | 7,50  | 6,70  |
| Thesaurierende Klasse EUR I            | 27.06.2014 | IE00BNH72V92 | (9,53)  | 13,53 | 9,35  |
| Thesaurierende Klasse EUR I2           | 08.11.2023 | IE00BNH72Y24 | -       | 5,40  | 9,58  |
| Thesaurierende Klasse EUR I5           | 22.11.2023 | IE000U0XGY04 | -       | 4,40  | -     |
| Ausschüttende Klasse EUR I5            | 15.07.2024 | IE000KNZ9XN5 | -       | -     | 5,07  |
| Thesaurierende Klasse EUR M            | 29.01.2016 | IE00BSNLZ880 | (10,59) | 12,11 | 8,12  |
| Thesaurierende Klasse EUR X            | 20.02.2018 | IE00BD2B9W69 | (9,15)  | 13,96 | 9,81  |
| Thesaurierende Klasse EUR Y            | 04.01.2023 | IE000TAL07E4 | -       | 13,00 | 9,91  |
| Ausschüttende Klasse EUR Y             | 27.06.2023 | IE000MDTVTW7 | -       | 8,72  | 9,89  |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 31.10.2014 | IE00BNH73J48 | (8,12)  | 15,17 | 10,44 |
| Thesaurierende Klasse USD I            | 27.06.2014 | IE00BNH73L69 | (7,54)  | 15,88 | 11,16 |
| Thesaurierende Klasse USD X            | 12.01.2018 | IE00BD2B9Y83 | (7,15)  | 16,32 | 11,65 |
| Thesaurierende Klasse USD Z            | 26.04.2019 | IE00BPT29L50 | (6,95)  | 16,53 | 11,82 |

#### European Sustainable Equity

|   |            |              |         |       |        |
|---|------------|--------------|---------|-------|--------|
| Ausschüttende Klasse EUR A                            | 12.01.2022 | IE000YS2J411 | (20,70) | 17,78 | 4,39   |
| Thesaurierende Klasse EUR I                           | 24.02.2021 | IE00BMQC7246 | (24,96) | 18,99 | 5,26   |
| Ausschüttende Klasse EUR I                            | 24.02.2021 | IE00BMQC7B38 | (25,02) | 19,00 | 5,30   |
| Ausschüttende Klasse EUR I3                           | 07.10.2021 | IE000S1PE6L2 | (24,86) | 19,19 | 5,48   |
| Thesaurierende Klasse EUR I5                          | 20.07.2021 | IE00BM9TKM36 | (24,69) | 19,22 | 5,69   |
| Thesaurierende Klasse EUR M                           | 24.02.2021 | IE00BMG4Q673 | (26,23) | 16,99 | 3,48   |
| Thesaurierende Klasse EUR Z                           | 29.03.2021 | IE00BKP80429 | (24,57) | 19,74 | 5,95   |
| Thesaurierende Klasse USD A (nicht währungsgesichert) | 15.03.2021 | IE00BKPKM643 | (30,17) | 22,04 | (2,14) |
| Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) | 15.03.2021 | IE00BNC01617 | (29,62) | 23,19 | (1,29) |
| Thesaurierende Klasse USD M (nicht währungsgesichert) | 15.03.2021 | IE00BKPKM536 | (30,80) | 21,11 | (2,92) |

#### Event Driven

|                              |            |              |      |      |        |
|------------------------------|------------|--------------|------|------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR I  | 17.01.2023 | IE000GM3WKE5 | -    | 3,10 | 4,85   |
| Ausschüttende Klasse EUR I5  | 20.05.2024 | IE000T1QUSA0 | -    | -    | 5,20   |
| Thesaurierende Klasse GBP I5 | 26.10.2022 | IE0004B8PGL9 | 1,10 | 4,25 | 8,35   |
| Ausschüttende Klasse GBP I5  | 26.10.2022 | IE000TEWJNL5 | 1,10 | 4,35 | 7,01   |
| Thesaurierende Klasse GBP P  | 26.10.2022 | IE000TQXBRW2 | 1,00 | 3,96 | 6,86   |
| Thesaurierende Klasse JPY I  | 25.10.2024 | IE0002WRJM06 | -    | -    | (0,36) |
| Thesaurierende Klasse USD I  | 26.10.2022 | IE000F96D003 | 1,20 | 4,25 | 8,15   |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 26.10.2022 | IE00033HFZ64 | 1,30 | 4,74 | 8,11   |

## Anhang II (Fortsetzung)

## PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

| Anteilklasse  | Auflegungsdatum | ISIN         | Geschäftsjahr zum 31. Dezember |           |           |
|---|-----------------|--------------|--------------------------------|-----------|-----------|
|   |                 |              | 2022<br>%                      | 2023<br>% | 2024<br>% |
| Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)                          | 03.02.2021      | IE00BMH55D96 | (17,25)                        | 4,22      | -         |
| Thesaurierende Klasse EUR I Benchmark Währungsgesicherte Klasse | 31.08.2023      | IE000F6CEDO2 | -                              | 4,00      | 1,83      |
| Ausschüttende Klasse GBP P                                      | 15.08.2024      | IE000LBGW5W1 | -                              | -         | (3,00)    |
| Thesaurierende Klasse USD C1                                    | 03.01.2018      | IE00B8H49690 | (16,72)                        | 5,25      | (2,55)    |
| Thesaurierende Klasse USD I Benchmark Währungsgesicherte Klasse | 26.09.2022      | IE000028YR76 | 1,80                           | 7,86      | 3,10      |
| Thesaurierende Klasse USD I                                     | 16.07.2012      | IE00B8GFHY73 | (15,67)                        | 6,54      | (1,36)    |
| Thesaurierende Klasse USD M                                     | 02.07.2018      | IE00BDFBKC08 | (16,36)                        | 6,00      | (1,99)    |
| Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)                          | 03.02.2021      | IE00BMH55G28 | (16,15)                        | 6,03      | -         |
| Thesaurierende Klasse USD Z                                     | 20.01.2017      | IE00BKJ9T774 | (15,41)                        | 6,83      | (1,20)    |
| Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)                          | 03.02.2021      | IE00BMH55J58 | (13,12)                        | 8,79      | -         |

## Global Diversified Income FMP – 2024\*

|                             |            |              |        |      |   |
|-----------------------------|------------|--------------|--------|------|---|
| Thesaurierende Klasse EUR A | 07.07.2020 | IE00BL1NN727 | (6,39) | 3,31 | - |
| Ausschüttende Klasse EUR A  | 10.07.2020 | IE00BL1NN834 | (6,28) | 3,20 | - |
| Ausschüttende Klasse EUR I  | 29.07.2020 | IE00BL1NNB65 | (6,00) | 3,72 | - |
| Ausschüttende Klasse GBP I  | 22.06.2020 | IE00BK5C7S77 | (4,41) | 5,42 | - |
| Ausschüttende Klasse HKD A  | 28.07.2020 | IE00BL1NN271 | (4,88) | 4,48 | - |
| Ausschüttende Klasse SGD A  | 22.06.2020 | IE00BL1NNG11 | (4,56) | 4,11 | - |
| Thesaurierende Klasse USD A | 22.06.2020 | IE00BL1NMV96 | (4,39) | 5,49 | - |
| Ausschüttende Klasse USD A  | 22.06.2020 | IE00BL1NMW04 | (4,28) | 5,35 | - |
| Thesaurierende Klasse USD I | 22.06.2020 | IE00BL1NMX11 | (3,99) | 5,84 | - |
| Ausschüttende Klasse USD I  | 22.06.2020 | IE00BL1NMY28 | (3,99) | 5,89 | - |
| Thesaurierende Klasse USD X | 22.06.2020 | IE00BL1NMZ35 | (4,08) | 5,84 | - |
| Ausschüttende Klasse USD X  | 22.06.2020 | IE00BL1NN057 | (3,94) | 5,72 | - |

\* Das Portfolio wurde am 28. Juni 2024 aufgelöst.

## Global Equity Megatrends

|  |            |              |         |        |       |
|--|------------|--------------|---------|--------|-------|
| Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)  | 13.08.2024 | IE0004UGOUZ9 | -       | -      | 13,60 |
| Thesaurierende Klasse EUR I                            | 22.12.2023 | IE00BKPHW986 | -       | (0,50) | 31,66 |
| Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)  | 19.10.2018 | IE00BFZ89Z14 | (9,70)  | 16,89  | 29,58 |
| Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) | 17.05.2024 | IE000GQN6QF8 | -       | -      | 9,00  |
| Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)  | 20.06.2024 | IE000I9Q4L26 | -       | -      | 11,38 |
| Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)  | 05.07.2023 | IE000MDM6XI6 | -       | 6,30   | 25,78 |
| Thesaurierende Klasse HKD A                            | 20.12.2024 | IE0005N2WZ07 | -       | -      | 0,30  |
| Thesaurierende Klasse SGD A                            | 08.12.2023 | IE000HM1TOC0 | -       | 4,25   | 20,38 |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 27.04.2018 | IE00BFMHRM44 | (14,51) | 21,88  | 22,51 |
| Thesaurierende Klasse USD C1                           | 27.04.2018 | IE00BFMHR506 | (15,40) | 20,72  | 21,21 |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 27.04.2018 | IE00BFMHRK20 | (13,78) | 22,91  | 23,51 |
| Thesaurierende Klasse USD I4                           | 27.03.2024 | IE00099KUC84 | -       | -      | 14,90 |
| Thesaurierende Klasse USD M                            | 27.04.2018 | IE00BFMHRT13 | (15,24) | 20,92  | 21,54 |

## Anhang II (Fortsetzung)

### PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

#### Global Equity Megatrends (Fortsetzung)

| Anteilklasse                | Auflegungsdatum | ISIN         | Geschäftsjahr zum 31. Dezember |           |           |
|-----------------------------|-----------------|--------------|--------------------------------|-----------|-----------|
|                             |                 |              | 2022<br>%                      | 2023<br>% | 2024<br>% |
| Thesaurierende Klasse USD U | 11.10.2024      | IE000DGWXD65 | -                              | -         | (1,60)    |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 25.02.2022      | IE00BFMHRN50 | (12,30)                        | 23,95     | 24,47     |

#### Global Flexible Credit Income

|  |            |              |         |       |      |
|--|------------|--------------|---------|-------|------|
| Thesaurierende Klasse CAD I5           | 18.03.2021 | IE00BMDQ4176 | (10,11) | 12,10 | 7,93 |
| Thesaurierende Klasse EUR I            | 29.09.2020 | IE00BKPV7063 | (11,99) | 10,01 | 6,57 |
| Thesaurierende Klasse EUR M            | 13.08.2020 | IE00BKPV6Z45 | (13,31) | 8,65  | 5,07 |
| Thesaurierende Klasse GBP I5           | 01.06.2020 | IE00BMD7Z951 | (10,34) | 12,11 | 8,42 |
| Ausschüttende Klasse GBP P             | 15.08.2024 | IE000TGW0FC7 | -       | -     | 2,00 |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 05.02.2024 | IE00BLB2GL40 | -       | -     | 7,51 |
| Thesaurierende Klasse USD A            | 16.09.2020 | IE00BKPV6V07 | (10,48) | 11,81 | 7,81 |
| Thesaurierende Klasse USD I            | 01.06.2020 | IE00BMD7Z621 | (9,91)  | 12,52 | 8,43 |
| Ausschüttende Klasse USD I             | 01.06.2020 | IE00BMD7Z738 | (9,89)  | 12,43 | 8,53 |
| Thesaurierende Klasse USD M            | 16.09.2020 | IE00BKPV6Y38 | (11,15) | 10,88 | 6,98 |
| Thesaurierende Klasse USD U            | 09.10.2024 | IE000H552715 | -       | -     | 0,60 |
| Thesaurierende Klasse USD Z            | 01.06.2020 | IE00BMD7Z845 | (9,40)  | 13,18 | 9,08 |

#### Global High Yield Engagement

|                                  |            |               |         |       |      |
|----------------------------------|------------|---------------|---------|-------|------|
| Ausschüttende Klasse AUD I       | 03.05.2022 | IE00BLRPMZ33  | (5,65)  | 8,54  | 7,30 |
| Thesaurierende Klasse AUD I4     | 12.02.2024 | IE000RAQS8J1  | -       | -     | 7,10 |
| Thesaurierende Klasse CHF I4     | 03.05.2022 | IE000NWK9054  | (4,70)  | 6,09  | 4,45 |
| Ausschüttende Klasse CHF I4      | 03.05.2022 | IE000FKA7HA8  | (4,70)  | 6,10  | 4,34 |
| Thesaurierende Klasse CHF X      | 03.05.2022 | IE000UJH5394  | (5,10)  | 5,37  | 3,60 |
| Thesaurierende Klasse EUR I4     | 03.05.2022 | IE000FQ3GMZ6  | (4,90)  | 8,20  | 7,00 |
| Ausschüttende Klasse EUR I4      | 03.05.2022 | IE000R3WKJZ3  | (4,87)  | 8,10  | 7,04 |
| Thesaurierende Klasse EUR X      | 03.05.2022 | IE000BDJ74G5  | (5,40)  | 7,40  | 6,20 |
| Thesaurierende Klasse EUR Z (PF) | 04.08.2016 | IE00BD0PCC14  | (12,82) | 8,43  | 7,34 |
| Thesaurierende Klasse GBP I4     | 03.05.2022 | IE000HVII8Q5  | (3,70)  | 9,97  | 8,50 |
| Thesaurierende Klasse GBP X      | 03.05.2022 | IE000OOR7613  | (4,10)  | 9,07  | 7,74 |
| Thesaurierende Klasse USD A      | 16.08.2016 | IE00BZ090126  | (11,66) | 9,65  | 7,92 |
| Thesaurierende Klasse USD I      | 04.08.2016 | IE00BYMMW5M88 | (11,16) | 10,29 | 8,56 |
| Thesaurierende Klasse USD I4     | 03.05.2022 | IE0003AEEC94  | (3,00)  | 10,62 | 8,76 |
| Ausschüttende Klasse USD M       | 29.01.2018 | IE00BDFBKM06  | (12,19) | 8,93  | 7,41 |
| Thesaurierende Klasse USD X      | 10.11.2020 | IE00BNC27034  | (11,43) | 9,76  | 8,03 |
| Thesaurierende Klasse USD Z      | 04.08.2016 | IE00BD0PC768  | (10,66) | 11,04 | 9,21 |

#### Global High Yield Sustainable Action\*

|                             |            |              |         |   |   |
|-----------------------------|------------|--------------|---------|---|---|
| Thesaurierende Klasse USD I | 21.01.2020 | IE00BL3NDN61 | (11,49) | - | - |
| Ausschüttende Klasse USD I  | 21.01.2020 | IE00BL3NDP85 | (11,52) | - | - |
| Thesaurierende Klasse USD X | 10.11.2020 | IE00BNC27141 | (11,20) | - | - |
| Thesaurierende Klasse USD Y | 25.02.2021 | IE00BMDQ4283 | (11,19) | - | - |

\* Das Portfolio wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.

## Anhang II (Fortsetzung)

## PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

## Global Investment Grade Credit

| Anteilklasse                | Auflegungsdatum | ISIN         | Geschäftsjahr zum 31. Dezember |      |        |
|-----------------------------|-----------------|--------------|--------------------------------|------|--------|
|                             |                 |              | 2022                           | 2023 | 2024   |
|                             |                 |              | %                              | %    | %      |
| Thesaurierende Klasse EUR I | 27.07.2023      | IE000CEVL7G2 | -                              | 5,10 | 2,76   |
| Ausschüttende Klasse GBP P  | 25.07.2024      | IE000ILVIE21 | -                              | -    | 2,45   |
| Ausschüttende Klasse GBP X  | 06.09.2024      | IE000NE6RP84 | -                              | -    | (0,83) |
| Thesaurierende Klasse USD I | 01.09.2021      | IE00BN6JC279 | (14,57)                        | 9,60 | 4,54   |
| Thesaurierende Klasse USD X | 01.09.2021      | IE00BN6JC386 | (14,37)                        | 9,81 | 4,84   |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 01.09.2021      | IE00BN6JC493 | (14,36)                        | 9,92 | 4,94   |

## Global Opportunistic Bond

|                              |            |              |         |       |      |
|------------------------------|------------|--------------|---------|-------|------|
| Thesaurierende Klasse EUR I  | 27.11.2020 | IE00BNDQ3Y07 | (13,49) | 11,01 | 0,83 |
| Thesaurierende Klasse GBP P  | 16.01.2020 | IE00BJXCZR70 | (12,09) | 5,59  | 2,44 |
| Thesaurierende Klasse USD A  | 22.09.2017 | IE00BD3WF316 | (11,82) | 5,97  | 2,40 |
| Thesaurierende Klasse USD I  | 20.12.2016 | IE00BD3WD824 | (11,44) | 6,23  | 2,59 |
| Ausschüttende Klasse USD I   | 20.12.2016 | IE00BD3WD931 | (11,52) | 6,30  | 2,60 |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 23.04.2018 | IE00BFOV1595 | (11,42) | 6,30  | 2,64 |
| Ausschüttende Klasse USD I2  | 24.10.2024 | IE000OZB6C31 | -       | -     | 0,10 |
| Thesaurierende Klasse USD Z  | 16.05.2019 | IE00BD3WDB53 | (11,23) | 6,57  | 2,99 |

## Global Real Estate Securities\*\*

|   |            |              |         |      |   |
|---|------------|--------------|---------|------|---|
| Ausschüttende Klasse EUR I5                           | 08.07.2021 | IE00068K7L50 | (27,80) | -    | - |
| Thesaurierende Klasse EUR M                           | 29.01.2016 | IE00BYNBZJ17 | (29,30) | 3,04 | - |
| Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert) | 04.11.2020 | IE00BLP47350 | (20,04) | 4,80 | - |
| Thesaurierende Klasse GBP Z                           | 17.03.2016 | IE00BSPPW214 | (26,55) | 7,39 | - |
| Thesaurierende Klasse USD A                           | 09.05.2019 | IE00BSPPW651 | (26,09) | 6,92 | - |
| Thesaurierende Klasse USD CI                          | 08.01.2020 | IE00BF47NP78 | (26,79) | 5,82 | - |
| Thesaurierende Klasse USD I                           | 30.12.2014 | IE00BSPPW875 | (25,56) | 7,65 | - |
| Ausschüttende Klasse USD I5                           | 20.12.2019 | IE00BL4KJW74 | (25,27) | 8,14 | - |
| Thesaurierende Klasse USD M                           | 02.10.2019 | IE00BF47NQ85 | (26,85) | 5,78 | - |
| Thesaurierende Klasse USD Z                           | 13.02.2015 | IE00BSPPWG54 | (24,96) | 8,43 | - |

\*\* Das Portfolio wurde am 31. Dezember 2024 aufgelöst.

## Global Sustainable Equity

|  |            |              |         |       |       |
|--|------------|--------------|---------|-------|-------|
| Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert) | 24.02.2021 | IE00BL5BFR67 | (23,37) | 19,90 | 15,11 |
| Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)  | 24.02.2021 | IE00BMG4Q566 | (24,92) | 17,47 | 12,86 |
| Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert)  | 31.03.2021 | IE00BKP80536 | (23,11) | 20,21 | 15,44 |
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)  | 06.04.2021 | IE00BMG4Q459 | (19,26) | 16,65 | 9,57  |
| Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert) | 06.04.2021 | IE00BN6JBK81 | (18,99) | 17,07 | 9,84  |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 02.12.2021 | IE00BKPKM429 | (28,91) | 22,53 | 6,50  |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 24.02.2021 | IE00BMQC6Y99 | (28,39) | 23,78 | 7,69  |
| Ausschüttende Klasse USD I                             | 24.02.2021 | IE00BMQC7139 | (28,30) | 23,76 | 7,59  |

## Anhang II (Fortsetzung)

### PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

#### Global Sustainable Equity (Fortsetzung)

| Anteilklasse                | Auflegungsdatum | ISIN         | Geschäftsjahr zum 31. Dezember |           |           |
|-----------------------------|-----------------|--------------|--------------------------------|-----------|-----------|
|                             |                 |              | 2022<br>%                      | 2023<br>% | 2024<br>% |
| Thesaurierende Klasse USD M | 15.03.2021      | IE00BKPKM312 | (29,42)                        | 21,55     | 5,78      |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 25.02.2022      | IE000BASSUZ5 | (16,80)                        | 24,40     | 8,31      |

#### Global Value

|  |            |              |         |       |       |
|--|------------|--------------|---------|-------|-------|
| Thesaurierende Klasse EUR M                            | 29.01.2016 | IE00BYNBZH92 | (16,84) | 12,41 | 6,66  |
| Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert) | 27.09.2022 | IE0007DELM88 | 0,80    | 10,32 | 12,23 |
| Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)  | 20.10.2023 | IE00BDB16154 | -       | 7,00  | 12,06 |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 14.08.2017 | IE00BSNM7G36 | (13,31) | 16,17 | 9,46  |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 18.12.2014 | IE00BSNM7J66 | (12,92) | 16,70 | 9,95  |
| Thesaurierende Klasse USD I3                           | 31.05.2022 | IE0006B0IPZ0 | (5,30)  | 16,79 | -     |
| Thesaurierende Klasse USD Z                            | 24.05.2016 | IE00BSNM7Q34 | (12,53) | 17,25 | 10,43 |

#### High Yield Bond

|  |            |              |         |       |      |
|--|------------|--------------|---------|-------|------|
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)   | 05.09.2012 | IE00B7VR8263 | (13,52) | 8,87  | 6,15 |
| Thesaurierende Klasse AUD A              | 28.08.2012 | IE00B5NTQ667 | (13,50) | 8,85  | 6,13 |
| Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich)   | 22.07.2013 | IE00B9276P83 | (14,90) | 7,27  | 4,38 |
| Thesaurierende Klasse AUD B              | 10.12.2020 | IE00B8HXFL36 | (14,94) | 7,12  | 4,50 |
| Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich)  | 19.07.2013 | IE00B9276Q90 | (14,87) | 7,27  | -    |
| Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)   | 02.07.2014 | IE00BNJZT320 | (14,86) | 7,06  | 4,64 |
| Thesaurierende Klasse AUD E              | 02.07.2014 | IE00BNJZT213 | (14,90) | 7,13  | 4,47 |
| Ausschüttende Klasse AUD I               | 29.12.2011 | IE00B52MT459 | (13,01) | 9,56  | 6,88 |
| Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)   | 27.06.2013 | IE00B9276R08 | (14,09) | 8,27  | 5,66 |
| Ausschüttende Klasse AUD T (Wöchentlich) | 11.06.2013 | IE00B95QHL52 | (14,08) | 8,16  | 5,61 |
| Thesaurierende Klasse AUD T              | 02.08.2013 | IE00B8HXFR97 | (13,96) | 8,20  | 5,55 |
| Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich)   | 23.07.2013 | IE00B8HXG658 | (12,76) | 9,80  | 6,57 |
| Thesaurierende Klasse CHF A              | 05.07.2011 | IE00B5YDJD53 | (14,78) | 6,19  | 2,96 |
| Thesaurierende Klasse CHF I              | 27.05.2011 | IE00B53JGK04 | (14,25) | 6,87  | 3,52 |
| Thesaurierende Klasse CHF I2             | 22.10.2013 | IE00BCDYX925 | (14,18) | 6,97  | 3,66 |
| Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)   | 01.08.2012 | IE00B7YPR088 | (11,77) | 7,57  | 4,74 |
| Ausschüttende Klasse CNY I (Monatlich)   | 09.11.2012 | IE00B841H259 | (11,23) | 8,22  | 5,38 |
| Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)   | 19.06.2012 | IE00B4024J04 | (14,81) | 8,22  | 5,58 |
| Thesaurierende Klasse EUR A              | 03.05.2006 | IE00B12VWB25 | (14,76) | 8,25  | 5,57 |
| Ausschüttende Klasse EUR A               | 24.02.2012 | IE00B718SL89 | (14,73) | 8,25  | 5,55 |
| Thesaurierende Klasse EUR I              | 09.11.2009 | IE00B12VW904 | (14,30) | 8,96  | 6,19 |
| Ausschüttende Klasse EUR I               | 18.10.2012 | IE00B8FFFY43 | (14,32) | 9,01  | 6,18 |
| Thesaurierende Klasse EUR I2             | 05.12.2012 | IE00B86LQM64 | (14,18) | 9,00  | 6,34 |
| Ausschüttende Klasse EUR I2              | 05.12.2012 | IE00B6TSGI97 | (14,23) | 9,00  | 6,44 |
| Thesaurierende Klasse EUR M              | 29.01.2016 | IE00BSS7G446 | (15,29) | 7,63  | 4,93 |
| Thesaurierende Klasse EUR Z              | 05.11.2014 | IE00BKJ95L31 | (13,73) | 9,48  | 6,89 |
| Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich)   | 07.07.2014 | IE00BCDYX818 | (13,21) | 10,12 | 6,94 |
| Thesaurierende Klasse GBP A              | 27.04.2011 | IE00B1G9WD45 | (13,18) | 9,99  | 7,11 |

## Anhang II (Fortsetzung)

## PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

## High Yield Bond (Fortsetzung)

| Anteilklasse   | Auflegungsdatum | ISIN         | Geschäftsjahr zum 31. Dezember |           |           |
|--|-----------------|--------------|--------------------------------|-----------|-----------|
|  |                 |              | 2022<br>%                      | 2023<br>% | 2024<br>% |
| Ausschüttende Klasse GBP A                                       | 24.02.2012      | IE00B1G9WG75 | (13,27)                        | 9,98      | 7,11      |
| Thesaurierende Klasse GBP I                                      | 27.07.2010      | IE00B1G9WC38 | (12,69)                        | 10,69     | 7,69      |
| Ausschüttende Klasse GBP I                                       | 08.11.2006      | IE00B1G9WJ07 | (12,72)                        | 10,56     | 7,74      |
| Thesaurierende Klasse GBP I2                                     | 05.12.2012      | IE00B76HSR65 | (12,60)                        | 10,81     | 7,80      |
| Ausschüttende Klasse GBP I2                                      | 05.12.2012      | IE00B8KDTL88 | (12,59)                        | 10,66     | 7,92      |
| Thesaurierende Klasse GBP Z                                      | 17.03.2016      | IE00BKJ95N54 | (12,10)                        | 11,28     | 8,27      |
| Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)                           | 14.09.2012      | IE00B87ZP976 | (12,84)                        | 9,62      | 6,38      |
| Ausschüttende Klasse JPY A (Monatlich) (nicht währungsgesichert) | 20.08.2024      | IE000OPIT9E5 | -                              | -         | 10,05     |
| Thesaurierende Klasse SEK A                                      | 16.06.2011      | IE00B5N0GF80 | (14,24)                        | 8,31      | 5,37      |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)                           | 30.03.2012      | IE00B513D147 | (12,73)                        | 9,09      | 5,53      |
| Thesaurierende Klasse SGD A                                      | 09.03.2012      | IE00B3VJ3Q31 | (12,74)                        | 9,14      | 5,52      |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)                           | 02.05.2012      | IE00B4KRFX62 | (12,45)                        | 10,74     | 7,47      |
| Ausschüttende Klasse USD A (Wöchentlich)                         | 22.01.2013      | IE00B88XV589 | (12,35)                        | 10,65     | 7,50      |
| Thesaurierende Klasse USD A                                      | 11.01.2010      | IE00B12VW672 | (12,40)                        | 10,72     | 7,42      |
| Ausschüttende Klasse USD A                                       | 24.02.2012      | IE00B1G9WM36 | (12,37)                        | 10,72     | 7,41      |
| Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich)                           | 31.10.2012      | IE00B9276S15 | (13,86)                        | 9,04      | 5,67      |
| Thesaurierende Klasse USD B                                      | 31.10.2012      | IE00B9276M52 | (13,72)                        | 8,92      | 5,65      |
| Thesaurierende Klasse USD C                                      | 21.11.2012      | IE00B8JXNK68 | (12,91)                        | 10,02     | 6,78      |
| Thesaurierende Klasse USD C1                                     | 25.10.2017      | IE00B8521692 | (13,29)                        | 9,64      | 6,30      |
| Ausschüttende Klasse USD C1                                      | 07.09.2017      | IE00BF2DC164 | (13,20)                        | 9,55      | 6,34      |
| Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich)                          | 31.10.2012      | IE00B9276T22 | (13,86)                        | 8,84      | -         |
| Thesaurierende Klasse USD C2                                     | 31.10.2012      | IE00B9276N69 | (13,78)                        | 8,91      | -         |
| Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)                           | 02.07.2014      | IE00BLDYHX78 | (13,73)                        | 9,02      | 5,53      |
| Thesaurierende Klasse USD E                                      | 02.07.2014      | IE00BNJZWJ94 | (13,80)                        | 8,97      | 5,61      |
| Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)                           | 13.09.2012      | IE00B6VF0729 | (11,86)                        | 11,37     | 8,12      |
| Thesaurierende Klasse USD I                                      | 03.05.2006      | IE00B12VW565 | (11,84)                        | 11,36     | 8,02      |
| Ausschüttende Klasse USD I                                       | 16.11.2006      | IE00B1G9WK12 | (11,90)                        | 11,36     | 8,01      |
| Ausschüttende Klasse USD I2 (Monatlich)                          | 24.09.2015      | IE00BH2RDM00 | (11,82)                        | 11,49     | 8,09      |
| Thesaurierende Klasse USD I2                                     | 05.12.2012      | IE00B8QBJF01 | (11,74)                        | 11,46     | 8,09      |
| Ausschüttende Klasse USD I2                                      | 05.12.2012      | IE00B8BBXZ30 | (11,79)                        | 11,55     | 8,09      |
| Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich)                          | 01.06.2016      | IE00BYX24752 | (11,71)                        | 11,63     | 8,32      |
| Thesaurierende Klasse USD M                                      | 18.02.2016      | IE00BD9WHR30 | (12,93)                        | 10,07     | 6,75      |
| Ausschüttende Klasse USD M                                       | 01.03.2018      | IE00BDFBKN13 | (12,84)                        | 10,05     | 6,76      |
| Thesaurierende Klasse USD P                                      | 09.01.2018      | IE00BTKH9V70 | (11,82)                        | 11,43     | 8,16      |
| Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)                           | 31.10.2012      | IE00B9276V44 | (12,92)                        | 9,99      | 6,76      |
| Ausschüttende Klasse USD T (Wöchentlich)                         | 11.06.2013      | IE00B8B5Y742 | (12,83)                        | 9,91      | 6,87      |
| Thesaurierende Klasse USD T                                      | 31.10.2012      | IE00B9276L46 | (12,90)                        | 10,07     | 6,73      |
| Ausschüttende Klasse USD U (Monatlich)                           | 02.05.2013      | IE00B7Y5Q239 | (12,17)                        | 10,97     | 7,75      |
| Thesaurierende Klasse USD U                                      | 09.10.2012      | IE00B84LT637 | (12,16)                        | 11,04     | 7,70      |
| Thesaurierende Klasse USD Z                                      | 02.05.2014      | IE00BKJ9LT35 | (11,29)                        | 12,02     | 8,68      |
| Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)                           | 11.06.2013      | IE00BBGB0S16 | (10,73)                        | 11,90     | 8,69      |

## Anhang II (Fortsetzung)

### PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

#### High Yield Bond (Fortsetzung)

| Anteilklasse                            | Auflegungsdatum | ISIN         | Geschäftsjahr zum 31. Dezember |           |           |
|---|-----------------|--------------|--------------------------------|-----------|-----------|
|   |                 |              | 2022<br>%                      | 2023<br>% | 2024<br>% |
| Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich) | 11.06.2013      | IE00BBGB0T23 | (10,72)                        | 11,90     | -         |
| Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)  | 02.07.2014      | IE00BLDYHZ92 | (10,73)                        | 11,90     | 8,71      |
| Thesaurierende Klasse ZAR E             | 02.07.2014      | IE00BNJZT544 | (10,73)                        | 11,90     | 8,71      |
| Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)  | 11.06.2013      | IE00BBGB0V45 | (9,83)                         | 13,02     | 9,81      |
| Thesaurierende Klasse ZAR T             | 19.12.2016      | IE00BCDYXM56 | (9,83)                         | 13,03     | 9,80      |

#### InnovAsia

|   |            |              |         |       |       |
|---|------------|--------------|---------|-------|-------|
| Thesaurierende Klasse CHF I4                          | 14.07.2021 | IE000R62XXS0 | (41,16) | 26,76 | 6,17  |
| Thesaurierende Klasse EUR A                           | 14.07.2021 | IE00051SPWY7 | (41,59) | 27,69 | 7,19  |
| Thesaurierende Klasse EUR I4                          | 14.07.2021 | IE0001S98TH9 | (40,99) | 29,28 | 8,55  |
| Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) | 18.10.2021 | IE0005LXGGN3 | (36,52) | 25,33 | 15,58 |
| Thesaurierende Klasse EUR X                           | 14.07.2021 | IE000GVZECQ2 | (41,55) | 28,12 | 7,52  |
| Thesaurierende Klasse SGD A                           | 14.07.2021 | IE0004VBKI06 | (40,37) | 28,60 | 7,13  |
| Thesaurierende Klasse SGD I4                          | 14.07.2021 | IE000FO9NFS0 | (39,67) | 30,15 | 8,44  |
| Thesaurierende Klasse SGD X                           | 14.07.2021 | IE0004JUGJ61 | (40,22) | 28,88 | 7,45  |
| Thesaurierende Klasse USD A                           | 14.07.2021 | IE00049QBO88 | (39,91) | 30,84 | 9,10  |
| Thesaurierende Klasse USD I                           | 14.07.2021 | IE000J2D2XC9 | (39,36) | 31,93 | 9,93  |
| Thesaurierende Klasse USD I4                          | 14.07.2021 | IE0002MSVLE6 | (39,20) | 32,38 | 10,42 |
| Thesaurierende Klasse USD M                           | 05.11.2021 | IE0005QTSW89 | (40,44) | 29,87 | 8,36  |
| Thesaurierende Klasse USD X                           | 14.07.2021 | IE0007HVSKHO | (39,74) | 31,16 | 9,50  |

#### Japan Equity Engagement

|  |            |              |         |       |        |
|--|------------|--------------|---------|-------|--------|
| Ausschüttende Klasse EUR I5                            | 10.02.2022 | IE0000I94UW8 | (5,40)  | 28,28 | 19,17  |
| Thesaurierende Klasse GBP I5                           | 22.09.2021 | IE0000R9P9C5 | (12,96) | 26,94 | -      |
| Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert) | 06.07.2023 | IE000GH63MB3 | -       | 7,80  | 5,47   |
| Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)  | 11.11.2021 | IE0002CL69U2 | (15,97) | 6,34  | 5,01   |
| Thesaurierende Klasse JPY A                            | 21.05.2024 | IE00064ZAH2  | -       | -     | 7,49   |
| Thesaurierende Klasse JPY I                            | 12.05.2020 | IE00BLLXGR37 | (14,18) | 20,17 | 14,93  |
| Ausschüttende Klasse JPY I                             | 12.05.2020 | IE00BLLXGS44 | (14,18) | 20,17 | 14,85  |
| Thesaurierende Klasse JPY I5                           | 16.02.2021 | IE00BL5B4J15 | (13,81) | 20,68 | 15,42  |
| Thesaurierende Klasse JPY Z                            | 28.04.2021 | IE00BMD0C484 | (13,44) | 21,19 | 15,91  |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 21.05.2024 | IE000JRHSGW1 | -       | -     | 10,30  |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 08.02.2024 | IE000VOOKJG3 | -       | -     | 14,00  |
| Thesaurierende Klasse USD I5 (nicht währungsgesichert) | 12.09.2024 | IE000UHCWRZ2 | -       | -     | (2,80) |
| Thesaurierende Klasse USD X (nicht währungsgesichert)  | 03.12.2024 | IE000860XCQ1 | -       | -     | (5,10) |

#### Macro Opportunities FX\*

|                             |            |              |        |      |   |
|-----------------------------|------------|--------------|--------|------|---|
| Thesaurierende Klasse EUR I | 04.12.2019 | IE00BK70Z635 | (2,53) | 3,25 | - |
| Thesaurierende Klasse GBP Z | 04.12.2019 | IE00BG0WMX45 | (0,21) | 5,56 | - |
| Thesaurierende Klasse SEK I | 11.12.2019 | IE00BK70Z742 | (1,94) | 3,50 | - |
| Ausschüttende Klasse SEK I  | 20.10.2021 | IE00BL1GVW28 | (1,83) | 3,49 | - |

## Anhang II (Fortsetzung)

## PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

## Macro Opportunities FX\* (Fortsetzung)

| Anteilklasse                | Auflegungsdatum | ISIN         | Geschäftsjahr zum 31. Dezember |           |           |
|-----------------------------|-----------------|--------------|--------------------------------|-----------|-----------|
|                             |                 |              | 2022<br>%                      | 2023<br>% | 2024<br>% |
| Thesaurierende Klasse USD I | 04.12.2019      | IE00BK70Z528 | (0,51)                         | 5,69      | -         |
| Thesaurierende Klasse USD Z | 04.12.2019      | IE00BK70Z411 | -                              | 6,30      | -         |

\* Das Portfolio wurde am 8. Februar 2024 aufgelöst.

## Multi-Asset Income\*

|                              |            |              |         |   |   |
|------------------------------|------------|--------------|---------|---|---|
| Ausschüttende Klasse GBP P   | 27.02.2020 | IE00BKKJBN69 | (12,68) | - | - |
| Thesaurierende Klasse USD A  | 28.02.2018 | IE00BYW7V037 | (12,47) | - | - |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 01.03.2018 | IE00BF47NK24 | (13,25) | - | - |
| Thesaurierende Klasse USD I  | 28.12.2016 | IE00BYX4Q314 | (11,86) | - | - |
| Ausschüttende Klasse USD I   | 28.12.2016 | IE00BYX4Q421 | (11,76) | - | - |
| Thesaurierende Klasse USD M  | 09.08.2017 | IE00BYMJ8K84 | (13,15) | - | - |

\* Das Portfolio wurde am 6. Juli 2023 aufgelöst.

## Next Generation Connectivity

|   |            |              |         |       |       |
|---|------------|--------------|---------|-------|-------|
| Thesaurierende Klasse AUD A                           | 20.05.2020 | IE00BMPRXT94 | (45,90) | 34,96 | 31,38 |
| Thesaurierende Klasse AUD E                           | 16.02.2024 | IE0008GW0LH0 | -       | -     | 16,50 |
| Thesaurierende Klasse AUD I2                          | 13.09.2023 | IE0002QWGC08 | -       | 13,20 | 32,77 |
| Thesaurierende Klasse CHF A                           | 01.08.2023 | IE00BMY47772 | -       | 6,20  | 28,63 |
| Thesaurierende Klasse CHF I                           | 01.08.2023 | IE00BMY47665 | -       | 6,50  | 29,86 |
| Thesaurierende Klasse CHF I2                          | 13.09.2023 | IE0003BXK5E5 | -       | 13,70 | 30,08 |
| Thesaurierende Klasse CNY A                           | 01.02.2021 | IE00BN13NY36 | (43,77) | 34,20 | 30,58 |
| Thesaurierende Klasse CNY I2                          | 13.09.2023 | IE000VZM9Z74 | -       | 13,42 | 31,93 |
| Thesaurierende Klasse EUR A                           | 13.05.2020 | IE00BMPRXP56 | (45,94) | 34,86 | 31,37 |
| Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert) | 22.04.2020 | IE00BMD7ZB71 | (39,94) | 33,62 | 42,55 |
| Thesaurierende Klasse EUR I                           | 30.06.2020 | IE00BMPRXW24 | (45,41) | 35,83 | 32,48 |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) | 12.06.2020 | IE00BLLXGX96 | (39,41) | 34,74 | 43,82 |
| Thesaurierende Klasse EUR I2                          | 13.09.2023 | IE00049FOE96 | -       | 13,20 | 32,77 |
| Thesaurierende Klasse EUR I5                          | 01.09.2020 | IE00BMPRXV17 | (45,20) | 36,44 | 33,12 |
| Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) | 22.04.2020 | IE00BLLXH031 | (40,38) | 32,49 | 41,45 |
| Thesaurierende Klasse GBP A                           | 15.05.2020 | IE00BMPRXS87 | (45,24) | 36,92 | 32,84 |
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | 02.11.2020 | IE00BKS9L945 | (35,98) | 31,63 | 37,26 |
| Thesaurierende Klasse GBP I2                          | 13.09.2023 | IE000MHA92L4 | -       | 13,70 | 34,21 |
| Thesaurierende Klasse HKD A                           | 13.05.2020 | IE00BMPRXQ63 | (43,95) | 36,82 | 32,48 |
| Thesaurierende Klasse HKD I2                          | 13.09.2023 | IE000ZWJU5Z2 | -       | 13,90 | 33,80 |
| Thesaurierende Klasse SGD A                           | 14.05.2020 | IE00BMPRXR70 | (44,38) | 35,90 | 31,23 |
| Thesaurierende Klasse SGD I2                          | 13.09.2023 | IE000V6EVRT1 | -       | 13,35 | 32,55 |
| Thesaurierende Klasse USD A                           | 04.05.2020 | IE00BMPRXN33 | (43,60) | 38,16 | 33,73 |
| Thesaurierende Klasse USD E                           | 01.02.2023 | IE000ZUB0R86 | -       | 19,20 | 32,30 |
| Thesaurierende Klasse USD I                           | 08.04.2020 | IE00BLLXGV72 | (43,15) | 39,43 | 34,80 |

## Anhang II (Fortsetzung)

### PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

#### Next Generation Connectivity (Fortsetzung)

| Anteilklasse                 | Auflegungsdatum | ISIN         | Geschäftsjahr zum 31. Dezember |           |           |
|------------------------------|-----------------|--------------|--------------------------------|-----------|-----------|
|                              |                 |              | 2022<br>%                      | 2023<br>% | 2024<br>% |
| Ausschüttende Klasse USD I   | 08.04.2020      | IE00BLLXGW89 | (43,11)                        | 39,43     | 34,80     |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 10.03.2021      | IE00BLR75G15 | (42,99)                        | 39,62     | 35,01     |
| Thesaurierende Klasse USD I3 | 06.11.2020      | IE00BNC26Z17 | (43,02)                        | 39,85     | 35,16     |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 07.05.2020      | IE00BLLXGY04 | (42,92)                        | 40,02     | 35,43     |
| Thesaurierende Klasse USD M  | 02.06.2020      | IE00BMCTKC00 | (44,05)                        | 37,06     | 32,67     |
| Thesaurierende Klasse USD Z  | 19.03.2021      | IE00BMG4Q780 | (42,65)                        | 40,71     | 35,99     |
| Thesaurierende Klasse ZAR A  | 14.02.2023      | IE0009UHWAU4 | -                              | 25,63     | 36,80     |
| Thesaurierende Klasse ZAR E  | 10.02.2023      | IE000CS9U7B7 | -                              | 26,25     | 35,30     |

#### Next Generation Mobility

|   |            |              |         |       |        |
|---|------------|--------------|---------|-------|--------|
| Thesaurierende Klasse EUR A                           | 07.09.2018 | IE00BD6J9V56 | (29,83) | 25,13 | (4,26) |
| Thesaurierende Klasse EUR I                           | 13.01.2021 | IE00BN6HJT78 | (29,22) | 26,19 | (3,38) |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) | 24.06.2020 | IE00BKPHW879 | (21,37) | 25,09 | 4,94   |
| Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) | 26.10.2018 | IE00BD6JB422 | (22,68) | 23,03 | 3,26   |
| Thesaurierende Klasse USD A                           | 11.09.2018 | IE00BD6J9T35 | (26,86) | 28,40 | (2,44) |
| Thesaurierende Klasse USD C1                          | 21.05.2019 | IE00BHR06368 | (27,53) | 27,05 | (3,39) |
| Thesaurierende Klasse USD I                           | 21.08.2018 | IE00BFY81J05 | (26,22) | 29,43 | (1,63) |
| Ausschüttende Klasse USD I                            | 21.08.2018 | IE00BFLTYG40 | (26,20) | 29,46 | (1,63) |
| Thesaurierende Klasse USD M                           | 21.05.2019 | IE00BHR06475 | (27,44) | 27,44 | (3,25) |
| Thesaurierende Klasse USD X                           | 23.01.2019 | IE00BGQVSN72 | (26,74) | 28,55 | (2,31) |

#### Next Generation Space Economy

|  |            |              |        |       |       |
|--|------------|--------------|--------|-------|-------|
| Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)  | 30.10.2024 | IE00018YKVNO | -      | -     | 9,40  |
| Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert) | 10.05.2022 | IE000KBH8HE5 | (4,90) | 23,24 | 34,56 |
| Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)  | 10.05.2022 | IE000RHGM613 | (6,10) | 20,98 | 31,95 |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 30.10.2024 | IE0000XYD857 | -      | -     | 4,30  |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 10.05.2022 | IE000PK18K22 | (3,90) | 27,26 | 25,76 |

#### Short Duration Emerging Market Debt

|  |            |               |        |      |      |
|--|------------|---------------|--------|------|------|
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | 31.08.2016 | IE00BMN93860  | (8,23) | 6,06 | 7,26 |
| Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich) | 06.11.2015 | IE00BMN93G40  | (7,71) | 6,84 | 7,42 |
| Thesaurierende Klasse CHF A            | 06.06.2014 | IE00BDZRWQ63  | (9,78) | 3,36 | 3,98 |
| Ausschüttende Klasse CHF A             | 06.06.2014 | IE00BDZRWR70  | (9,73) | 3,32 | 3,92 |
| Thesaurierende Klasse CHF I            | 06.06.2014 | IE00BDZRWS87  | (9,31) | 3,84 | 4,50 |
| Ausschüttende Klasse CHF I             | 13.06.2014 | IE00BDZRWT94  | (9,35) | 3,84 | 4,55 |
| Thesaurierende Klasse CHF I2           | 20.02.2015 | IE00BDZRWW17  | (9,23) | 3,96 | 4,50 |
| Ausschüttende Klasse CHF I2            | 18.04.2017 | IE00BNJZW449  | (9,17) | 3,94 | 4,48 |
| Thesaurierende Klasse CHF I5           | 31.03.2014 | IE00BDZRWX31  | (9,16) | 4,19 | 4,69 |
| Thesaurierende Klasse CHF P            | 25.04.2017 | IE00BVJFOP79  | (9,25) | 3,86 | 4,44 |
| Thesaurierende Klasse EUR A            | 13.06.2014 | IE00BDZRWZ54  | (9,48) | 5,34 | 6,56 |
| Ausschüttende Klasse EUR A             | 06.06.2014 | IE00BDZRXX078 | (9,51) | 5,35 | 6,49 |

## Anhang II (Fortsetzung)

## PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

## Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum 31. Dezember

| Anteilklasse                           | Auflegungsdatum | ISIN         | Geschäftsjahr zum 31. Dezember |           |           |
|--|-----------------|--------------|--------------------------------|-----------|-----------|
|  |                 |              | 2022<br>%                      | 2023<br>% | 2024<br>% |
| Thesaurierende Klasse EUR I            | 06.06.2014      | IE00BDZRX185 | (9,02)                         | 5,81      | 7,10      |
| Ausschüttende Klasse EUR I             | 06.06.2014      | IE00BDZRX292 | (8,91)                         | 5,72      | 7,16      |
| Thesaurierende Klasse EUR I2           | 23.06.2014      | IE00BDZRX300 | (8,96)                         | 5,86      | 7,23      |
| Ausschüttende Klasse EUR I2            | 30.03.2017      | IE00BDZRX417 | (8,89)                         | 5,82      | 7,29      |
| Thesaurierende Klasse EUR I5           | 14.03.2014      | IE00BDZRX524 | (8,83)                         | 6,14      | 7,32      |
| Thesaurierende Klasse EUR M            | 29.01.2016      | IE00BWB95M67 | (9,94)                         | 4,61      | 5,94      |
| Ausschüttende Klasse EUR M             | 29.01.2016      | IE00BWB93N35 | (9,94)                         | 4,56      | 5,97      |
| Thesaurierende Klasse EUR P            | 23.02.2017      | IE00BYXJQV46 | (9,04)                         | 5,86      | 7,21      |
| Thesaurierende Klasse EUR U            | 06.06.2018      | IE00BNJZW555 | (9,19)                         | 5,48      | 6,89      |
| Ausschüttende Klasse EUR X             | 16.03.2020      | IE00BL6THB70 | (8,92)                         | 5,92      | -         |
| Thesaurierende Klasse GBP A            | 22.11.2016      | IE00BDZRX748 | (8,00)                         | 6,90      | 8,14      |
| Thesaurierende Klasse GBP I            | 16.12.2016      | IE00BDZRX961 | (7,54)                         | 7,38      | 8,68      |
| Ausschüttende Klasse GBP I             | 20.02.2018      | IE00BDZRXB85 | (7,54)                         | 7,43      | 8,66      |
| Thesaurierende Klasse GBP I2           | 30.09.2016      | IE00BDZRXC92 | (7,46)                         | 7,48      | 8,86      |
| Ausschüttende Klasse GBP I2            | 19.10.2017      | IE00BDZRXD00 | (7,43)                         | 7,47      | 8,85      |
| Ausschüttende Klasse GBP I5            | 11.04.2014      | IE00BDZRXG31 | (7,29)                         | 7,59      | 9,06      |
| Thesaurierende Klasse GBP P            | 13.08.2019      | IE00BGV7J266 | (7,46)                         | 7,45      | 8,66      |
| Thesaurierende Klasse JPY I            | 23.02.2015      | IE00BDZRXK76 | (9,09)                         | 2,10      | 2,87      |
| Ausschüttende Klasse JPY I             | 22.09.2014      | IE00BDZRXL83 | (9,09)                         | 2,10      | 2,87      |
| Thesaurierende Klasse SEK A            | 02.02.2018      | IE00BF18PM41 | (9,09)                         | 5,45      | 6,30      |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | 31.10.2014      | IE00BMN94165 | (7,66)                         | 5,98      | 6,40      |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 31.10.2014      | IE00BMN94611 | (7,54)                         | 7,45      | 8,46      |
| Thesaurierende Klasse USD A            | 06.12.2013      | IE00BDZRXR46 | (7,53)                         | 7,53      | 8,40      |
| Ausschüttende Klasse USD A             | 06.06.2014      | IE00BDZRXS52 | (7,55)                         | 7,51      | 8,50      |
| Thesaurierende Klasse USD C1           | 29.08.2017      | IE00BFH58D19 | (8,47)                         | 6,48      | 7,34      |
| Ausschüttende Klasse USD C1            | 29.08.2017      | IE00BF2DC271 | (8,45)                         | 6,46      | 7,28      |
| Thesaurierende Klasse USD I            | 31.10.2013      | IE00BDZRXT69 | (7,09)                         | 8,06      | 8,95      |
| Ausschüttende Klasse USD I             | 02.06.2016      | IE00BDZRXW98 | (7,07)                         | 8,04      | 8,96      |
| Thesaurierende Klasse USD I2           | 12.09.2014      | IE00BDZRXY13 | (6,99)                         | 8,12      | 9,11      |
| Ausschüttende Klasse USD I2            | 30.10.2015      | IE00BDZRY043 | (6,99)                         | 8,15      | 9,08      |
| Thesaurierende Klasse USD I5           | 19.03.2014      | IE00BDZRY266 | (6,84)                         | 8,35      | 9,24      |
| Ausschüttende Klasse USD I5            | 09.10.2014      | IE00BDZRY597 | (6,87)                         | 8,25      | 9,34      |
| Thesaurierende Klasse USD M            | 24.08.2017      | IE00BDFBKQ44 | (8,13)                         | 6,84      | 7,82      |
| Ausschüttende Klasse USD M             | 29.08.2017      | IE00BDFBKR50 | (8,11)                         | 6,84      | 7,73      |
| Thesaurierende Klasse USD P            | 10.08.2015      | IE00BTKH9Z19 | (7,08)                         | 8,06      | 9,00      |
| Thesaurierende Klasse USD Z            | 01.04.2014      | IE00BKKMWB06 | (6,60)                         | 8,54      | 9,53      |
| <b>Short Duration Euro Bond</b>        |                 |              |                                |           |           |
| Thesaurierende Klasse CHF P            | 30.05.2022      | IE000BN78WH6 | (2,52)                         | 4,68      | 4,70      |
| Thesaurierende Klasse CHF U            | 17.12.2019      | IE00BL1GVV11 | (5,84)                         | 4,57      | 4,58      |
| Thesaurierende Klasse EUR A            | 10.06.2021      | IE00BNG2T811 | (5,75)                         | 6,52      | 7,16      |

## Anhang II (Fortsetzung)

### PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

#### Short Duration Euro Bond (Fortsetzung)

| Anteilklasse                 | Auflegungsdatum | ISIN         | Geschäftsjahr zum 31. Dezember |           |           |
|------------------------------|-----------------|--------------|--------------------------------|-----------|-----------|
|                              |                 |              | 2022<br>%                      | 2023<br>% | 2024<br>% |
| Thesaurierende Klasse EUR I  | 31.10.2018      | IE00BFZMJT78 | (5,59)                         | 6,72      | 7,37      |
| Ausschüttende Klasse EUR I   | 31.10.2018      | IE00BFZMJS61 | (5,58)                         | 6,71      | 7,36      |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 | 27.02.2020      | IE00BKLC3S38 | (5,55)                         | 6,76      | 7,42      |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 | 06.02.2019      | IE00BHR3GK28 | (5,49)                         | 6,83      | 7,47      |
| Thesaurierende Klasse EUR M  | 29.07.2021      | IE000XRS4D49 | (6,31)                         | 6,18      | 6,95      |
| Thesaurierende Klasse EUR U  | 17.12.2019      | IE00BL1GVT98 | (5,68)                         | 6,61      | 7,26      |
| Thesaurierende Klasse EUR Z  | 20.12.2018      | IE00BH453S87 | (5,38)                         | 6,93      | 7,57      |
| Thesaurierende Klasse USD I  | 15.09.2021      | IE000WMR7CB5 | (3,62)                         | 8,93      | 9,15      |
| Thesaurierende Klasse USD Z  | 24.01.2019      | IE00BH453T94 | (3,43)                         | 9,12      | 9,37      |

#### Short Duration High Yield Engagement

|  |            |              |        |       |      |
|--|------------|--------------|--------|-------|------|
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) | 11.06.2013 | IE00B8DK4D30 | (5,86) | 7,63  | 4,71 |
| Thesaurierende Klasse CHF A            | 09.03.2012 | IE00B7FN4Q69 | (7,17) | 4,84  | 1,69 |
| Thesaurierende Klasse CHF I            | 20.12.2011 | IE00B7FN4P52 | (6,66) | 5,50  | 2,36 |
| Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) | 01.08.2012 | IE00B8474M21 | (4,07) | 6,21  | 3,43 |
| Thesaurierende Klasse EUR A            | 20.12.2011 | IE00B7FN4G61 | (6,92) | 6,91  | 4,23 |
| Ausschüttende Klasse EUR A             | 14.02.2014 | IE00B51MHK83 | (7,02) | 6,99  | 4,25 |
| Thesaurierende Klasse EUR I            | 20.12.2011 | IE00B7FN4F54 | (6,38) | 7,56  | 4,95 |
| Thesaurierende Klasse EUR I2           | 05.12.2012 | IE00B83NML60 | (6,30) | 7,71  | 4,91 |
| Thesaurierende Klasse EUR M            | 29.01.2016 | IE00BWB93P58 | (7,49) | 6,29  | 3,67 |
| Ausschüttende Klasse EUR M             | 29.01.2016 | IE00BWB93Q65 | (7,54) | 6,39  | 3,61 |
| Thesaurierende Klasse GBP I            | 17.01.2012 | IE00B7FN4H78 | (4,91) | 9,26  | 6,32 |
| Ausschüttende Klasse GBP I             | 20.12.2011 | IE00B7FN4M22 | (5,06) | 9,38  | 6,28 |
| Thesaurierende Klasse GBP I2           | 05.12.2012 | IE00B87CZ321 | (4,82) | 9,31  | 6,50 |
| Ausschüttende Klasse GBP I2            | 05.12.2012 | IE00B7NK7601 | (4,88) | 9,44  | 6,40 |
| Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) | 21.09.2022 | IE0000C39ZN4 | 0,93   | 8,25  | 5,14 |
| Thesaurierende Klasse JPY I            | 28.03.2012 | IE00B7FN4K08 | (6,41) | 3,75  | 0,84 |
| Ausschüttende Klasse JPY I             | 19.10.2022 | IE00BF0BZ353 | 1,47   | 3,78  | -    |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) | 17.01.2014 | IE00B6RMD591 | (5,08) | 7,74  | 4,18 |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 22.01.2014 | IE00B7FN5305 | (4,73) | 9,25  | 6,02 |
| Thesaurierende Klasse USD A            | 20.12.2011 | IE00B7FN4D31 | (4,79) | 9,31  | 6,07 |
| Ausschüttende Klasse USD A             | 30.11.2012 | IE00B7FN5073 | (4,83) | 9,25  | 6,07 |
| Thesaurierende Klasse USD C1           | 02.10.2017 | IE00BDFBKS67 | (5,79) | 8,19  | 4,95 |
| Thesaurierende Klasse USD I            | 20.12.2011 | IE00B7FN4C24 | (4,18) | 9,93  | 6,69 |
| Ausschüttende Klasse USD I             | 09.01.2012 | IE00B7FN4Z50 | (4,15) | 9,94  | 6,68 |
| Thesaurierende Klasse USD I2           | 05.12.2012 | IE00B8110967 | (4,17) | 10,14 | 6,79 |
| Ausschüttende Klasse USD I2            | 05.12.2012 | IE00B8K3ZX25 | (4,15) | 10,02 | 6,81 |
| Thesaurierende Klasse USD I4           | 10.05.2023 | IE00094GH437 | -      | 6,60  | 7,04 |
| Thesaurierende Klasse USD I5           | 08.09.2022 | IE000QHA8X05 | 0,40   | 10,26 | 7,05 |
| Thesaurierende Klasse USD M            | 25.08.2017 | IE00BDFBKT74 | (5,38) | 8,63  | 5,41 |

## Anhang II (Fortsetzung)

## PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

## Short Duration High Yield Engagement (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum 31. Dezember

| Anteilklasse   | Auflegungsdatum | ISIN         | Geschäftsjahr zum 31. Dezember |           |           |
|--|-----------------|--------------|--------------------------------|-----------|-----------|
|  |                 |              | 2022<br>%                      | 2023<br>% | 2024<br>% |
| Ausschüttende Klasse USD M                                       | 20.12.2017      | IE00BDFBKV96 | (5,37)                         | 8,68      | 5,42      |
| Thesaurierende Klasse USD Z                                      | 01.04.2014      | IE00BKJ9TG65 | (3,66)                         | 10,60     | 7,30      |
| <b>Strategic Income</b>  |                 |              |                                |           |           |
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)                           | 15.09.2017      | IE00BRJFZ213 | (11,58)                        | 6,42      | 3,42      |
| Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)                           | 02.04.2024      | IE0007IEZW00 | -                              | -         | (1,50)    |
| Ausschüttende Klasse AUD Z (Monatlich)                           | 01.07.2019      | IE00BH3W6Z85 | (10,76)                        | 7,55      | 4,42      |
| Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)                           | 31.05.2023      | IE00BRJFZS74 | -                              | 4,01      | 2,11      |
| Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)                           | 07.08.2017      | IE00BQR9PJ58 | (12,73)                        | 5,95      | 2,74      |
| Thesaurierende Klasse EUR A                                      | 14.11.2022      | IE0004VYIY29 | 0,50                           | 5,87      | 2,82      |
| Thesaurierende Klasse EUR I                                      | 22.01.2016      | IE00B9154717 | (12,32)                        | 6,46      | 3,25      |
| Thesaurierende Klasse EUR M                                      | 29.01.2016      | IE00BWB97642 | (13,29)                        | 5,28      | 2,12      |
| Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich)                           | 15.09.2017      | IE00BRJFZD22 | (11,37)                        | 7,61      | 4,32      |
| Ausschüttende Klasse GBP I (Monatlich)                           | 06.12.2023      | IE00BRJFZF46 | -                              | 2,30      | 4,84      |
| Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)                           | 15.09.2017      | IE00BRJFZH69 | (11,15)                        | 7,28      | 3,65      |
| Ausschüttende Klasse JPY A (Monatlich)                           | 16.02.2024      | IE000YBCW370 | -                              | -         | 0,68      |
| Ausschüttende Klasse JPY A (Monatlich) (nicht währungsgesichert) | 03.09.2024      | IE000V0C16V2 | -                              | -         | 7,79      |
| Ausschüttende Klasse JPY E (Monatlich) (nicht währungsgesichert) | 20.08.2024      | IE0005A1BSB0 | -                              | -         | 7,73      |
| Thesaurierende Klasse JPY I                                      | 26.04.2013      | IE00B9F63958 | (12,44)                        | 2,49      | (0,81)    |
| Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert)            | 26.04.2013      | IE00B9C7XK23 | 2,90                           | 16,30     | 17,23     |
| Ausschüttende Klasse JPY I CG                                    | 10.08.2015      | IE00BYZFYQ11 | (12,44)                        | 2,49      | (0,81)    |
| Ausschüttende Klasse JPY I                                       | 25.06.2014      | IE00BNCBRC28 | (12,44)                        | 2,56      | (0,80)    |
| Thesaurierende Klasse JPY Z                                      | 01.04.2022      | IE000U3RQH4  | (8,46)                         | 3,00      | (0,31)    |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)                           | 31.10.2014      | IE00BRJFZM13 | (10,99)                        | 6,79      | 2,70      |
| Thesaurierende Klasse SGD A                                      | 15.09.2017      | IE00BQSBQV90 | (10,94)                        | 6,73      | 2,72      |
| Ausschüttende Klasse SGD I (Monatlich)                           | 04.06.2018      | IE00BDFDPD26 | (10,48)                        | 7,27      | 3,24      |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)                           | 31.10.2014      | IE00B7BTH691 | (10,63)                        | 8,34      | 4,65      |
| Thesaurierende Klasse USD A                                      | 11.02.2015      | IE00B87L2R26 | (10,61)                        | 8,27      | 4,63      |
| Ausschüttende Klasse USD A                                       | 10.08.2016      | IE00BD0PCD21 | (10,62)                        | 8,24      | 4,69      |
| Thesaurierende Klasse USD C1                                     | 25.08.2017      | IE00BDFBLQ19 | (11,51)                        | 7,21      | 3,64      |
| Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)                           | 02.04.2024      | IE0009HU5YD1 | -                              | -         | (0,70)    |
| Thesaurierende Klasse USD I                                      | 26.04.2013      | IE00B8HX1V50 | (10,24)                        | 8,88      | 5,16      |
| Ausschüttende Klasse USD I                                       | 10.12.2014      | IE00B9DN9Q73 | (10,19)                        | 8,87      | 5,10      |
| Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich)                          | 24.07.2024      | IE00BXQ9BJ78 | -                              | -         | 3,03      |
| Thesaurierende Klasse USD M                                      | 18.02.2016      | IE00BD9WHS47 | (11,18)                        | 7,66      | 4,01      |
| Ausschüttende Klasse USD M                                       | 25.08.2017      | IE00BDFBLR26 | (11,16)                        | 7,64      | 4,11      |
| Thesaurierende Klasse USD Z                                      | 30.06.2014      | IE00BKKMZY67 | (9,69)                         | 9,36      | 5,68      |
| Ausschüttende Klasse ZAR A (Monatlich)                           | 11.04.2024      | IE000MOWL5P2 | -                              | -         | 8,30      |
| Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)                           | 02.04.2024      | IE0000VDBUR8 | -                              | -         | (0,93)    |

## Anhang II (Fortsetzung)

### PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

#### Sustainable Asia High Yield

| Anteilklasse                           | Auflegungsdatum | ISIN         | Geschäftsjahr zum 31. Dezember |           |           |
|--|-----------------|--------------|--------------------------------|-----------|-----------|
|  |                 |              | 2022<br>%                      | 2023<br>% | 2024<br>% |
| Thesaurierende Klasse EUR X            | 28.01.2022      | IE0009LNQCG8 | (14,90)                        | 0,12      | -         |
| Thesaurierende Klasse GBP X            | 08.04.2022      | IE0002USV3J1 | (6,90)                         | 1,72      | -         |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) | 13.12.2021      | IE0003AW7W04 | (16,64)                        | 1,47      | 13,20     |
| Thesaurierende Klasse USD A            | 13.12.2021      | IE000198A7B6 | (16,36)                        | 1,45      | 13,33     |
| Thesaurierende Klasse USD I            | 13.12.2021      | IE000RBQOOF7 | (15,76)                        | 2,04      | 13,87     |
| Thesaurierende Klasse USD Z            | 21.01.2022      | IE000187JBO0 | (13,43)                        | 2,64      | 14,56     |
| Ausschüttende Klasse USD Z             | 22.03.2022      | IE000HTH7XL4 | (2,84)                         | 2,56      | 14,58     |

#### Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency

|                              |            |              |         |       |       |
|------------------------------|------------|--------------|---------|-------|-------|
| Thesaurierende Klasse EUR I3 | 26.09.2022 | IE00011CMUN9 | 7,90    | 10,75 | 8,54  |
| Thesaurierende Klasse EUR I4 | 13.04.2023 | IE000LAZMZO5 | -       | 8,30  | 8,59  |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 | 28.12.2022 | IE000WNKM6C0 | 0,10    | -     | -     |
| Thesaurierende Klasse EUR X  | 19.01.2022 | IE000RO18ND2 | (16,40) | 10,89 | 8,74  |
| Thesaurierende Klasse USD I  | 19.01.2022 | IE000FZALWJ6 | (14,60) | 13,11 | 10,35 |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 27.01.2022 | IE00071Y0WW3 | (14,50) | 13,57 | 10,61 |

#### Tactical Macro<sup>1</sup>

|                              |            |              |   |      |      |
|------------------------------|------------|--------------|---|------|------|
| Thesaurierende Klasse EUR I5 | 22.01.2024 | IE000UMPIRM1 | - | -    | 3,10 |
| Thesaurierende Klasse USD I  | 30.06.2023 | IE000PD59QT4 | - | 2,20 | 4,31 |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 30.06.2023 | IE000Y16CQ19 | - | 2,40 | 4,79 |
| Thesaurierende Klasse USD Z  | 30.06.2023 | IE000VOK74I4 | - | 2,60 | 5,17 |

#### Uncorrelated Strategies

|                              |            |              |        |         |      |
|------------------------------|------------|--------------|--------|---------|------|
| Thesaurierende Klasse CHF I  | 13.03.2018 | IE00BF2F4M73 | 6,38   | (12,28) | 2,54 |
| Thesaurierende Klasse CHF I5 | 08.09.2017 | IE00BZ3CG211 | 6,87   | -       | -    |
| Thesaurierende Klasse EUR A  | 20.08.2018 | IE00BDC3ND11 | 5,78   | (11,22) | 4,14 |
| Thesaurierende Klasse EUR I  | 06.03.2018 | IE00BF2F4L66 | 6,59   | (10,56) | 5,00 |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 | 06.07.2017 | IE00BD5BKL97 | 6,79   | (10,41) | 5,14 |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 | 31.05.2017 | IE00BF076079 | 7,00   | -       | -    |
| Thesaurierende Klasse EUR M  | 15.09.2017 | IE00BDC3NF35 | 4,91   | (11,90) | 3,35 |
| Thesaurierende Klasse EUR P  | 05.07.2022 | IE00093NGSP5 | (1,50) | (10,36) | 4,98 |
| Thesaurierende Klasse GBP I  | 30.06.2017 | IE00BF47M490 | 8,58   | (9,11)  | 6,49 |
| Thesaurierende Klasse GBP I2 | 06.07.2017 | IE00BD5BKG45 | 8,75   | (9,00)  | 6,65 |
| Ausschüttende Klasse GBP I2  | 30.08.2022 | IE000R82ESQ2 | (0,40) | (8,94)  | 6,73 |
| Thesaurierende Klasse GBP I5 | 31.05.2017 | IE00BF076186 | 9,01   | (8,69)  | 6,90 |
| Thesaurierende Klasse GBP P  | 02.10.2018 | IE00BFXBF434 | 8,67   | (9,05)  | 6,50 |
| Thesaurierende Klasse GBP Z  | 29.06.2017 | IE00BYQDD455 | 9,47   | (8,40)  | 7,36 |
| Thesaurierende Klasse JPY I  | 01.04.2022 | IE00BYQDD349 | 2,99   | (13,79) | 0,97 |
| Thesaurierende Klasse SGD A  | 13.04.2023 | IE00BGR6TZ09 | 0,55   | (3,25)  | 5,63 |
| Thesaurierende Klasse USD A  | 26.01.2018 | IE00BF076L85 | 7,50   | (9,52)  | 5,91 |
| Thesaurierende Klasse USD C1 | 06.03.2018 | IE00BYW7V144 | 6,55   | (10,50) | 4,86 |

## Anhang II (Fortsetzung)

## PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

## Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

| Anteilklasse                 | Auflegungsdatum | ISIN         | Geschäftsjahr zum 31. Dezember |           |           |
|------------------------------|-----------------|--------------|--------------------------------|-----------|-----------|
|                              |                 |              | 2022<br>%                      | 2023<br>% | 2024<br>% |
| Thesaurierende Klasse USD I  | 31.05.2017      | IE00BF075X33 | 8,33                           | (8,86)    | 6,69      |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 06.07.2017      | IE00BD5BKM05 | 8,49                           | (8,66)    | 6,84      |
| Thesaurierende Klasse USD I5 | 31.05.2017      | IE00BF07FG69 | 8,72                           | (8,51)    | 7,07      |
| Thesaurierende Klasse USD M  | 09.08.2017      | IE00BZ3CG328 | 6,66                           | (10,28)   | 5,02      |
| Thesaurierende Klasse USD P  | 12.12.2018      | IE00BFZPTC98 | 8,36                           | (8,92)    | 6,78      |
| Thesaurierende Klasse USD Z  | 08.09.2017      | IE00BF23SS52 | 9,22                           | (8,20)    | 7,52      |

## Uncorrelated Trading\*

|                             |            |              |        |   |   |
|-----------------------------|------------|--------------|--------|---|---|
| Thesaurierende Klasse EUR X | 14.06.2022 | IE000L1JDD81 | (1,70) | - | - |
| Thesaurierende Klasse USD X | 22.06.2022 | IE0003VEJ409 | 0,00   | - | - |

\* Das Portfolio wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

## US Equity

|  |            |              |         |       |       |
|--|------------|--------------|---------|-------|-------|
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)  | 15.07.2024 | IE000GNOYDF8 | -       | -     | 12,00 |
| Thesaurierende Klasse EUR I5                           | 17.06.2024 | IE0002A3CW52 | -       | -     | 7,30  |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert) | 17.06.2024 | IE00BMH55L70 | -       | -     | 12,10 |
| Ausschüttende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)  | 17.06.2024 | IE00081PHKH7 | -       | -     | 12,10 |
| Thesaurierende Klasse EUR X (nicht währungsgesichert)  | 05.03.2024 | IE0009U9OWP0 | -       | -     | 21,80 |
| Ausschüttende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)  | 17.06.2024 | IE000310MRW6 | -       | -     | 9,60  |
| Thesaurierende Klasse GBP X (nicht währungsgesichert)  | 05.03.2024 | IE000H8VAVB3 | -       | -     | 18,00 |
| Thesaurierende Klasse JPY I3                           | 01.03.2022 | IE000XSV3WB9 | (18,40) | 29,66 | 16,63 |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 27.03.2020 | IE00BHR06814 | (26,57) | 35,83 | 22,74 |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 18.12.2015 | IE00BD34ZN73 | (26,01) | 36,82 | 23,72 |
| Ausschüttende Klasse USD I                             | 18.12.2015 | IE00BD350682 | (26,03) | 36,87 | 23,68 |
| Thesaurierende Klasse USD I5                           | 26.02.2024 | IE00BMH55K63 | -       | -     | 14,90 |
| Ausschüttende Klasse USD I5                            | 17.06.2024 | IE0000HXOCX4 | -       | -     | 8,30  |
| Thesaurierende Klasse USD M                            | 09.02.2022 | IE00BHR06B44 | (22,60) | 34,75 | 21,76 |
| Thesaurierende Klasse USD X                            | 05.03.2024 | IE000LYT3XR3 | -       | -     | 16,10 |
| Thesaurierende Klasse USD Z                            | 25.09.2024 | IE000ZAYN7D1 | -       | -     | 4,00  |

## US Equity Premium

|   |            |              |         |       |       |
|---|------------|--------------|---------|-------|-------|
| Thesaurierende Klasse EUR I                           | 13.02.2017 | IE00BYX7LW42 | (13,09) | 12,83 | 11,30 |
| Ausschüttende Klasse EUR I3                           | 03.12.2021 | IE000NHZGVS8 | (12,93) | 13,03 | 11,56 |
| Thesaurierende Klasse EUR I4                          | 28.04.2017 | IE00BD4H0968 | (12,86) | 13,13 | 11,61 |
| Ausschüttende Klasse EUR I4                           | 15.12.2023 | IE000HG9AHM4 | -       | 0,70  | 11,58 |
| Thesaurierende Klasse EUR M                           | 13.02.2017 | IE00BYX7LX58 | (14,33) | 11,34 | 9,68  |
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) | 02.03.2017 | IE00BYWPKN37 | 0,59    | 8,91  | 15,21 |
| Thesaurierende Klasse GBP I3                          | 11.05.2021 | IE00BMWPYK46 | 0,78    | 9,07  | 15,44 |
| Ausschüttende Klasse GBP I3                           | 03.12.2021 | IE00BMD7ZC88 | (11,73) | 14,82 | 13,08 |
| Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert) | 21.06.2023 | IE0007M7EB22 | -       | 5,00  | 15,47 |

## Anhang II (Fortsetzung)

### PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

#### US Equity Premium (Fortsetzung)

| Anteilklasse   | Auflegungsdatum | ISIN         | Geschäftsjahr zum 31. Dezember |           |           |
|--|-----------------|--------------|--------------------------------|-----------|-----------|
|  |                 |              | 2022<br>%                      | 2023<br>% | 2024<br>% |
| Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) | 25.10.2017      | IE00BYXH8345 | 0,86                           | 9,11      | 15,53     |
| Ausschüttende Klasse GBP I4                            | 29.11.2023      | IE00BD3DV701 | -                              | 2,40      | 13,07     |
| Ausschüttende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)   | 25.08.2021      | IE00EORQCL4  | 0,64                           | 8,96      | 15,18     |
| Thesaurierende Klasse GBP X (nicht währungsgesichert)  | 26.02.2024      | IE000457NMH5 | -                              | -         | 12,20     |
| Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)                 | 15.08.2017      | IE00BDRKGH20 | (11,67)                        | 13,13     | 10,51     |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 23.01.2017      | IE00BDDWGC76 | (11,16)                        | 14,70     | 12,55     |
| Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)                 | 18.05.2017      | IE00BD461232 | (10,66)                        | 15,43     | 13,19     |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 30.12.2016      | IE00BDDWG831 | (10,63)                        | 15,39     | 13,15     |
| Ausschüttende Klasse USD I3                            | 03.12.2021      | IE000VHERIO9 | (10,45)                        | 15,53     | 13,40     |
| Thesaurierende Klasse USD I4                           | 28.04.2017      | IE00BD4HOB82 | (10,44)                        | 15,65     | 13,47     |
| Thesaurierende Klasse USD M                            | 13.02.2017      | IE00BYX7LY65 | (11,87)                        | 13,80     | 11,55     |
| Thesaurierende Klasse USD Z                            | 10.02.2017      | IE00BDDWGF08 | (10,11)                        | 16,08     | 13,85     |

#### US Large Cap Value

|  |            |              |        |        |       |
|--|------------|--------------|--------|--------|-------|
| Thesaurierende Klasse EUR A                            | 19.10.2022 | IE000F8FR4R1 | 8,70   | (5,70) | 7,71  |
| Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)  | 21.06.2022 | IE000JHJ5WY3 | 6,80   | (6,74) | 16,87 |
| Thesaurierende Klasse EUR I                            | 30.03.2022 | IE000NZY26Q1 | (8,00) | (4,89) | 8,46  |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)  | 19.04.2022 | IE000COXIH6  | (5,80) | (5,94) | 17,83 |
| Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)  | 22.03.2022 | IE000ALURE78 | (0,90) | (5,62) | 18,01 |
| Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert) | 27.01.2022 | IE000SK5XXE9 | 4,20   | (5,57) | 18,09 |
| Thesaurierende Klasse GBP I                            | 22.11.2022 | IE000I4SVYD3 | (2,40) | (3,38) | 9,86  |
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)  | 22.11.2022 | IE00001H49K2 | (3,40) | (8,07) | 12,27 |
| Ausschüttende Klasse GBP I                             | 22.11.2022 | IE000YZ914N6 | (2,40) | (3,39) | 9,96  |
| Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)   | 22.11.2022 | IE000EA4KHA8 | (3,40) | (8,20) | 12,37 |
| Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)  | 14.03.2022 | IE0005DYIEB4 | 9,20   | (7,87) | 12,69 |
| Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)  | 08.06.2022 | IE0004QFE496 | 2,80   | (8,17) | 12,39 |
| Ausschüttende Klasse GBP P                             | 21.10.2022 | IE000VWPWUH3 | 6,30   | (3,37) | 9,91  |
| Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)  | 24.05.2022 | IE000YILQ9A8 | 4,80   | (8,11) | 12,46 |
| Ausschüttende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)   | 30.08.2022 | IE000NVIOWF0 | 2,90   | (8,02) | 12,43 |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 24.03.2022 | IE000M9KFDE8 | (5,00) | (3,37) | 9,48  |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 20.12.2021 | IE0003JM1523 | (1,06) | (2,63) | 10,39 |
| Ausschüttende Klasse USD I4                            | 21.03.2022 | IE000CGMU1E8 | (3,70) | (2,34) | 10,63 |
| Thesaurierende Klasse USD I5                           | 11.02.2022 | IE000429UF11 | (3,50) | (2,28) | 10,82 |
| Thesaurierende Klasse USD M                            | 25.03.2022 | IE000E4YYWX1 | (6,50) | (4,28) | 8,72  |
| Thesaurierende Klasse USD Y                            | 08.08.2023 | IE000D0QTQS8 | -      | (1,10) | 10,52 |
| Thesaurierende Klasse USD Z                            | 23.05.2022 | IE0008OYN7T5 | 1,00   | (1,98) | 11,21 |

#### US Long Short Equity

|                              |            |              |         |       |      |
|------------------------------|------------|--------------|---------|-------|------|
| Thesaurierende Klasse EUR A  | 06.07.2015 | IE00BPRC5K89 | (10,81) | 10,00 | 3,76 |
| Thesaurierende Klasse EUR I  | 01.12.2014 | IE00BJTD3X67 | (10,02) | 11,05 | 4,74 |
| Thesaurierende Klasse EUR I3 | 13.05.2020 | IE00BMYMJT70 | (9,68)  | 11,48 | 5,19 |

## Anhang II (Fortsetzung)

## PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

## US Long Short Equity (Fortsetzung)

| Anteilklasse   | Auflegungsdatum | ISIN         | Geschäftsjahr zum 31. Dezember |           |           |
|--|-----------------|--------------|--------------------------------|-----------|-----------|
|  |                 |              | 2022<br>%                      | 2023<br>% | 2024<br>% |
| Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert) | 20.06.2024      | IE000T8TM4L4 | -                              | -         | 7,80      |
| Thesaurierende Klasse EUR M                            | 04.12.2015      | IE00BWB95R13 | (11,45)                        | 9,11      | 2,96      |
| Ausschüttende Klasse GBP I3                            | 08.09.2020      | IE00BMXNP376 | (8,20)                         | 13,23     | 6,57      |
| Thesaurierende Klasse SGD A1                           | 31.10.2014      | IE00BJTD4N35 | (8,70)                         | 11,31     | 4,13      |
| Thesaurierende Klasse USD A (PF)                       | 10.06.2015      | IE00BWB95Q06 | (8,01)                         | 12,29     | 5,17      |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 24.02.2015      | IE00BVYJ5W68 | (8,56)                         | 12,39     | 5,55      |
| Thesaurierende Klasse USD A1                           | 03.04.2014      | IE00BJTD4V19 | (8,28)                         | 12,75     | 6,04      |
| Ausschüttende Klasse USD I (PF)                        | 13.03.2015      | IE00BV9FSD10 | (7,36)                         | 12,83     | 5,70      |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 28.02.2014      | IE00BJTCX997 | (7,67)                         | 13,34     | 6,47      |
| Thesaurierende Klasse USD I3                           | 13.05.2020      | IE00BMYMKR20 | (7,26)                         | 13,83     | 6,95      |
| Thesaurierende Klasse USD M                            | 09.08.2017      | IE00BZ3CG435 | (9,33)                         | 11,48     | 4,66      |
| Thesaurierende Klasse USD U                            | 06.03.2015      | IE00BNJZX306 | (8,15)                         | 12,91     | 6,00      |
| Thesaurierende Klasse USD Z                            | 15.05.2014      | IE00BKKN1160 | (6,47)                         | 14,97     | 7,94      |

## US Multi Cap Opportunities

|   |            |              |         |       |        |
|---|------------|--------------|---------|-------|--------|
| Thesaurierende Klasse AUD E                           | 02.07.2014 | IE00BNK02N76 | (20,80) | 13,29 | 16,64  |
| Thesaurierende Klasse AUD T                           | 19.12.2016 | IE00BCDZ0167 | (20,01) | 14,42 | 17,84  |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) | 12.12.2024 | IE000RPUKCO4 | -       | -     | (3,00) |
| Thesaurierende Klasse EUR I3                          | 21.03.2013 | IE00B80TLB03 | (19,56) | 15,67 | 19,03  |
| Thesaurierende Klasse EUR M                           | 29.01.2016 | IE00BWB95S20 | (21,32) | 13,14 | 16,44  |
| Thesaurierende Klasse EUR1 A                          | 28.06.2012 | IE00B7F25G09 | (20,53) | 14,31 | 17,61  |
| Thesaurierende Klasse EUR1 I                          | 28.06.2012 | IE00B84HCB79 | (19,84) | 15,24 | 18,62  |
| Ausschüttende Klasse GBP I3                           | 20.06.2024 | IE000V8Q5H75 | -       | -     | 8,40   |
| Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert) | 06.11.2017 | IE00B7WF5P11 | (6,27)  | 11,77 | 23,28  |
| Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) | 30.08.2024 | IE000IBZ9WY2 | -       | -     | 6,80   |
| Thesaurierende Klasse SGD A                           | 16.07.2013 | IE00B3S45H60 | (18,53) | 15,26 | 17,51  |
| Thesaurierende Klasse USD B                           | 22.11.2013 | IE00BCDZ0381 | (18,72) | 15,79 | 18,39  |
| Thesaurierende Klasse USD C1                          | 13.10.2017 | IE00BDFBKF39 | (18,64) | 15,93 | 18,49  |
| Thesaurierende Klasse USD C2                          | 22.11.2013 | IE00BCDZ0506 | (18,68) | 15,84 | -      |
| Thesaurierende Klasse USD E                           | 02.07.2014 | IE00BNK02L52 | (18,69) | 15,82 | 18,35  |
| Thesaurierende Klasse USD I2                          | 24.05.2023 | IE000ZA1BZG7 | -       | 12,00 | 20,89  |
| Thesaurierende Klasse USD I3                          | 29.04.2013 | IE00B87F0588 | (16,78) | 18,48 | 21,08  |
| Ausschüttende Klasse USD I3                           | 30.07.2013 | IE00B6W3XJ81 | (16,82) | 18,52 | -      |
| Thesaurierende Klasse USD M                           | 18.02.2016 | IE00BD9WHM84 | (18,60) | 15,94 | 18,48  |
| Thesaurierende Klasse USD T                           | 22.11.2013 | IE00BCDZ0720 | (17,85) | 16,91 | 19,55  |
| Thesaurierende Klasse USD U                           | 22.01.2013 | IE00B819XJ19 | (17,43) | 17,60 | 20,23  |
| Thesaurierende Klasse USD Z                           | 02.05.2014 | IE00BKJ9MD40 | (16,38) | 19,08 | 21,70  |
| Thesaurierende Klasse USD1 A                          | 29.06.2012 | IE00B775SV38 | (17,80) | 17,07 | 19,66  |
| Thesaurierende Klasse USD1 I                          | 28.06.2012 | IE00B7XCGB41 | (17,11) | 18,10 | 20,68  |
| Ausschüttende Klasse USD1 I                           | 29.06.2012 | IE00B3RSF130 | (17,10) | 18,06 | 20,69  |
| Thesaurierende Klasse ZAR B                           | 13.01.2014 | IE00BH2RDW08 | (16,64) | 18,65 | 21,52  |

## Anhang II (Fortsetzung)

### PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

#### US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

| Anteilklasse                 | Auflegungsdatum | ISIN         | Geschäftsjahr zum 31. Dezember |           |           |
|------------------------------|-----------------|--------------|--------------------------------|-----------|-----------|
|                              |                 |              | 2022<br>%                      | 2023<br>% | 2024<br>% |
| Thesaurierende Klasse ZAR C2 | 13.01.2014      | IE00BH2RDX15 | (16,63)                        | 18,70     | -         |
| Thesaurierende Klasse ZAR E  | 02.07.2014      | IE00BNK02M69 | (16,64)                        | 18,65     | 21,53     |
| Thesaurierende Klasse ZAR T  | 13.01.2014      | IE00BH2RDY22 | (15,80)                        | 19,84     | 22,75     |

#### US Real Estate Securities

|   |            |              |         |       |        |
|---|------------|--------------|---------|-------|--------|
| Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)  | 08.08.2016 | IE00BD0PCG51 | (30,39) | 7,12  | 1,75   |
| Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich)  | 16.08.2016 | IE00B95ZZZ11 | (31,29) | 5,69  | 0,44   |
| Thesaurierende Klasse AUD B             | 19.08.2015 | IE00B8HXG989 | (31,29) | 5,70  | 0,42   |
| Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich) | 16.08.2016 | IE00B95S5V74 | (31,26) | -     | -      |
| Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)  | 16.08.2016 | IE00BYN4NT64 | (31,32) | 5,70  | 0,43   |
| Thesaurierende Klasse AUD E             | 02.07.2014 | IE00BNK02P90 | (31,30) | 5,68  | 0,47   |
| Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)  | 13.10.2015 | IE00B961PR15 | (30,59) | 6,79  | 1,44   |
| Thesaurierende Klasse AUD T             | 16.07.2013 | IE00B8HXGG57 | (30,58) | 6,68  | 1,50   |
| Thesaurierende Klasse CHF A             | 11.10.2012 | IE00B68CYF25 | (31,16) | 5,03  | (1,29) |
| Thesaurierende Klasse EUR A             | 01.02.2006 | IE00B0TOGT17 | (30,97) | 7,02  | 1,29   |
| Thesaurierende Klasse EUR I             | 01.02.2006 | IE00B0TOGS00 | (30,40) | 7,83  | 2,00   |
| Thesaurierende Klasse EUR M             | 29.01.2016 | IE00BWB97865 | (31,56) | 5,94  | 0,18   |
| Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)  | 28.07.2016 | IE00BD0PCF45 | (28,92) | 8,62  | 2,30   |
| Thesaurierende Klasse SGD A             | 28.05.2013 | IE00B45NX917 | (29,19) | 7,93  | 1,22   |
| Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)  | 18.11.2015 | IE00B95QR487 | (28,50) | 9,67  | 3,34   |
| Thesaurierende Klasse USD A             | 01.02.2006 | IE00B0TOGQ85 | (28,55) | 9,72  | 3,28   |
| Ausschüttende Klasse USD A              | 21.03.2012 | IE00B1G9WX41 | (28,53) | 9,70  | 3,27   |
| Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich)  | 15.08.2016 | IE00B95SNQ81 | (29,45) | 8,32  | 1,98   |
| Thesaurierende Klasse USD B             | 16.07.2013 | IE00B8HXHJ53 | (29,46) | 8,31  | 1,92   |
| Thesaurierende Klasse USD C1            | 31.08.2017 | IE00BDFBLK56 | (29,25) | 8,62  | 2,21   |
| Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich) | 16.08.2016 | IE00B95TPW15 | (29,43) | -     | -      |
| Thesaurierende Klasse USD C2            | 16.07.2013 | IE00B8HXHK68 | (29,48) | -     | -      |
| Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)  | 15.08.2016 | IE00BYN4NV86 | (29,45) | 8,32  | 1,98   |
| Thesaurierende Klasse USD E             | 02.07.2014 | IE00BNK02Q08 | (29,45) | 8,29  | 1,95   |
| Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)  | 19.11.2019 | IE00B95JP96  | (27,96) | 10,48 | 4,11   |
| Thesaurierende Klasse USD I             | 01.02.2006 | IE00B0TOGP78 | (28,01) | 10,55 | 4,06   |
| Ausschüttende Klasse USD I              | 14.02.2013 | IE00B90CY062 | (28,01) | 10,62 | 4,03   |
| Thesaurierende Klasse USD I2            | 05.12.2012 | IE00B8B20D34 | (27,87) | 10,78 | 4,27   |
| Thesaurierende Klasse USD M             | 18.02.2016 | IE00BD9WHN91 | (29,27) | 8,61  | 2,25   |
| Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)  | 01.01.2016 | IE00BDD1NC38 | (28,73) | 9,38  | 2,99   |
| Thesaurierende Klasse USD T             | 16.07.2013 | IE00B8HXHL75 | (28,76) | 9,40  | 2,97   |
| Thesaurierende Klasse USD Z             | 10.02.2015 | IE00BKJ9MS92 | (27,44) | 11,42 | 4,81   |
| Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)  | 16.08.2016 | IE00BD89KB03 | (27,64) | 10,53 | 4,69   |
| Thesaurierende Klasse ZAR B             | 13.03.2015 | IE00BCDYB81  | (27,67) | 10,55 | 4,66   |
| Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich) | 15.08.2016 | IE00BD89K988 | (27,63) | -     | -      |
| Thesaurierende Klasse ZAR C2            | 11.04.2019 | IE00BCDYZD06 | (27,67) | 10,56 | -      |

## Anhang II (Fortsetzung)

## PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

## US Real Estate Securities (Fortsetzung)

| Anteilklasse                           | Auflegungsdatum | ISIN         | Geschäftsjahr zum 31. Dezember |           |           |
|--|-----------------|--------------|--------------------------------|-----------|-----------|
|  |                 |              | 2022<br>%                      | 2023<br>% | 2024<br>% |
| Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich) | 16.08.2016      | IE00BYN4NX01 | (27,63)                        | 10,53     | 4,69      |
| Thesaurierende Klasse ZAR E            | 02.07.2014      | IE00BNK02R15 | (27,67)                        | 10,55     | 4,66      |
| Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) | 11.06.2013      | IE00BBGB0Y75 | (26,91)                        | 11,63     | 5,75      |
| Thesaurierende Klasse ZAR T            | 26.07.2013      | IE00BCDYZG37 | (26,94)                        | 11,67     | 5,71      |

## US Small Cap

|  |            |              |         |       |        |
|--|------------|--------------|---------|-------|--------|
| Thesaurierende Klasse AUD B                            | 25.10.2019 | IE00B8HXHQ21 | (22,92) | 10,41 | 4,92   |
| Thesaurierende Klasse AUD C2                           | 04.09.2018 | IE00B8HXHT51 | (22,93) | 10,48 | -      |
| Thesaurierende Klasse AUD E                            | 02.07.2014 | IE00BNK02S22 | (22,88) | 10,39 | 4,95   |
| Thesaurierende Klasse AUD T                            | 19.12.2016 | IE00B8HXJ447 | (22,13) | 11,54 | 5,94   |
| Thesaurierende Klasse EUR A                            | 28.06.2016 | IE00B44F1J46 | (22,62) | 11,45 | 6,04   |
| Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)  | 18.09.2020 | IE00B42MJZ94 | (14,66) | 10,45 | 15,05  |
| Thesaurierende Klasse EUR I                            | 06.08.2013 | IE00B3PY8J28 | (21,97) | 12,44 | 6,89   |
| Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)  | 16.10.2017 | IE00B4NQT611 | (13,94) | 11,43 | 16,02  |
| Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert) | 24.01.2019 | IE00BGSF1T43 | (13,79) | 11,53 | 16,27  |
| Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert) | 05.05.2022 | IE000NDPFUI3 | (1,40)  | 11,76 | 16,42  |
| Thesaurierende Klasse EUR M                            | 04.02.2016 | IE00BWB97H54 | (23,39) | 10,39 | 4,91   |
| Thesaurierende Klasse EUR Z                            | 31.03.2016 | IE00BKJB1D33 | (21,31) | 13,39 | 7,79   |
| Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)  | 16.10.2024 | IE000HKZYSP9 | -       | -     | (0,90) |
| Ausschüttende Klasse JPY I                             | 29.07.2011 | IE00B4TSG157 | (7,47)  | 23,22 | 21,26  |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 05.07.2011 | IE00B64QTZ34 | (19,92) | 14,34 | 7,89   |
| Ausschüttende Klasse USD A                             | 28.11.2016 | IE00BLDYK493 | (19,93) | 14,35 | 7,88   |
| Thesaurierende Klasse USD B                            | 16.07.2013 | IE00B8HXJT91 | (20,82) | 13,09 | 6,69   |
| Thesaurierende Klasse USD C2                           | 16.07.2013 | IE00B8HXK635 | (20,84) | 13,13 | -      |
| Thesaurierende Klasse USD E                            | 02.07.2014 | IE00BNK02T39 | (20,79) | 13,10 | 6,70   |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 01.07.2011 | IE00B66ZT477 | (19,25) | 15,36 | 8,76   |
| Ausschüttende Klasse USD I                             | 10.12.2013 | IE00BH2RF025 | (19,26) | 15,36 | 8,77   |
| Thesaurierende Klasse USD I3                           | 30.07.2018 | IE00B8GCB135 | (19,04) | 15,61 | 9,05   |
| Thesaurierende Klasse USD M                            | 18.02.2016 | IE00BD9WHP16 | (20,67) | 13,17 | 6,79   |
| Thesaurierende Klasse USD T                            | 16.07.2013 | IE00B8HXK965 | (20,02) | 14,28 | 7,74   |
| Thesaurierende Klasse USD Z                            | 30.08.2016 | IE00BKJ9TJ96 | (18,54) | 16,27 | 9,72   |
| Thesaurierende Klasse ZAR E                            | 08.08.2017 | IE00BNK02V50 | (18,79) | 15,46 | 9,28   |
| Thesaurierende Klasse ZAR T                            | 19.12.2016 | IE00BH2RF918 | (17,97) | 16,62 | 10,38  |

## US Small Cap Intrinsic Value

|  |            |              |         |       |       |
|--|------------|--------------|---------|-------|-------|
| Thesaurierende Klasse EUR I3                           | 05.02.2024 | IE000QXNM1Z5 | -       | -     | 9,70  |
| Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)  | 09.03.2021 | IE00BLR75F08 | (10,68) | 7,77  | 9,61  |
| Thesaurierende Klasse GBP I2 (nicht währungsgesichert) | 22.10.2021 | IE000HFERTZ5 | (10,48) | 7,95  | 9,85  |
| Thesaurierende Klasse JPY I3 (nicht währungsgesichert) | 29.08.2023 | IE000YD8EH37 | -       | 1,25  | 20,38 |
| Thesaurierende Klasse USD A                            | 04.02.2016 | IE00BY7S3S36 | (21,29) | 13,19 | 6,80  |
| Thesaurierende Klasse USD I                            | 30.04.2015 | IE00BX1D4S49 | (20,64) | 14,17 | 7,72  |

## Anhang II (Fortsetzung)

### PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

#### US Small Cap Intrinsic Value (Fortsetzung)

| Anteilklasse                 | Auflegungsdatum | ISIN         | Geschäftsjahr zum 31. Dezember |           |           |
|------------------------------|-----------------|--------------|--------------------------------|-----------|-----------|
|                              |                 |              | 2022<br>%                      | 2023<br>% | 2024<br>% |
| Thesaurierende Klasse USD I2 | 16.03.2022      | IE000E90KKM6 | (15,60)                        | 14,45     | 7,87      |
| Thesaurierende Klasse USD I3 | 11.11.2024      | IE000KBZWLT3 | -                              | -         | (3,50)    |
| Thesaurierende Klasse USD M  | 27.05.2016      | IE00BYQQ4L83 | (22,08)                        | 12,03     | 5,73      |

<sup>1</sup> Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

## Anhang III

### INFORMATIONEN ÜBER DAS GESAMTRISIKO (UNGEPRÜFT)

Messung des Marktrisikos und des Leverage unter Verwendung des Commitment- und VaR-Ansatzes

Die Portfolios streben eine Begrenzung des durch den Einsatz von Derivaten entstehenden Marktrisikos und Leverage (Hebelung) an, indem sie entweder den Commitment-Ansatz oder eine als Value-at-Risk („VaR“) bekannte komplexe Methode der Risikomessung anwenden. Der China A-Share Equity, China Equity, Climate Innovation, CLO Income, Corporate Hybrid Bond, Developed Market FMP – 2027, Emerging Markets Equity, European High Yield Bond, European Sustainable Equity, Global Equity Megatrends, Global High Yield Engagement, Global Investment Grade Credit, Global Sustainable Equity, Global Value, High Yield Bond, InnovAsia, Japan Equity Engagement, Next Generation Connectivity, Next Generation Mobility, Next Generation Space Economy, Short Duration Emerging Market Debt, Short Duration High Yield Engagement, US Equity, US Large Cap Value, US Multi Cap Opportunities, US Real Estate Securities, US Small Cap und US Small Cap Intrinsic Value enden den Commitment-Ansatz an. Der Commitment-Ansatz berechnet die Hebelung, indem der Marktwert des zugrunde liegenden Derivateengagements im Verhältnis zum NIW des jeweiligen Portfolios gemessen wird. Diese Hebelung wird jedoch zu keinem Zeitpunkt den NIW des Portfolios übersteigen.

Ein Portfolio kann ein „absolutes“ VaR-Modell anwenden, bei dem die Messung des VaR relativ zum Nettoinventarwert des Portfolios erfolgt, oder ein relatives VaR-Modell, bei dem die Messung des VaR im Verhältnis zu einer derivativefreien vergleichbaren Benchmark oder einem äquivalenten Portfolio erfolgt. Das von bestimmten Portfolios verwendete Modell ist in der Spalte „Marktrisiko“ in nachstehender Tabelle angegeben. Die angewandte VaR-Methode unterliegt mehreren Einschränkungen. Erstens basiert der VaR auf einem Modell für Aktienkursrenditen, das Risikofaktoren verwendet. Insoweit es dabei fehlende Risikofaktoren, fehlspezifizierte Risikofaktoren oder Risikofaktoren gibt, die nicht vorhersehbar sind, ist der VaR möglicherweise kein Indikator für das künftige Risiko. Ferner sind die auf verschiedene Risikofaktoren zurückzuführenden Renditen nicht direkt am Markt beobachtbar und müssen anhand statistischer Techniken geschätzt werden. Insofern diese Schätzungen nicht genau sein können, ist der VaR möglicherweise kein Indikator für das künftige Risiko. Darüber hinaus wird die Kovarianz zwischen den Risikofaktoren über einen bestimmten historischen Zeitraum geschätzt. Insofern sich der künftige Zeitraum vom historischen Zeitraum unterscheidet, ist der VaR möglicherweise kein Indikator für das künftige Risiko. Aus diesen Gründen kann der VaR eher als relativer Risikomaßstab unter Portfolios und nicht als absoluter Risikomaßstab nützlich sein.

Für die Portfolios, die das VaR-Modell anwenden, werden mehrere Berechnungsstandards angewandt. Auf diese Berechnungsstandards wird jedoch im Risikomanagementprozess des Portfolios näher eingegangen, und sie können sich von Zeit zu Zeit im Ermessen des Managers und gemäß den Anforderungen der Zentralbank ändern.

In der nachfolgenden Tabelle ist die maximale, minimale und mittlere Ausnutzung der regulatorischen VaR-Grenze für die jeweiligen Portfolios, die den VaR-Ansatz anwenden, für das am 31. Dezember 2024 beendete Geschäftsjahr aufgeführt (die Kalibrierung für alle VaR-Kennzahlen ist ein 99%iges Konfidenzintervall, basierend auf einer Haltedauer von einem Monat.):

| Portfolio   | Marktrisiko   | Am 31. Dezember 2024 beobachteter VaR | Maximale Ausnutzung der regulatorischen VaR-Grenze** | Minimale Ausnutzung der regulatorischen VaR-Grenze** | Mittlere Ausnutzung der regulatorischen VaR-Grenze** |
|---|---------------|---------------------------------------|--|--|--|
| Asia Responsible Transition Bond                        | Relativer VaR | 93,19 %                               | 54,32 %  | 46,60 %  | 51,34 %  |
| China Bond  | Absoluter VaR | 0,88 %                                | 11,05 %  | 4,40 %   | 5,25 %   |
| Commodities   | Relativer VaR | 100,30 %                              | 56,07 %  | 47,40 %  | 52,37 %  |
| EMD Corporate – Social and Environmental Transition     | Relativer VaR | 103,17 %                              | 56,41 %  | 49,20 %  | 53,97 %  |
| Emerging Market Debt - Hard Currency                    | Relativer VaR | 105,32 %                              | 57,36 %  | 52,66 %  | 55,08 %  |
| Emerging Market Debt - Local Currency                   | Relativer VaR | 101,69 %                              | 57,46 %  | 47,26 %  | 54,38 %  |
| Emerging Market Debt Blend                              | Relativer VaR | 98,04 %                               | 58,26 %  | 48,49 %  | 55,22 %  |
| Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend | Relativer VaR | 96,69 %                               | 54,44 %  | 48,35 %  | 51,88 %  |
| Euro Bond   | Relativer VaR | 95,97 %                               | 57,58 %  | 44,59 %  | 51,29 %  |
| Euro Bond Absolute Return                               | Absoluter VaR | 1,24 %                                | 11,45 %  | 6,20 %   | 9,45 %   |
| Event Driven  | Absoluter VaR | 5,52 %                                | 37,00 %  | 21,35 %  | 27,93 %  |
| Global Bond   | Relativer VaR | 102,95 %                              | 56,01 %  | 47,15 %  | 52,08 %  |
| Global Flexible Credit Income                           | Absoluter VaR | 2,06 %                                | 16,95 %  | 10,10 %  | 12,70 %  |
| Global Opportunistic Bond                               | Absoluter VaR | 2,88 %                                | 23,75 %  | 14,20 %  | 19,10 %  |
| Short Duration Euro Bond                                | Absoluter VaR | 0,71 %                                | 5,40 %   | 3,15 %   | 4,20 %   |
| Strategic Income  | Absoluter VaR | 2,55 %                                | 19,75 %  | 10,30 %  | 17,60 %  |
| Sustainable Asia High Yield                             | Relativer VaR | 93,83 %                               | 62,60 %  | 40,99 %  | 50,79 %  |

## Anhang III (Fortsetzung)

### INFORMATIONEN ÜBER DAS GESAMTRISIKO (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

| Portfolio (Fortsetzung)                          | Marktrisiko   | Am 31. Dezember 2024 beobachteter VaR | Maximale Ausnutzung der regulatorischen VaR-Grenze** | Minimale Ausnutzung der regulatorischen VaR-Grenze** | Mittlere Ausnutzung der regulatorischen VaR-Grenze** |
|--|---------------|---------------------------------------|--|--|--|
| Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency | Relativer VaR | 98,52 %                               | 55,17 %  | 49,26 %  | 52,49 %  |
| Tactical Macro                                   | Absoluter VaR | 0,08 %                                | 12,25 %  | 0,15 %   | 4,95 %   |
| Uncorrelated Strategies                          | Absoluter VaR | 4,71 %                                | 35,07 %  | 5,21 %   | 13,47 %  |
| US Equity Premium                                | Absoluter VaR | 8,18 %                                | 58,00 %  | 12,60 %  | 24,35 %  |
| US Long Short Equity                             | Absoluter VaR | 4,46 %                                | 27,85 %  | 20,20 %  | 23,40 %  |

\*Repräsentiert das Verhältnis des Portfolio-VaR zu seiner Benchmark.

\*\*Regulatorische VaR-Grenze für 1M 99% VAR ist 20 %. Für den relativen VaR ist 2\* der Benchmark-VaR.

Die Portfolios können in Abhängigkeit von den Marktbedingungen von Zeit zu Zeit Leverage einsetzen. Das „Leverage“ wird gemäß den Anforderungen der Zentralbank als Summe der Nennwerte der eingesetzten Derivate berechnet. Das offen gelegte Leverage-Niveau ist nicht als zusätzliches Risiko-Limit für die Portfolios vorgesehen. Auch soll das Leverage-Niveau an sich keinen Hinweis auf das Risikoprofil der Portfolios darstellen. In der nachfolgenden Tabelle ist das während des Geschäftsjahres vorhandene Leverage-Niveau für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024 aufgeführt, berechnet als die Summe des absoluten Wertes der Nennwerte der eingesetzten Derivate und angegeben als Prozentsatz vom Nettoinventarwert:

| Portfolio   | 31. Dezember 2024 |
|---|-------------------|
| Asia Responsible Transition Bond                        | 50 %              |
| China Bond  | 86 %              |
| Commodities   | 100 %             |
| EMD Corporate – Social and Environmental Transition     | 18 %              |
| Emerging Market Debt - Hard Currency                    | 48 %              |
| Emerging Market Debt - Local Currency                   | 159 %             |
| Emerging Market Debt Blend                              | 127 %             |
| Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend | 122 %             |
| Euro Bond   | 49 %              |
| Euro Bond Absolute Return                               | 59 %              |
| Event Driven  | 80 %              |
| Global Bond   | 311 %             |
| Global Flexible Credit Income                           | 69 %              |
| Global Opportunistic Bond                               | 386 %             |
| Short Duration Euro Bond                                | 17 %              |
| Strategic Income  | 58 %              |
| Sustainable Asia High Yield                             | 9 %               |
| Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency        | 90 %              |
| Tactical Macro  | 89 %              |
| Uncorrelated Strategies                                 | 694 %             |
| US Equity Premium                                       | 69 %              |
| US Long Short Equity                                    | 38 %              |

## Anhang IV

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (UNGEPRÜFT)

Die Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften („SFTR“) führt Berichtspflichten für Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFTs“) und Total Return Swaps ein.

Ein Wertpapierfinanzierungsgeschäft (SFT) wird gemäß Artikel 3(11) der SFTR definiert als:

- ein Pensionsgeschäft/umgekehrtes Pensionsgeschäft
- Wertpapier- oder Rohstoffentleih- oder ausleihgeschäfte
- eine Kauf- und Rückkauftransaktion oder Verkaufs- und Rückkauftransaktion oder
- ein Lombardgeschäft

Zum 31. Dezember 2024 hielten die folgenden Portfolios Total Return Swaps und Pensionsgeschäfte/umgekehrte Pensionsgeschäfte als unter den Geltungsbereich der SFTR fallende Instrumententypen:

CLO Income  
Corporate Hybrid Bond  
Emerging Market Debt - Hard Currency  
Event Driven  
Global High Yield Engagement  
High Yield Bond  
Short Duration Emerging Market Debt  
Short Duration High Yield Engagement  
Strategic Income  
Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency  
Tactical Macro  
Uncorrelated Strategies  
US Long Short Equity

## Anhang IV (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### CLO Income

#### ALLGEMEINE DATEN:

Vermögenswerte von Total Return Swaps und Pensionsgeschäften beliefen sich zum 31. Dezember 2024 auf:

| Art von Vermögenswert                  | Betrag US\$ | Anteil am NIW (in %) |
|--|-------------|----------------------|
| Pensionsgeschäfte - Vermögenswerte     | 84.500.000  | 7,89                 |
| Total Return Swaps - Verbindlichkeiten | 194.289     | 0,02                 |

#### DATEN ZUR WIEDERVERWENDUNG VON SICHERHEITEN:

Die Barsicherheiten gehen auf dem Verwahrkonto für das Portfolio ein und werden deshalb nicht speziell nachverfolgt, um eine Wiederverwendung zu ermitteln. Deshalb können wiederverwendete Barsicherheiten nicht angemessen geprüft werden.

#### KONZENTRIERTE DATEN:

Zum 31. Dezember 2024 hat das Portfolio keine Wertpapiere als Sicherheiten für die Total Return Swaps oder die Pensionsgeschäfte erhalten.

Die Gegenparteien von allen Total Return Swaps und Pensionsgeschäften zum 31. Dezember 2024 waren wie folgt:

| Gegenpartei                 | Betrag US\$ |
|-----------------------------|-------------|
| Goldman Sachs International | 51.565      |
| JPMorgan Chase Bank         | 142.724     |
| State Street Bank           | 84.500.000  |

#### VERWAHRUNG ERHALTENER SICHERHEITEN:

Zum 31. Dezember 2024 wurden keine Sicherheiten von der Verwahrstelle entgegengenommen oder gehalten.

## Anhang IV (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### CLO Income (Fortsetzung)

#### KONSOLIDIERTE TRANSAKTIONS DATEN:

Die konsolidierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (Barmittel inbegriffen), die für alle Total Return Swaps und Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2024 gestellt/(erhalten) wurden, stellten sich wie folgt dar:

|                           | Art der Sicherheit | Betrag US\$* | Qualität** | Laufzeit (Sicherheiten)*** | Währung von Sicherheiten | Gründungsland der Gegenpartei**** | Abwicklung und Clearing |
|---------------------------|--------------------|--------------|------------|----------------------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------|
| <b>Total Return Swaps</b> |                    |              |            |                            |                          |                                   |                         |
| JPMorgan Chase Bank       | Barsicherheiten    | 280.000      | k.A.       | k.A.                       | USD                      | USA                               | OTC                     |
| <b>Pensionsgeschäfte</b>  |                    |              |            |                            |                          |                                   |                         |
| State Street Bank         | Staatsanleihen     | 86.190.114   | AA+        | > 1 Jahr                   | USD                      | USA                               | OTC                     |

\* Barsicherheiten können eine Kombination aus Swap-Instrumenten umfassen, da ein Teil der Sicherheiten sich auf nicht unter den Geltungsbereich der SFTR fallende Swap-Vereinbarungen bezieht.

\*\* Für Baranlagen oder Verbindlichkeiten gibt es kein Kreditrating. Aufgrund ihrer höchst liquiden Natur gelten auf US-Dollar lautende Barmittel als von höchster Qualität.

\*\*\* Aufgeteilt in 7 Fälligkeitssegmente (< 1 Tag, 1 Tag bis zu 1 Woche, 1 Woche bis zu 1 Monat, 1 Monat bis zu 3 Monaten, 3 Monate bis zu 1 Jahr, > 1 Jahr, offene Laufzeit). Barsicherheiten haben keine Laufzeit.

\*\*\*\* Das Land entspricht der Adresse der aktuellen Gegenpartei.

Die Laufzeiten der Positionen in Total Return Swaps zum 31. Dezember 2024 lagen zwischen 1 Monat und 3 Monaten.

Die Laufzeiten der Positionen in Pensionsgeschäften zum 31. Dezember 2024 lagen zwischen 1 Tag und 1 Woche.

#### VERWAHRUNG GESTELLTER SICHERHEITEN:

Der Anteil der Sicherheiten, die zum 31. Dezember 2024 auf getrennten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten wurden, war wie folgt:

|                  | %     |
|------------------|-------|
| Getrennte Konten | 0 %   |
| Gepoolte Konten  | 0 %   |
| Sonstiges        | 100 % |
|                  | 100 % |

## Anhang IV (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### CLO Income (Fortsetzung)

##### ERTRAG/KOSTEN:

Bei Total Return Swaps und Pensionsgeschäften sind Transaktionskosten, falls zutreffend, nicht separat identifizierbar. Bei diesen Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und sind Teil der Bruttoanlageperformance der einzelnen Portfolios. Renditen werden als realisierte Gewinne/Verluste und die Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus Swap-Verträgen und Pensionsgeschäften während der Berichtsperiode identifiziert.

#### Corporate Hybrid Bond

##### ALLGEMEINE DATEN:

Vermögenswerte in Pensionsgeschäften beliefen sich zum 31. Dezember 2024 auf:

| Art von Vermögenswert              | Betrag EUR | Anteil am NIW (in %) |
|------------------------------------|------------|----------------------|
| Pensionsgeschäfte - Vermögenswerte | 14.002.897 | 0,60                 |

##### DATEN ZUR WIEDERVERWENDUNG VON SICHERHEITEN:

Die Barsicherheiten gehen auf dem Verwahrkonto für das Portfolio ein und werden deshalb nicht speziell nachverfolgt, um eine Wiederverwendung zu ermitteln. Deshalb können wiederverwendete Barsicherheiten nicht angemessen geprüft werden.

##### KONZENTRIERTE DATEN:

Zum 31. Dezember 2024 hat das Portfolio keine Wertpapiere als Sicherheiten für Pensionsgeschäfte erhalten.

Die Gegenparteien von Pensionsgeschäften zum 31. Dezember 2024 waren wie folgt:

| Gegenpartei       | Betrag EUR |
|-------------------|------------|
| State Street Bank | 14.002.897 |

##### VERWAHRUNG ERHALTENER SICHERHEITEN:

Zum 31. Dezember 2024 wurden keine Sicherheiten von der Verwahrstelle entgegengenommen oder gehalten.

## Anhang IV (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

#### KONSOLIDIERTE TRANSAKTIONS DATEN:

Die konsolidierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (Barmittel inbegriffen), die für Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2024 gestellt(erhalten) wurden, stellten sich wie folgt dar:

|                          | Art der Sicherheit | Betrag US\$* | Qualität** | Laufzeit (Sicherheiten)*** | Währung von Sicherheiten | Gründungsland der Gegenpartei**** | Abwicklung und Clearing |
|--------------------------|--------------------|--------------|------------|----------------------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------|
| <b>Pensionsgeschäfte</b> |                    |              |            |                            |                          |                                   |                         |
| State Street Bank        | Staatsanleihen     | 14.790.076   | AA+        | > 1 Jahr                   | USD                      | USA                               | OTC                     |

\* Barsicherheiten können eine Kombination aus Swap-Instrumenten umfassen, da ein Teil der Sicherheiten sich auf nicht unter den Geltungsbereich der SFTR fallende Swap-Vereinbarungen bezieht.

\*\* Für Baranlagen oder Verbindlichkeiten gibt es kein Kreditrating. Aufgrund ihrer höchst liquiden Natur gelten auf US-Dollar lautende Barmittel als von höchster Qualität.

\*\*\* Aufgeteilt in 7 Fälligkeitssegmente (< 1 Tag, 1 Tag bis zu 1 Woche, 1 Woche bis zu 1 Monat, 1 Monat bis zu 3 Monaten, 3 Monate bis zu 1 Jahr, > 1 Jahr, offene Laufzeit). Barsicherheiten haben keine Laufzeit.

\*\*\*\* Das Land entspricht der Adresse der aktuellen Gegenpartei.

Die Laufzeiten der Positionen in Pensionsgeschäften zum 31. Dezember 2024 lagen zwischen 1 Tag und 1 Woche.

#### VERWAHRUNG GESTELLTER SICHERHEITEN:

Der Anteil der Sicherheiten, die zum 31. Dezember 2024 auf getrennten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten wurden, war wie folgt:

|                  | %     |
|------------------|-------|
| Getrennte Konten | 0 %   |
| Gepoolte Konten  | 0 %   |
| Sonstiges        | 100 % |
|                  | 100 % |

#### ERTRAG/KOSTEN:

Bei Pensionsgeschäften sind Transaktionskosten, falls zutreffend, nicht separat identifizierbar. Bei diesen Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und sind Teil der Bruttoanlageperformance der einzelnen Portfolios. Renditen werden als realisierte Gewinne/Verluste und die Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus den Pensionsgeschäften während der Berichtsperiode identifiziert.

## Anhang IV (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### Emerging Market Debt - Hard Currency

##### ALLGEMEINE DATEN:

Vermögenswerte in Pensionsgeschäften beliefen sich zum 31. Dezember 2024 auf:

| Art von Vermögenswert              | Betrag US\$ | Anteil am NIW (in %) |
|------------------------------------|-------------|----------------------|
| Pensionsgeschäfte - Vermögenswerte | 60.000.000  | 2,22                 |

##### DATEN ZUR WIEDERVERWENDUNG VON SICHERHEITEN:

Die Barsicherheiten gehen auf dem Verwahrkonto für das Portfolio ein und werden deshalb nicht speziell nachverfolgt, um eine Wiederverwendung zu ermitteln. Deshalb können wiederverwendete Barsicherheiten nicht angemessen geprüft werden.

##### KONZENTRIERTE DATEN:

Zum 31. Dezember 2024 hat das Portfolio keine Wertpapiere als Sicherheiten für Pensionsgeschäfte erhalten.

Die Gegenparteien von Pensionsgeschäften zum 31. Dezember 2024 waren wie folgt:

| Gegenpartei       | Betrag US\$ |
|-------------------|-------------|
| State Street Bank | 60.000.000  |

##### VERWAHRUNG ERHALTENER SICHERHEITEN:

Zum 31. Dezember 2024 wurden keine Sicherheiten von der Verwahrstelle entgegengenommen oder gehalten.

## Anhang IV (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

#### KONSOLIDIERTE TRANSAKTIONS DATEN:

Die konsolidierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (Barmittel inbegriffen), die für Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2024 gestellt(erhalten) wurden, stellten sich wie folgt dar:

|                   | Art der Sicherheit | Betrag US\$* | Qualität** | Laufzeit (Sicherheiten)*** | Währung von Sicherheiten | Gründungsland der Gegenpartei**** | Abwicklung und Clearing |
|-------------------|--------------------|--------------|------------|----------------------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------|
| Pensionsgeschäfte |                    |              |            |                            |                          |                                   |                         |
| State Street Bank | Staatsanleihen     | 61.200.145   | AA+        | > 1 Jahr                   | USD                      | USA                               | OTC                     |

\* Barsicherheiten können eine Kombination aus Swap-Instrumenten umfassen, da ein Teil der Sicherheiten sich auf nicht unter den Geltungsbereich der SFTR fallende Swap-Vereinbarungen bezieht.

\*\* Für Baranlagen oder Verbindlichkeiten gibt es kein Kreditrating. Aufgrund ihrer höchst liquiden Natur gelten auf US-Dollar lautende Barmittel als von höchster Qualität.

\*\*\* Aufgeteilt in 7 Fälligkeitssegmente (< 1 Tag, 1 Tag bis zu 1 Woche, 1 Woche bis zu 1 Monat, 1 Monat bis zu 3 Monaten, 3 Monate bis zu 1 Jahr, > 1 Jahr, offene Laufzeit). Barsicherheiten haben keine Laufzeit.

\*\*\*\* Das Land entspricht der Adresse der aktuellen Gegenpartei.

Die Laufzeiten der Positionen in Pensionsgeschäften zum 31. Dezember 2024 lagen zwischen 1 Tag und 1 Woche.

#### VERWAHRUNG GESTELLTER SICHERHEITEN:

Der Anteil der Sicherheiten, die zum 31. Dezember 2024 auf getrennten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten wurden, war wie folgt:

|                  | %     |
|------------------|-------|
| Getrennte Konten | 0 %   |
| Gepoolte Konten  | 0 %   |
| Sonstiges        | 100 % |
|                  | 100 % |

#### ERTRAG/KOSTEN:

Bei Pensionsgeschäften sind Transaktionskosten, falls zutreffend, nicht separat identifizierbar. Bei diesen Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und sind Teil der Bruttoanlageperformance der einzelnen Portfolios. Renditen werden als realisierte Gewinne/Verluste und die Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus den Pensionsgeschäften während der Berichtsperiode identifiziert.

## Anhang IV (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### Event Driven

#### ALLGEMEINE DATEN:

Vermögenswerte von Total Return Swaps beliefen sich zum 31. Dezember 2024 auf:

| Art von Vermögenswert                  | Betrag US\$ | Anteil am NIW (in %) |
|--|-------------|----------------------|
| Total Return Swaps - Vermögenswerte    | 139.204     | 0,04                 |
| Total Return Swaps - Verbindlichkeiten | 527.124     | 0,18                 |

#### DATEN ZUR WIEDERVERWENDUNG VON SICHERHEITEN:

Die Barsicherheiten gehen auf dem Verwahrkonto für das Portfolio ein und werden deshalb nicht speziell nachverfolgt, um eine Wiederverwendung zu ermitteln. Deshalb können wiederverwendete Barsicherheiten nicht angemessen geprüft werden.

#### KONZENTRIERTE DATEN:

Zum 31. Dezember 2024 hat das Portfolio keine Wertpapiere als Sicherheiten für die Total Return Swaps erhalten.

Die Gegenparteien von allen Total Return Swaps zum 31. Dezember 2024 waren wie folgt:

| Gegenpartei    | Betrag US\$ |
|----------------|-------------|
| Morgan Stanley | 666.328     |

#### VERWAHRUNG ERHALTENER SICHERHEITEN:

Zum 31. Dezember 2024 wurden keine Sicherheiten von der Verwahrstelle entgegengenommen oder gehalten.

#### KONSOLIDIERTE TRANSAKTIONS DATEN:

Zum 31. Dezember 2024 gab es keine Sicherheitenpositionen (Barmittel inbegriffen), die in Bezug auf alle Total Return Swaps gestellt oder erhalten wurden.

Die Laufzeiten der Positionen in Total Return Swaps zum 31. Dezember 2024 lag über 1 Jahr.

## Anhang IV (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### Event Driven (Fortsetzung)

#### VERWAHRUNG GESTELLTER SICHERHEITEN:

Zum 31. Dezember 2024 wurden keine Sicherheiten auf getrennten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten.

#### ERTRAG/KOSTEN:

Bei Total Return Swaps sind Transaktionskosten, falls zutreffend, nicht separat identifizierbar. Bei diesen Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und sind Teil der Bruttoanlageperformance der einzelnen Portfolios. Renditen werden als realisierte Gewinne/Verluste und die Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus den Swap-Kontrakten während der Berichtsperiode identifiziert.

#### Global High Yield Engagement

#### ALLGEMEINE DATEN:

Vermögenswerte in Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften beliefen sich zum 31. Dezember 2024 auf:

| Art von Vermögenswert                            | Betrag US\$ | Anteil am NIW (in %) |
|--|-------------|----------------------|
| Pensionsgeschäfte - Vermögenswerte               | 15.500.000  | 2,53                 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte - Verbindlichkeiten | 999.796     | 0,16                 |

#### DATEN ZUR WIEDERVERWENDUNG VON SICHERHEITEN:

Die Barsicherheiten gehen auf dem Verwahrkonto für das Portfolio ein und werden deshalb nicht speziell nachverfolgt, um eine Wiederverwendung zu ermitteln. Deshalb können wiederverwendete Barsicherheiten nicht angemessen geprüft werden.

#### KONZENTRIERTE DATEN:

Zum 31. Dezember 2024 hat das Portfolio keine Wertpapiere als Sicherheiten für die Pensionsgeschäfte/umgekehrten Pensionsgeschäfte erhalten.

Die Gegenparteien von allen Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften zum 31. Dezember 2024 waren wie folgt:

| Gegenpartei       | Betrag US\$ |
|-------------------|-------------|
| BofA Securities   | 999.796     |
| State Street Bank | 15.500.000  |

## Anhang IV (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### Global High Yield Engagement (Fortsetzung)

#### VERWAHRUNG ERHALTENER SICHERHEITEN:

Zum 31. Dezember 2024 werden alle erhaltenen Sicherheiten bei der Verwahrstelle, Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited, verwahrt.

#### KONSOLIDIERTE TRANSAKTIONS DATEN:

Die konsolidierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (Barmittel inbegriffen), die für Pensionsgeschäfte/umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2024 gestellt/(erhalten) wurden, stellten sich wie folgt dar:

|                                     | Art der Sicherheit   | Betrag US\$* | Qualität** | Laufzeit (Sicherheiten)*** | Währung von Sicherheiten | Gründungsland der Gegenpartei**** | Abwicklung und Clearing |
|-------------------------------------|----------------------|--------------|------------|----------------------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------|
| <b>Pensionsgeschäfte</b>            |                      |              |            |                            |                          |                                   |                         |
| State Street Bank                   | Staatsanleihen       | 15.810.076   | AA+        | > 1 Jahr                   | USD                      | USA                               | OTC                     |
| <b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b> |                      |              |            |                            |                          |                                   |                         |
| BofA Securities                     | Unternehmensanleihen | (1.333.061)  | B+         | > 1 Jahr                   | USD                      | USA                               | OTC                     |

\* Barsicherheiten können eine Kombination aus Swap-Instrumenten umfassen, da ein Teil der Sicherheiten sich auf nicht unter den Geltungsbereich der SFTR fallende Swap-Vereinbarungen bezieht.

\*\* Für Baranlagen oder Verbindlichkeiten gibt es kein Kreditrating. Aufgrund ihrer höchst liquiden Natur gelten auf US-Dollar lautende Barmittel als von höchster Qualität.

\*\*\* Aufgeteilt in 7 Fälligkeitssegmente (< 1 Tag, 1 Tag bis zu 1 Woche, 1 Woche bis zu 1 Monat, 1 Monat bis zu 3 Monaten, 3 Monate bis zu 1 Jahr, > 1 Jahr, offene Laufzeit). Barsicherheiten haben keine Laufzeit.

\*\*\*\* Das Land entspricht der Adresse der aktuellen Gegenpartei.

Die Laufzeiten der Positionen in Pensionsgeschäften zum 31. Dezember 2024 lagen zwischen 1 Tag und 1 Woche.

Die Laufzeiten der Positionen der umgekehrten Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2024 waren offen.

## Anhang IV (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### Global High Yield Engagement (Fortsetzung)

#### VERWAHRUNG GESTELLTER SICHERHEITEN:

Der Anteil der Sicherheiten, die zum 31. Dezember 2024 auf getrennten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten wurden, war wie folgt:

|                  | %     |
|------------------|-------|
| Getrennte Konten | 0 %   |
| Gepoolte Konten  | 0 %   |
| Sonstiges        | 100 % |
|                  | 100 % |

#### ERTRAG/KOSTEN:

Bei Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften sind Transaktionskosten, falls zutreffend, nicht separat identifizierbar. Bei diesen Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und sind Teil der Bruttoanlageperformance der einzelnen Portfolios. Renditen werden als realisierte Gewinne/Verluste und die Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus den Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften während der Berichtsperiode identifiziert.

#### High Yield Bond

#### ALLGEMEINE DATEN:

Vermögenswerte in Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften beliefen sich zum 31. Dezember 2024 auf:

| Art von Vermögenswert                            | Betrag US\$ | Anteil am NIW (in %) |
|--|-------------|----------------------|
| Pensionsgeschäfte - Vermögenswerte               | 66.000.000  | 3,48                 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte - Verbindlichkeiten | 3.063.764   | 0,16                 |

#### DATEN ZUR WIEDERVERWENDUNG VON SICHERHEITEN:

Die Barsicherheiten gehen auf dem Verwahrkonto für das Portfolio ein und werden deshalb nicht speziell nachverfolgt, um eine Wiederverwendung zu ermitteln. Deshalb können wiederverwendete Barsicherheiten nicht angemessen geprüft werden.

## Anhang IV (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### High Yield Bond (Fortsetzung)

##### KONZENTRIERTE DATEN:

Zum 31. Dezember 2024 hat das Portfolio keine Wertpapiere als Sicherheiten für die Pensionsgeschäfte/umgekehrten Pensionsgeschäfte erhalten.

Die Gegenparteien von allen Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften zum 31. Dezember 2024 waren wie folgt:

| Gegenpartei       | Betrag US\$ |
|-------------------|-------------|
| BofA Securities   | 3.063.764   |
| State Street Bank | 66.000.000  |

##### VERWAHRUNG ERHALTENER SICHERHEITEN:

Zum 31. Dezember 2024 werden alle erhaltenen Sicherheiten bei der Verwahrstelle, Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited, verwahrt.

##### KONSOLIDIERTE TRANSAKTIONS DATEN:

Die konsolidierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (Barmittel inbegriffen), die für Pensionsgeschäfte/umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2024 gestellt/(erhalten) wurden, stellten sich wie folgt dar:

|                                     | Art der Sicherheit   | Betrag US\$* | Qualität** | Laufzeit (Sicherheiten)*** | Währung von Sicherheiten | Gründungsland der Gegenpartei**** | Abwicklung und Clearing |
|-------------------------------------|----------------------|--------------|------------|----------------------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------|
| <b>Pensionsgeschäfte</b>            |                      |              |            |                            |                          |                                   |                         |
| State Street Bank                   | Staatsanleihen       | 67.320.139   | AA+        | > 1 Jahr                   | USD                      | USA                               | OTC                     |
| <b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b> |                      |              |            |                            |                          |                                   |                         |
| BofA Securities                     | Unternehmensanleihen | (2.850.768)  | B-         | > 1 Jahr                   | USD                      | USA                               | OTC                     |

\* Barsicherheiten können eine Kombination aus Swap-Instrumenten umfassen, da ein Teil der Sicherheiten sich auf nicht unter den Geltungsbereich der SFTR fallende Swap-Vereinbarungen bezieht.

\*\* Für Baranlagen oder Verbindlichkeiten gibt es kein Kreditrating. Aufgrund ihrer höchst liquiden Natur gelten auf US-Dollar lautende Barmittel als von höchster Qualität.

\*\*\* Aufgeteilt in 7 Fälligkeitssegmente (< 1 Tag, 1 Tag bis zu 1 Woche, 1 Woche bis zu 1 Monat, 1 Monat bis zu 3 Monaten, 3 Monate bis zu 1 Jahr, > 1 Jahr, offene Laufzeit). Barsicherheiten haben keine Laufzeit.

\*\*\*\* Das Land entspricht der Adresse der aktuellen Gegenpartei.

Die Laufzeiten der Positionen in Pensionsgeschäften zum 31. Dezember 2024 lagen zwischen 1 Tag und 1 Woche.

Die Laufzeiten der Positionen der umgekehrten Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2024 waren offen.

## Anhang IV (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### High Yield Bond (Fortsetzung)

##### VERWAHRUNG GESTELLTER SICHERHEITEN:

Der Anteil der Sicherheiten, die zum 31. Dezember 2024 auf getrennten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten wurden, war wie folgt:

|                  | %     |
|------------------|-------|
| Getrennte Konten | 0 %   |
| Gepoolte Konten  | 0 %   |
| Sonstiges        | 100 % |
|                  | 100 % |

##### ERTRAG/KOSTEN:

Bei Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften sind Transaktionskosten, falls zutreffend, nicht separat identifizierbar. Bei diesen Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und sind Teil der Bruttoanlageperformance der einzelnen Portfolios. Renditen werden als realisierte Gewinne/Verluste und die Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus den Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften während der Berichtsperiode identifiziert.

#### Short Duration Emerging Market Debt

##### ALLGEMEINE DATEN:

Vermögenswerte in Pensionsgeschäften beliefen sich zum 31. Dezember 2024 auf:

| Art von Vermögenswert              | Betrag US\$ | Anteil am NIW (in %) |
|------------------------------------|-------------|----------------------|
| Pensionsgeschäfte - Vermögenswerte | 9.000.000   | 0,24                 |

##### DATEN ZUR WIEDERVERWENDUNG VON SICHERHEITEN:

Die Barsicherheiten gehen auf dem Verwahrkonto für das Portfolio ein und werden deshalb nicht speziell nachverfolgt, um eine Wiederverwendung zu ermitteln. Deshalb können wiederverwendete Barsicherheiten nicht angemessen geprüft werden.

## Anhang IV (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

##### KONZENTRIERTE DATEN:

Zum 31. Dezember 2024 hat das Portfolio keine Wertpapiere als Sicherheiten für Pensionsgeschäfte erhalten.

Die Gegenparteien von Pensionsgeschäften zum 31. Dezember 2024 waren wie folgt:

| Gegenpartei       | Betrag US\$ |
|-------------------|-------------|
| State Street Bank | 9.000.000   |

##### VERWAHRUNG ERHALTENER SICHERHEITEN:

Zum 31. Dezember 2024 wurden keine Sicherheiten von der Verwahrstelle entgegengenommen oder gehalten.

##### KONSOLIDIERTE TRANSAKTIONS DATEN:

Die konsolidierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (Barmittel inbegriffen), die für Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2024 gestellt/(erhalten) wurden, stellten sich wie folgt dar:

|                          | Art der Sicherheit | Betrag US\$* | Qualität** | Laufzeit (Sicherheiten)*** | Währung von Sicherheiten | Gründungsland der Gegenpartei**** | Abwicklung und Clearing |
|--------------------------|--------------------|--------------|------------|----------------------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------|
| <b>Pensionsgeschäfte</b> |                    |              |            |                            |                          |                                   |                         |
| State Street Bank        | Staatsanleihen     | 9.180.010    | AA+        | > 1 Jahr                   | USD                      | USA                               | OTC                     |

\* Barsicherheiten können eine Kombination aus Swap-Instrumenten umfassen, da ein Teil der Sicherheiten sich auf nicht unter den Geltungsbereich der SFTR fallende Swap-Vereinbarungen bezieht.

\*\* Für Baranlagen oder Verbindlichkeiten gibt es kein Kreditrating. Aufgrund ihrer höchst liquiden Natur gelten auf US-Dollar lautende Barmittel als von höchster Qualität.

\*\*\* Aufgeteilt in 7 Fälligkeitssegmente (< 1 Tag, 1 Tag bis zu 1 Woche, 1 Woche bis zu 1 Monat, 1 Monat bis zu 3 Monaten, 3 Monate bis zu 1 Jahr, > 1 Jahr, offene Laufzeit). Barsicherheiten haben keine Laufzeit.

\*\*\*\* Das Land entspricht der Adresse der aktuellen Gegenpartei.

Die Laufzeiten der Positionen in Pensionsgeschäften zum 31. Dezember 2024 lagen zwischen 1 Tag und 1 Woche.

## Anhang IV (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

##### VERWAHRUNG GESTELLTER SICHERHEITEN:

Der Anteil der Sicherheiten, die zum 31. Dezember 2024 auf getrennten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten wurden, war wie folgt:

|                  | %     |
|------------------|-------|
| Getrennte Konten | 0 %   |
| Gepoolte Konten  | 0 %   |
| Sonstiges        | 100 % |
|                  | 100 % |

##### ERTRAG/KOSTEN:

Bei Pensionsgeschäften sind Transaktionskosten, falls zutreffend, nicht separat identifizierbar. Bei diesen Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und sind Teil der Bruttoanlageperformance der einzelnen Portfolios. Renditen werden als realisierte Gewinne/Verluste und die Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus den Pensionsgeschäften während der Berichtsperiode identifiziert.

#### Short Duration High Yield Engagement

##### ALLGEMEINE DATEN:

Vermögenswerte in Pensionsgeschäften beliefen sich zum 31. Dezember 2024 auf:

| Art von Vermögenswert              | Betrag US\$ | Anteil am NIW (in %) |
|------------------------------------|-------------|----------------------|
| Pensionsgeschäfte - Vermögenswerte | 16.000.000  | 2,93                 |

##### DATEN ZUR WIEDERVERWENDUNG VON SICHERHEITEN:

Die Barsicherheiten gehen auf dem Verwahrkonto für das Portfolio ein und werden deshalb nicht speziell nachverfolgt, um eine Wiederverwendung zu ermitteln. Deshalb können wiederverwendete Barsicherheiten nicht angemessen geprüft werden.

## Anhang IV (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### Short Duration High Yield Engagement (Fortsetzung)

##### KONZENTRIERTE DATEN:

Zum 31. Dezember 2024 hat das Portfolio keine Wertpapiere als Sicherheiten für Pensionsgeschäfte erhalten.

Die Gegenparteien von Pensionsgeschäften zum 31. Dezember 2024 waren wie folgt:

| Gegenpartei       | Betrag US\$ |
|-------------------|-------------|
| State Street Bank | 16.000.000  |

##### VERWAHRUNG ERHALTENER SICHERHEITEN:

Zum 31. Dezember 2024 wurden keine Sicherheiten von der Verwahrstelle entgegengenommen oder gehalten.

##### KONSOLIDIERTE TRANSAKTIONS DATEN:

Die konsolidierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (Barmittel inbegriffen), die für Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2024 gestellt/(erhalten) wurden, stellten sich wie folgt dar:

|                          | Art der Sicherheit | Betrag US\$* | Qualität** | Laufzeit (Sicherheiten)*** | Währung von Sicherheiten | Gründungsland der Gegenpartei**** | Abwicklung und Clearing |
|--------------------------|--------------------|--------------|------------|----------------------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------|
| <b>Pensionsgeschäfte</b> |                    |              |            |                            |                          |                                   |                         |
| State Street Bank        | Staatsanleihen     | 16.320.095   | AA+        | > 1 Jahr                   | USD                      | USA                               | OTC                     |

\* Barsicherheiten können eine Kombination aus Swap-Instrumenten umfassen, da ein Teil der Sicherheiten sich auf nicht unter den Geltungsbereich der SFTR fallende Swap-Vereinbarungen bezieht.

\*\* Für Baranlagen oder Verbindlichkeiten gibt es kein Kreditrating. Aufgrund ihrer höchst liquiden Natur gelten auf US-Dollar lautende Barmittel als von höchster Qualität.

\*\*\* Aufgeteilt in 7 Fälligkeitssegmente (< 1 Tag, 1 Tag bis zu 1 Woche, 1 Woche bis zu 1 Monat, 1 Monat bis zu 3 Monaten, 3 Monate bis zu 1 Jahr, > 1 Jahr, offene Laufzeit). Barsicherheiten haben keine Laufzeit.

\*\*\*\* Das Land entspricht der Adresse der aktuellen Gegenpartei.

Die Laufzeiten der Positionen in Pensionsgeschäften zum 31. Dezember 2024 lagen zwischen 1 Tag und 1 Woche.

## Anhang IV (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### Short Duration High Yield Engagement (Fortsetzung)

#### VERWAHRUNG GESTELLTER SICHERHEITEN:

Der Anteil der Sicherheiten, die zum 31. Dezember 2024 auf getrennten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten wurden, war wie folgt:

|                  | %     |
|------------------|-------|
| Getrennte Konten | 0 %   |
| Gepoolte Konten  | 0 %   |
| Sonstiges        | 100 % |
|                  | 100 % |

#### ERTRAG/KOSTEN:

Bei Pensionsgeschäften sind Transaktionskosten, falls zutreffend, nicht separat identifizierbar. Bei diesen Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und sind Teil der Bruttoanlageperformance der einzelnen Portfolios. Renditen werden als realisierte Gewinne/Verluste und die Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus den Pensionsgeschäften während der Berichtsperiode identifiziert.

#### Strategic Income

#### ALLGEMEINE DATEN:

Vermögenswerte in Pensionsgeschäften beliefen sich zum 31. Dezember 2024 auf:

| Art von Vermögenswert              | Betrag US\$ | Anteil am NIW (in %) |
|------------------------------------|-------------|----------------------|
| Pensionsgeschäfte - Vermögenswerte | 82.500.000  | 1,78                 |

#### DATEN ZUR WIEDERVERWENDUNG VON SICHERHEITEN:

Die Barsicherheiten gehen auf dem Verwahrkonto für das Portfolio ein und werden deshalb nicht speziell nachverfolgt, um eine Wiederverwendung zu ermitteln. Deshalb können wiederverwendete Barsicherheiten nicht angemessen geprüft werden.

## Anhang IV (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### Strategic Income (Fortsetzung)

##### KONZENTRIERTE DATEN:

Zum 31. Dezember 2024 hat das Portfolio keine Wertpapiere als Sicherheiten für Pensionsgeschäfte erhalten.

Die Gegenparteien von Pensionsgeschäften zum 31. Dezember 2024 waren wie folgt:

| Gegenpartei       | Betrag US\$ |
|-------------------|-------------|
| State Street Bank | 82.500.000  |

##### VERWAHRUNG ERHALTENER SICHERHEITEN:

Zum 31. Dezember 2024 wurden keine Sicherheiten von der Verwahrstelle entgegengenommen oder gehalten.

##### KONSOLIDIERTE TRANSAKTIONS DATEN:

Die konsolidierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (Barmittel inbegriffen), die für Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2024 gestellt/(erhalten) wurden, stellten sich wie folgt dar:

|                          | Art der Sicherheit | Betrag US\$* | Qualität** | Laufzeit (Sicherheiten)*** | Währung von Sicherheiten | Gründungsland der Gegenpartei**** | Abwicklung und Clearing |
|--------------------------|--------------------|--------------|------------|----------------------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------|
| <b>Pensionsgeschäfte</b> |                    |              |            |                            |                          |                                   |                         |
| State Street Bank        | Staatsanleihen     | 84.150.019   | AA+        | > 1 Jahr                   | USD                      | USA                               | OTC                     |

\* Barsicherheiten können eine Kombination aus Swap-Instrumenten umfassen, da ein Teil der Sicherheiten sich auf nicht unter den Geltungsbereich der SFTR fallende Swap-Vereinbarungen bezieht.

\*\* Für Baranlagen oder Verbindlichkeiten gibt es kein Kreditrating. Aufgrund ihrer höchst liquiden Natur gelten auf US-Dollar lautende Barmittel als von höchster Qualität.

\*\*\* Aufgeteilt in 7 Fälligkeitssegmente (< 1 Tag, 1 Tag bis zu 1 Woche, 1 Woche bis zu 1 Monat, 1 Monat bis zu 3 Monaten, 3 Monate bis zu 1 Jahr, > 1 Jahr, offene Laufzeit). Barsicherheiten haben keine Laufzeit.

\*\*\*\* Das Land entspricht der Adresse der aktuellen Gegenpartei.

Die Laufzeiten der Positionen in Pensionsgeschäften zum 31. Dezember 2024 lagen zwischen 1 Tag und 1 Woche.

## Anhang IV (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### Strategic Income (Fortsetzung)

#### VERWAHRUNG GESTELLTER SICHERHEITEN:

Der Anteil der Sicherheiten, die zum 31. Dezember 2024 auf getrennten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten wurden, war wie folgt:

|                  | %     |
|------------------|-------|
| Getrennte Konten | 0 %   |
| Gepoolte Konten  | 0 %   |
| Sonstiges        | 100 % |
|                  | 100 % |

#### ERTRAG/KOSTEN:

Bei Pensionsgeschäften sind Transaktionskosten, falls zutreffend, nicht separat identifizierbar. Bei diesen Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und sind Teil der Bruttoanlageperformance der einzelnen Portfolios. Renditen werden als realisierte Gewinne/Verluste und die Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus den Pensionsgeschäften während der Berichtsperiode identifiziert.

#### Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency

#### ALLGEMEINE DATEN:

Vermögenswerte in Pensionsgeschäften beliefen sich zum 31. Dezember 2024 auf:

| Art von Vermögenswert              | Betrag US\$ | Anteil am NIW (in %) |
|------------------------------------|-------------|----------------------|
| Pensionsgeschäfte - Vermögenswerte | 13.000.000  | 2,17                 |

#### DATEN ZUR WIEDERVERWENDUNG VON SICHERHEITEN:

Die Barsicherheiten gehen auf dem Verwahrkonto für das Portfolio ein und werden deshalb nicht speziell nachverfolgt, um eine Wiederverwendung zu ermitteln. Deshalb können wiederverwendete Barsicherheiten nicht angemessen geprüft werden.

## Anhang IV (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

##### KONZENTRIERTE DATEN:

Zum 31. Dezember 2024 hat das Portfolio keine Wertpapiere als Sicherheiten für Pensionsgeschäfte erhalten.

Die Gegenparteien von Pensionsgeschäften zum 31. Dezember 2024 waren wie folgt:

| Gegenpartei       | Betrag US\$ |
|-------------------|-------------|
| State Street Bank | 13.000.000  |

##### VERWAHRUNG ERHALTENER SICHERHEITEN:

Zum 31. Dezember 2024 wurden keine Sicherheiten von der Verwahrstelle entgegengenommen oder gehalten.

##### KONSOLIDIERTE TRANSAKTIONS DATEN:

Die konsolidierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (Barmittel inbegriffen), die für Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2024 gestellt/(erhalten) wurden, stellten sich wie folgt dar:

|                          | Art der Sicherheit | Betrag US\$* | Qualität** | Laufzeit (Sicherheiten)*** | Währung von Sicherheiten | Gründungsland der Gegenpartei**** | Abwicklung und Clearing |
|--------------------------|--------------------|--------------|------------|----------------------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------|
| <b>Pensionsgeschäfte</b> |                    |              |            |                            |                          |                                   |                         |
| State Street Bank        | Staatsanleihen     | 13.260.127   | AA+        | > 1 Jahr                   | USD                      | USA                               | OTC                     |

Barsicherheiten können eine Kombination aus Swap-Instrumenten umfassen, da ein Teil der Sicherheiten sich auf nicht unter den Geltungsbereich der SFTR fallende Swap-Vereinbarungen bezieht.

\*\* Für Baranlagen oder Verbindlichkeiten gibt es kein Kreditrating. Aufgrund ihrer höchst liquiden Natur gelten auf US-Dollar lautende Barmittel als von höchster Qualität.

\*\*\* Aufgeteilt in 7 Fälligkeitssegmente (< 1 Tag, 1 Tag bis zu 1 Woche, 1 Woche bis zu 1 Monat, 1 Monat bis zu 3 Monaten, 3 Monate bis zu 1 Jahr, > 1 Jahr, offene Laufzeit). Barsicherheiten haben keine Laufzeit.

\*\*\*\* Das Land entspricht der Adresse der aktuellen Gegenpartei.

Die Laufzeiten der Positionen in Pensionsgeschäften zum 31. Dezember 2024 lagen zwischen 1 Tag und 1 Woche.

## Anhang IV (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

##### VERWAHRUNG GESTELLTER SICHERHEITEN:

Der Anteil der Sicherheiten, die zum 31. Dezember 2024 auf getrennten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten wurden, war wie folgt:

|                  | %     |
|------------------|-------|
| Getrennte Konten | 0 %   |
| Gepoolte Konten  | 0 %   |
| Sonstiges        | 100 % |
|                  | 100 % |

##### ERTRAG/KOSTEN:

Bei Pensionsgeschäften sind Transaktionskosten, falls zutreffend, nicht separat identifizierbar. Bei diesen Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und sind Teil der Bruttoanlageperformance der einzelnen Portfolios. Renditen werden als realisierte Gewinne/Verluste und die Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus den Pensionsgeschäften während der Berichtsperiode identifiziert.

#### Tactical Macro

##### ALLGEMEINE DATEN:

Vermögenswerte von Total Return Swaps beliefen sich zum 31. Dezember 2024 auf:

| Art von Vermögenswert                  | Betrag US\$ | Anteil am NIW (in %) |
|--|-------------|----------------------|
| Total Return Swaps - Vermögenswerte    | 21.388      | 0,06                 |
| Total Return Swaps - Verbindlichkeiten | 39.190      | 0,11                 |

##### DATEN ZUR WIEDERVERWENDUNG VON SICHERHEITEN:

Die Barsicherheiten gehen auf dem Verwahrkonto für das Portfolio ein und werden deshalb nicht speziell nachverfolgt, um eine Wiederverwendung zu ermitteln. Deshalb können wiederverwendete Barsicherheiten nicht angemessen geprüft werden.

## Anhang IV (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### Tactical Macro (Fortsetzung)

##### KONZENTRIERTE DATEN:

Zum 31. Dezember 2024 hat das Portfolio keine Wertpapiere als Sicherheiten für die Total Return Swaps erhalten.

Die Gegenparteien von allen Total Return Swaps zum 31. Dezember 2024 waren wie folgt:

| Gegenpartei                 | Betrag US\$ |
|-----------------------------|-------------|
| Goldman Sachs International | 60.578      |

##### VERWAHRUNG ERHALTENER SICHERHEITEN:

Zum 31. Dezember 2024 wurden keine Sicherheiten von der Verwahrstelle entgegengenommen oder gehalten.

##### KONSOLIDIERTE TRANSAKTIONS DATEN:

Zum 31. Dezember 2024 gab es keine Sicherheitenpositionen (Barmittel inbegriffen), die in Bezug auf alle Total Return Swaps gestellt oder erhalten wurden.

Die Laufzeiten der Positionen in Total Return Swaps zum 31. Dezember 2024 lagen zwischen 3 Monaten und 1 Jahr.

##### VERWAHRUNG GESTELLTER SICHERHEITEN:

Zum 31. Dezember 2024 wurden keine Sicherheiten auf getrennten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten.

##### ERTRAG/KOSTEN:

Bei Total Return Swaps sind Transaktionskosten, falls zutreffend, nicht separat identifizierbar. Bei diesen Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und sind Teil der Bruttoanlageperformance der einzelnen Portfolios. Renditen werden als realisierte Gewinne/Verluste und die Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus den Swap-Kontrakten während der Berichtsperiode identifiziert.

## Anhang IV (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### Uncorrelated Strategies

##### ALLGEMEINE DATEN:

Vermögenswerte von Total Return Swaps beliefen sich zum 31. Dezember 2024 auf:

| Art von Vermögenswert                  | Betrag US\$ | Anteil am NIW (in %) |
|--|-------------|----------------------|
| Total Return Swaps - Vermögenswerte    | 2.665.711   | 0,33                 |
| Total Return Swaps - Verbindlichkeiten | 1.197.807   | 0,15                 |

##### DATEN ZUR WIEDERVERWENDUNG VON SICHERHEITEN:

Die Barsicherheiten gehen auf dem Verwahrkonto für das Portfolio ein und werden deshalb nicht speziell nachverfolgt, um eine Wiederverwendung zu ermitteln. Deshalb können wiederverwendete Barsicherheiten nicht angemessen geprüft werden.

##### KONZENTRIERTE DATEN:

Zum 31. Dezember 2024 hat das Portfolio keine Wertpapiere als Sicherheiten für die Total Return Swaps erhalten.

Die Gegenparteien von allen Total Return Swaps zum 31. Dezember 2024 waren wie folgt:

| Gegenpartei                 | Betrag US\$ |
|-----------------------------|-------------|
| Goldman Sachs International | 973.671     |
| Morgan Stanley              | 2.010.333   |
| Société Générale            | 879.514     |

##### VERWAHRUNG ERHALTENER SICHERHEITEN:

Zum 31. Dezember 2024 werden alle erhaltenen Sicherheiten bei der Verwahrstelle, Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited, verwahrt.

## Anhang IV (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

#### KONSOLIDIERTE TRANSAKTIONS DATEN:

Die konsolidierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (Barmittel inbegriffen), die für alle Total Return Swaps zum 31. Dezember 2024 gestellt oder erhalten wurden, stellten sich wie folgt dar:

|                                   | Art der Sicherheit | Betrag US\$* | Qualität** | Laufzeit (Sicherheiten)*** | Währung von Sicherheiten | Gründungsland der Gegenpartei**** | Abwicklung und Clearing |
|-----------------------------------|--------------------|--------------|------------|----------------------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------|
| <b>Total Return Swaps</b>         |                    |              |            |                            |                          |                                   |                         |
| Goldman Sachs International       | Barsicherheiten    | (3.321.310)  | k.A.       | k.A.                       | USD                      | Großbritannien                    | OTC                     |
| Morgan Stanley & Co International | Barsicherheiten    | 2.260.000    | k.A.       | k.A.                       | USD                      | USA                               | OTC                     |
| Société Générale                  | Barsicherheiten    | 20.200.000   | k.A.       | k.A.                       | USD                      | Frankreich                        | OTC                     |

\* Barsicherheiten können eine Kombination aus Swap-Instrumenten umfassen, da ein Teil der Sicherheiten sich auf nicht unter den Geltungsbereich der SFTR fallende Swap-Vereinbarungen bezieht.

\*\* Für Baranlagen oder Verbindlichkeiten gibt es kein Kreditrating. Aufgrund ihrer höchst liquiden Natur gelten auf US-Dollar lautende Barmittel als von höchster Qualität.

\*\*\* Aufgeteilt in 7 Fälligkeitssegmente (< 1 Tag, 1 Tag bis zu 1 Woche, 1 Woche bis zu 1 Monat, 1 Monat bis zu 3 Monaten, 3 Monate bis zu 1 Jahr, > 1 Jahr, offene Laufzeit). Barsicherheiten haben keine Laufzeit.

\*\*\*\* Das Land entspricht der Adresse der aktuellen Gegenpartei.

Die Laufzeiten von Positionen in Total Return Swaps zum 31. Dezember 2024 stellten sich wie folgt dar:

| Fälligkeit                             | Betrag US\$ |                      |                        |                          |                        |           | offene Laufzeit |
|--|-------------|----------------------|------------------------|--------------------------|------------------------|-----------|-----------------|
|  | < 1 Tag     | 1 Tag bis zu 1 Woche | 1 Woche bis zu 1 Monat | 1 Monat bis zu 3 Monaten | 3 Monate bis zu 1 Jahr | > 1 Jahr  |                 |
| Total Return Swaps - Vermögenswerte    | -           | -                    | 6.428                  | 1.391.280                | 169.686                | 1.098.317 | -               |
| Total Return Swaps - Verbindlichkeiten | -           | -                    | 2.679                  | 350.443                  | 17.501                 | 827.184   | -               |

## Anhang IV (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

#### VERWAHRUNG GESTELLTER SICHERHEITEN:

Der Anteil der Sicherheiten, die zum 31. Dezember 2024 auf getrennten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten wurden, war wie folgt:

|                  | %     |
|------------------|-------|
| Getrennte Konten | 0 %   |
| Gepoolte Konten  | 0 %   |
| Sonstiges        | 100 % |
|                  | 100 % |

#### ERTRAG/KOSTEN:

Bei Total Return Swaps sind Transaktionskosten, falls zutreffend, nicht separat identifizierbar. Bei diesen Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und sind Teil der Bruttoanlageperformance der einzelnen Portfolios. Renditen werden als realisierte Gewinne/Verluste und die Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus den Swap-Kontrakten während der Berichtsperiode identifiziert.

#### US Long Short Equity

#### ALLGEMEINE DATEN:

Vermögenswerte von Total Return Swaps beliefen sich zum 31. Dezember 2024 auf:

| Art von Vermögenswert                  | Betrag US\$ | Anteil am NIW (in %) |
|--|-------------|----------------------|
| Total Return Swaps - Vermögenswerte    | 9.764       | 0,00                 |
| Total Return Swaps - Verbindlichkeiten | 882.248     | 0,39                 |

#### DATEN ZUR WIEDERVERWENDUNG VON SICHERHEITEN:

Die Barsicherheiten gehen auf dem Verwahrkonto für das Portfolio ein und werden deshalb nicht speziell nachverfolgt, um eine Wiederverwendung zu ermitteln. Deshalb können wiederverwendete Barsicherheiten nicht angemessen geprüft werden.

## Anhang IV (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### US Long Short Equity (Fortsetzung)

##### KONZENTRIERTE DATEN:

Zum 31. Dezember 2024 hat das Portfolio keine Wertpapiere als Sicherheiten für die Total Return Swaps erhalten.

Die Gegenparteien von allen Total Return Swaps zum 31. Dezember 2024 waren wie folgt:

| Gegenpartei         | Betrag US\$ |
|---------------------|-------------|
| JPMorgan Chase Bank | 892.012     |

##### VERWAHRUNG ERHALTENER SICHERHEITEN:

Zum 31. Dezember 2024 wurden keine Sicherheiten von der Verwahrstelle entgegengenommen oder gehalten.

##### KONSOLIDIERTE TRANSAKTIONS DATEN:

Die konsolidierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (Barmittel inbegriffen), die für alle Total Return Swaps zum 31. Dezember 2024 gestellt oder erhalten wurden, stellten sich wie folgt dar:

|                           | Art der Sicherheit | Betrag US\$* | Qualität** | Laufzeit (Sicherheiten)*** | Währung von Sicherheiten | Gründungsland der Gegenpartei**** | Abwicklung und Clearing |
|---------------------------|--------------------|--------------|------------|----------------------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------|
| <b>Total Return Swaps</b> |                    |              |            |                            |                          |                                   |                         |
| JP Morgan Chase Bank      | Barsicherheiten    | 3.450.000    | k.A.       | k.A.                       | USD                      | USA                               | OTC                     |

\* Barsicherheiten können eine Kombination aus Swap-Instrumenten umfassen, da ein Teil der Sicherheiten sich auf nicht unter den Geltungsbereich der SFTR fallende Swap-Vereinbarungen bezieht.

\*\* Für Baranlagen oder Verbindlichkeiten gibt es kein Kreditrating. Aufgrund ihrer höchst liquiden Natur gelten auf US-Dollar lautende Barmittel als von höchster Qualität.

\*\*\* Aufgeteilt in 7 Fälligkeitssegmente (< 1 Tag, 1 Tag bis zu 1 Woche, 1 Woche bis zu 1 Monat, 1 Monat bis zu 3 Monaten, 3 Monate bis zu 1 Jahr, > 1 Jahr, offene Laufzeit). Barsicherheiten haben keine Laufzeit.

\*\*\*\* Das Land entspricht der Adresse der aktuellen Gegenpartei.

Die Laufzeiten von Positionen in Total Return Swaps zum 31. Dezember 2024 stellten sich wie folgt dar:

| Fälligkeit                             | Betrag US\$ |                      |                        |                          |                        |          | offene Laufzeit |
|--|-------------|----------------------|------------------------|--------------------------|------------------------|----------|-----------------|
|  | < 1 Tag     | 1 Tag bis zu 1 Woche | 1 Woche bis zu 1 Monat | 1 Monat bis zu 3 Monaten | 3 Monate bis zu 1 Jahr | > 1 Jahr |                 |
| Total Return Swaps - Vermögenswerte    | -           | -                    | -                      | -                        | 9.764                  | -        | -               |
| Total Return Swaps - Verbindlichkeiten | -           | -                    | -                      | 161.766                  | 720.482                | -        | -               |

## Anhang IV (Fortsetzung)

### VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

#### US Long Short Equity (Fortsetzung)

#### VERWAHRUNG GESTELLTER SICHERHEITEN:

Der Anteil der Sicherheiten, die zum 31. Dezember 2024 auf getrennten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten wurden, war wie folgt:

|                  | %     |
|------------------|-------|
| Getrennte Konten | 0 %   |
| Gepoolte Konten  | 0 %   |
| Sonstiges        | 100 % |
|                  | 100 % |

#### ERTRAG/KOSTEN:

Bei Total Return Swaps sind Transaktionskosten, falls zutreffend, nicht separat identifizierbar. Bei diesen Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und sind Teil der Bruttoanlageperformance der einzelnen Portfolios. Renditen werden als realisierte Gewinne/Verluste und die Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus den Swap-Kontrakten während der Berichtsperiode identifiziert.

Zum 31. Dezember 2024 und zum 31. Dezember 2023 war keines der Portfolios an Wertpapierleihgeschäften beteiligt.

## Anhang V

### ANGABEN ZUR VERGÜTUNG (UNGEPRÜFT)

Die Richtlinie der Europäischen Union 2014/91/EU (die „OGAW-V Richtlinie“) trat am 18. März 2016 in Kraft. Der Fonds hat eine Vergütungspolitik eingeführt, um den Anforderungen der OGAW-V-Richtlinie und der ESMA-Leitlinien für solide Vergütungspolitiken gemäß der OGAW-V-Richtlinie in einer Form und in dem Umfang zu entsprechen, wie es der Größe des Fonds, seiner internen Organisation und der Art, dem Gegenstand und der Komplexität seiner Aktivitäten angemessen ist.

Die Vergütungspolitik des Fonds gilt für identifizierte Mitarbeiter, deren berufliche Tätigkeiten einen wesentlichen Einfluss auf das Risikoprofil des Fonds haben.

Zum 31. Dezember 2024 hatte der Fonds keine Mitarbeiter, und die Vergütungspolitik des Fonds gilt nur für Mitglieder des Direktoriums des Fonds, die den Fonds verwalten und kontrollieren. Nähere Angaben zu den Honoraren der Direktoren finden sich in Anmerkung 7.

Die Direktoren ernannten NBAMIL zum Manager, um die laufenden Geschäfte des Fonds zu führen. NBAMIL hat eine Vergütungspolitik im Einklang mit der OGAW-V-Richtlinie angenommen. Nähere Angaben zu den in den zum 31. Dezember 2024 und 31. Dezember 2023 von NBAMIL vereinnahmten Gebühren finden sich in Anmerkung 10.

## Anhang VI

### GLOSSAR DER INDIZES (UNGEPRÜFT)^

|   |   |
|---|---|
| <b>Bloomberg Commodity Index (Total Return, USD)</b>  | Der Index ist eine hoch liquide, diversifizierte Benchmark für Rohstoffanlagen, die die Renditen des Gesamtindex, des Bloomberg Commodity Index <sup>SM</sup> , und die Renditen auf in US-Treasury-Bills investierte Barsicherheiten kombiniert, um eine vollständig abgesicherte Anlage im Bloomberg Commodity Index zu repräsentieren. |
| <b>Bloomberg Euro Aggregate Bond Index (Total Return, abgesichert, EUR)</b>                               | Der Index misst die Wertentwicklung auf Euro lautender festverzinslicher Anleihen.  |
| <b>Bloomberg Euro Aggregate Bond 1-3 Year Index (Total Return, EUR)</b>                                   | Der Index misst die Wertentwicklung auf Euro lautender festverzinslicher Anleihen mit einer Laufzeit von 1 bis 3 Jahren.  |
| <b>Bloomberg Global Aggregate Corporate Index (Total Return, abgesichert, USD)</b>                        | Der Index misst die Märkte für globale festverzinsliche Unternehmensanleihen mit Investment-Grade-Rating.   |
| <b>Bloomberg Global Aggregate Index (Total Return, abgesichert, USD)</b>                                  | Der Index misst die Märkte für globale festverzinsliche Schuldtitel mit Investment-Grade-Rating.  |
| <b>Bloomberg Global Aggregate Index (Total Return, nicht währungsgesichert, USD)</b>                      | Der Index misst die Märkte für globale festverzinsliche Schuldtitel mit Investment-Grade-Rating.  |
| <b>Bloomberg US Aggregate Bond Index (Total Return, USD)</b>  | Der Index ist eine breit angelegte Benchmark, die den in US-Dollar denominierten, festverzinslichen, steuerpflichtigen Markt für Anleihen mit Investment Grade misst.   |
| <b>FTSE Chinese Government and Policy Bank Bond 0-1 Year Select Index (Total Return, CNY)</b>             | Der Index misst die Wertentwicklung von auf CNY lautenden, festverzinslichen Staatsanleihen in stückloser Form sowie von Policy Bank Bonds, die auf dem chinesischen Festland ausgegeben wurden.  |
| <b>FTSE EPRA Nareit Developed Real Estate Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD)</b>                | Der Index ist ein Index, der die Wertentwicklung von börsennotierten Immobiliengesellschaften und Real Estate Investment Trusts (REITs) weltweit nachbilden soll.   |
| <b>FTSE Nareit All Equity REITs Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD)</b>                          | Der Index ist ein Index für börsengehandelte REITs, die Gewerbeimmobilien halten.   |
| <b>HFRX Equity Hedge Index (Total Return, USD)</b>  | Der Index soll Aktien-Hedgefondsstrategien repräsentieren, die überwiegend Long- und Short-Positionen in Aktien und Aktien-Derivaten halten. Aktien-Hedge-Manager würden in der Regel mindestens 50 % und können in manchen Fällen im Wesentlichen vollständig in Long- als auch Short-Aktienpositionen investiert sein.                  |
| <b>ICE BofA European Currency Non-Financial High Yield 3% Constrained Index (Total Return, EUR)</b>       | Der Index misst die Wertentwicklung von in Euro und GBP denominierten Unternehmensanleihen unterhalb von Investment Grade von Nichtfinanzunternehmen, die am Eurobondmarkt und Sterling- oder Euro-Inlandsmärkten öffentlich begeben werden. Das Engagement in einem Emittenten ist auf 3 % begrenzt.                                     |
| <b>ICE BofA Global High Yield Constrained Index (Total Return, abgesichert, USD)</b>                      | Der Index bildet die Wertentwicklung von in USD, CAD, GBP und EUR denominierten Unternehmensanleihen unterhalb Investment Grade ab, die an den wichtigsten Inlands- oder Eurobondmärkten öffentlich begeben werden. Das Engagement in jedem der im Index enthaltenen Emittenten ist auf maximal 2 % des Index begrenzt.                   |
| <b>ICE BofA Global Hybrid Non-Financial 5% Constrained Custom Index (Total Return, abgesichert, Euro)</b> | Der Index bildet die Wertentwicklung von nicht finanziellen hybriden Unternehmensanleihen mit Investment Grade ab, die öffentlich an wichtigen Inlands- und Eurobond-Märkten begeben werden, wobei die Gewichtung jedes Emittenten auf maximal 5 % begrenzt ist.  |

## Anhang VI (Fortsetzung)

### GLOSSAR DER INDIZES (UNGEPRÜFT)^ (FORTSETZUNG)

|  |  |
|--|--|
| <b>ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return, USD)</b>             | Der Index bildet die Wertentwicklung eines synthetischen Vermögenswerts ab, der bis zu einer angegebenen Fälligkeit den SOFR-Satz zahlt.   |
| <b>ICE BofA US High Yield Constrained Index (Total Return, USD)</b>  | Der Index deckt das Universum festverzinslicher Anleihen ohne Investment Grade ab.   |
| <b>ICE BofA 0-1 Year AAA Euro Government Index (Total Return, EUR)</b>   | Der Index ist eine Teilmenge des ICE BofA All Maturity Euro Government Index einschließlich aller Wertpapiere mit einer Fälligkeit von weniger als 1 Jahr und einem Rating von AAA. Der Index bildet die Wertentwicklung von in EUR denominierten Staatsanleihen ab, die von den Euro-Mitgliedsländern öffentlich entweder auf dem Eurobondmarkt oder dem Heimatmarkt des Emittenten begeben werden. |
| <b>ICE BofA 3-Month US Treasury Bill Index (Total Return, USD)</b>   | Der Index besteht aus einer einzelnen US-Treasury-Bill-Emission, die zu Beginn eines jeden Monats gekauft und einen ganzen Monat lang gehalten wird. Dann wird diese Emission verkauft und durch eine neu ausgewählte Emission mit einer Fälligkeit ersetzt, die dem Datum der Neuausrichtung am nächsten liegt, jedoch nicht mehr als 90 Tage danach.   |
| <b>JP Morgan Asia Credit Index (JACI) (Total Return, USD)</b>  | Der Index bildet die Gesamtertragsperformance für aktiv gehandelte, in US-Dollar denominierte Schuldtitel in der Region Asien (ohne Japan) ab.   |
| <b>JP Morgan ESG Asia Credit High Yield Index (JESG JACI) (Total Return, USD)</b>                              | Der Index bildet die Gesamtertragsperformance für aktiv gehandelte, in US-Dollar denominierte Schuldtitel in der Region Asien (ohne Japan) ohne Investment Grade ab, die bestimmte ESG-Kriterien erfüllen.<br><br>Der als Benchmark dienende Index wurde nicht als Referenzwert im Sinne der SFDR bestimmt.  |
| <b>JP Morgan JESG CEMBI Broad Diversified Index (Total Return, USD)</b>  | Der Index misst die Wertentwicklung der Märkte für Unternehmensanleihen aus Schwellenländern.  |
| <b>JP Morgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (Total Return, USD)</b>                     | Der Index misst die Wertentwicklung von Anleihenmärkten von Schwellenländern, die auf USD lauten.  |
| <b>JP Morgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified Index (Total Return, USD)</b>               | Der Index misst die Wertentwicklung von Anleihenmärkten von Schwellenländern, die auf USD lauten.  |
| <b>JP Morgan Government Bond Index (GBI) Emerging Markets Global Diversified (Total Return, Unhedged, USD)</b> | Der Index misst die Wertentwicklung von Anleihenmärkten von Schwellenländern, die auf lokale Währungen lauten.   |

## Anhang VI (Fortsetzung)

### GLOSSAR DER INDIZES (UNGEPRÜFT)^ (FORTSETZUNG)

|   |  |
|---|--|
| <b>MSCI AC Asia Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD)</b>                  | <p>Der Index ist ein um den Streubesitz bereinigter, kapitalisierungsgewichteter Index, der die Wertentwicklung von Large- und Mid-Cap-Unternehmen in den Industrieländern sowie in den Schwellenländern in Asien messen soll.</p> <p>Der als Benchmark dienende Index wurde nicht als Referenzwert im Sinne der SFDR bestimmt. Er steht daher nicht in Einklang mit der Bewerbung ökologischer oder sozialer Merkmale.</p>  |
| <b>MSCI All Country World Index (ACWI) (Total Return, abzüglich Steuern, USD)</b> | <p>Der Index ist ein um den Streubesitz bereinigter, kapitalisierungsgewichteter Index, der die Aktienmarktperformance von Industrie- und Schwellenländern messen soll. Per Februar 2023 deckte der Index über 2.800 Komponenten aus 11 Sektoren aus 23 Industrie- und 24 Schwellenländern ab.</p> <p>Der als Benchmark dienende Index wurde nicht als Referenzwert im Sinne der SFDR bestimmt. Er steht daher nicht in Einklang mit der Bewerbung ökologischer oder sozialer Merkmale.</p>  |
| <b>MSCI All Country World Value Index (Total Return, Net of Tax, USD)</b>         | <p>Der Index ist ein um den Streubesitz bereinigter, kapitalisierungsgewichteter Index, der die Wertentwicklung von Large- und Mid-Cap-Aktien mit allgemeinen Value-Merkmalen aus 23 entwickelten Märkten und 24 Schwellenmärkten repräsentiert wie von MSCI definiert. Die Merkmale des Value-Anlagestils für diesen Index werden anhand von drei Variablen definiert: Verhältnis zwischen Kurs und Buchwert (KBV), Verhältnis zwischen Kurs und Gewinn (KGV) basierend auf Prognosen für die nächsten zwölf Monate und Dividendenrendite. Per Februar 2023 deckte der Index über 1.700 Komponenten aus 11 Sektoren ab.</p> |
| <b>MSCI China A Onshore Index (Total Return, CNY)</b>                             | <p>Der Index ist kapitalisierungsgewichtet und besteht aus den A-Aktien großer und mittlerer Marktkapitalisierung von Unternehmen der VR China, die an den Börsen von Shanghai und Shenzhen notiert sind.</p>  |
| <b>MSCI China All Shares Index (Total Return, Net, USD)</b>                       | <p>Bei dem Index handelt es sich um einen kapitalisierungsgewichteten Index, dessen Komponentenzahl variieren kann und der so konzipiert ist, dass er die Wertentwicklung der breiten Volkswirtschaft der VRC anhand von Veränderungen des Gesamtmarktwerts der größten Aktien misst, die alle maßgeblichen Branchen repräsentieren.</p>   |
| <b>MSCI Emerging Markets Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD)</b>         | <p>Der Index ist ein um den Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index für Large- und Mid-Cap-Wertpapiere aus einer Reihe von Schwellenländern weltweit. Der Index unterliegt der Neugewichtung und die Liste bestimmter Schwellenländer und Titel kann sich gemäß der anzuwendenden Methode von MSCI ändern.</p>   |
| <b>MSCI Europe Index (Total Return, abzüglich Steuern, EUR)</b>                   | <p>Der Index ist ein um den Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der die Aktienmarktperformance von entwickelten Märkten in Europa messen soll.</p>  |
| <b>MSCI Japan Small Cap Net Index (Total Return, JPY)</b>                         | <p>Der Index misst die Wertentwicklung des Small-Cap-Segments des japanischen Marktes.</p>   |
| <b>MSCI World Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD)</b>                    | <p>Der MSCI World Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) ist ein um den Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der die Aktienmarktperformance von entwickelten Märkten messen soll.</p>  |
| <b>Russell 1000 Value Index (Total Return, Net of Tax, USD)</b>                   | <p>Der Index wird nicht gemanagt, setzt sich aus den Aktienkursen des Large-Cap-Value-Segments des US-Aktienuniversums zusammen und misst den Markt für US-Aktien mit höherer Marktkapitalisierung.</p> <p>Die Benchmark wurde nicht als Referenzwert im Sinne der SFDR bestimmt. Er steht daher nicht in Einklang mit der Bewerbung ökologischer oder sozialer Merkmale.</p>  |

## Anhang VI (Fortsetzung)

### GLOSSAR DER INDIZES (UNGEPRÜFT)<sup>^</sup> (FORTSETZUNG)

**Russell 2000 Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD)**

Der Index wird nicht gemanagt, setzt sich aus den Aktienkursen von 2000 kleinen US-Unternehmen zusammen und misst den Markt für US-Aktien mit geringerer Marktkapitalisierung.

**Russell 2000 Value Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD)**

Der Index wird nicht gemanagt, setzt sich aus den Aktienkursen des Small-Cap-Value-Segments des US-Aktienuniversums zusammen und misst den Markt für US-Aktien mit geringerer Marktkapitalisierung.

**S&P 500 Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD)**

Bei dem Index handelt es sich um einen kapitalisierungsgewichteten Index aus 500 Aktien, der die Wertentwicklung der breiten Volkswirtschaft der USA anhand von Veränderungen des Gesamtmarktwerts von 500 Aktien misst, die alle maßgeblichen Branchen repräsentieren.

**Weighted average of 2/3 JP Morgan EMBI Global Diversified Investment Grade Index (Total Return, USD) und 1/3 of JP Morgan GBI EM Global Diversified Investment Grade 15% Cap Index (Total Return, Unhedged, USD)**

Die Benchmark setzt sich aus folgender Mischung zusammen:

- 1/3 der Gewichtung entfällt auf den JP Morgan GBI Emerging Markets Global Diversified Investment Grade 15% Cap Index (Total Return, nicht währungsgesichert, USD), der die Wertentwicklung von auf lokale Währungen lautenden Anleihemärkten von Schwellenländern misst und
- 2/3 der Gewichtung entfällt auf den JP Morgan EMBI Global Diversified Investment Grade Index (Total Return, USD), der die Wertentwicklung von auf USD lautenden Anleihemärkten von Schwellenländern misst.

**50% JP Morgan GBI Emerging Markets Global Diversified Index (Total Return, nicht währungsgesichert, USD), 25% JP Morgan EMBI Global Diversified Index (Total Return, USD) und 25% JP Morgan CEMBI Diversified Index (Total Return, USD)**

Die Benchmark setzt sich aus folgender Mischung zusammen:

- 50 % der Gewichtung entfällt auf den JP Morgan GBI Emerging Markets Global Diversified Index (Total Return, nicht währungsgesichert, USD), der die Wertentwicklung von auf lokale Währungen lautenden Anleihemärkten von Schwellenländern misst;
- 25 % der Gewichtung entfällt auf den JP Morgan EMBI Global Diversified Index (Total Return, USD), der die Wertentwicklung von auf USD lautenden Anleihemärkten von Schwellenländern misst und
- 25 % der Gewichtung entfällt auf den JP Morgan CEMBI Diversified Index (Total Return, USD), der die Wertentwicklung von auf USD lautenden Märkten für Unternehmensanleihen von Schwellenländern misst.

**50% CBOE S&P 500 One-Week PutWrite Index / 50% CBOE S&P 500 PutWrite Index**

Die Benchmark setzt sich aus folgender Mischung zusammen:

- 50% CBOE S&P 500 PutWrite Index
- 50% CBOE S&P 500 One-Week PutWrite Index

Der CBOE S&P 500 PutWrite Index bildet die Wertentwicklung von (durch auf einem Geldmarktkonto gehaltene Barreserven besicherten) Verkaufsoptionen auf den S&P 500 Index auf monatlicher Basis ab.

Der CBOE S&P 500 One-Week PutWrite Index bildet die Wertentwicklung von (durch auf einem Geldmarktkonto gehaltene Barreserven besicherten) Verkaufsoptionen auf den S&P 500 Index auf wöchentlicher Basis ab.

In jeden vorstehenden Index ist Fremdkapital eingebettet, was bei der Berechnung des Fremdkapitals auf Portfolioebene berücksichtigt wird.

Ferner zieht das Portfolio ausschließlich zu Vergleichszwecken den S&P 500 Index als Referenzwert heran (siehe vorstehende Beschreibung).

<sup>^</sup> Inhaber von Anteilen einer Klasse, die auf eine andere Währung lautet als die Basiswährung, sollten beachten, dass es aussagekräftiger sein könnte, die Wertentwicklung einer solchen Klasse einer Version des betreffenden Index gegenüberzustellen, die auf die Währung der betreffenden Klasse lautet, sofern verfügbar.

## Anhang VII

### MANAGER, SUB-INVESTMENT-MANAGER UND UNTERBERATER (UNGEPRÜFT)

Nähere Angaben zu den Managern, Sub-Investment-Managern und Unterberatern sind in der nachstehenden Tabelle aufgeführt.

| Fondsname   | Manager  | Sub-Investment-Manager                                 | Unterberater (verbunden)                                      | Unterberater (nicht verbunden) |
|---|--|--|---|--------------------------------|
| Asia Responsible Transition Bond                        | Neuberger Berman Asset Management Ireland Limited („NBAMIL“) | Neuberger Berman Investment Advisers LLC („NBIA“)      |   |                                |
|   |  | Neuberger Berman Singapore Pte. Limited („NBS“)        |   |                                |
|   |  | Neuberger Berman Europe Limited („NBEL“)               |   |                                |
| China A-Share Equity                                    | NBAMIL   | NBIA   | Neuberger Berman Fund Management (China) Limited („NB China“) |                                |
|   |  | Neuberger Berman Asia Limited („NBAL“)                 |   |                                |
|   |  | NBEL   |   |                                |
| China Bond  | NBAMIL   | NBIA   | NB China  |                                |
|   |  | NBS  |   |                                |
|   |  | NBEL   |   |                                |
| China Equity  | NBAMIL   | Green Court Capital Management Limited („Green Court“) |   |                                |
|   |  | NBEL   |   |                                |
| Climate Innovation                                      | NBAMIL   | NBIA   |   |                                |
|   |  | NBEL   |   |                                |
| CLO Income  | NBAMIL   | NBIA   |   |                                |
|   |  | NBEL   |   |                                |
| Commodities   | NBAMIL   | NBIA   |   |                                |
|   |  | NBEL   |   |                                |
| Corporate Hybrid Bond                                   | NBAMIL   | NBIA   |   |                                |
|   |  | NBS  |   |                                |
|   |  | NBEL   |   |                                |
| Developed Market FMP – 2027                             | NBAMIL   | NBIA   |   |                                |
|   |  | NBEL   |   |                                |
| EMD Corporate – Social and Environmental Transition     | NBAMIL   | NBIA   |   |                                |
|   |  | NBS  |   |                                |
|   |  | NBEL   |   |                                |
| Emerging Market Debt – Hard Currency                    | NBAMIL   | NBIA   |   |                                |
|   |  | NBS  |   |                                |
|   |  | NBEL   |   |                                |
| Emerging Market Debt – Local Currency                   | NBAMIL   | NBIA   | NB China  |                                |
|   |  | NBS  |   |                                |
|   |  | NBEL   |   |                                |
| Emerging Market Debt Blend                              | NBAMIL   | NBIA   | NB China  |                                |
|   |  | NBS  |   |                                |
|   |  | NBEL   |   |                                |
| Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend | NBAMIL   | NBIA   |   |                                |
|   |  | NBS  |   |                                |
|   |  | NBEL   |   |                                |
| Emerging Markets Equity                                 | NBAMIL   | NBIA   |   |                                |
|   |  | NBAL   |   |                                |
|   |  | NBEL   |   |                                |
| Euro Bond   | NBAMIL   | NBEL   |   |                                |

## Anhang VII (Fortsetzung)

### MANAGER, SUB-INVESTMENT-MANAGER UND UNTERBERATER (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

| Fondsname                      | Manager | Sub-Investment-Manager                       | Unterberater (verbunden) | Unterberater (nicht verbunden) |
|--------------------------------|---------|--|--------------------------|--------------------------------|
| Euro Bond Absolute Return      | NBAMIL  | NBEL   |                          |                                |
| European High Yield Bond       | NBAMIL  | NBIA   |                          |                                |
|                                |         | NBEL   |                          |                                |
| European Sustainable Equity    | NBAMIL  | NBIA   |                          |                                |
|                                |         | NBEL   |                          |                                |
| Event Driven                   | NBAMIL  | NBEL   |                          |                                |
|                                |         | NBIA   |                          |                                |
| Global Bond                    | NBAMIL  | NBIA   |                          |                                |
|                                |         | NBS  |                          |                                |
|                                |         | NBEL   |                          |                                |
| Global Equity Megatrends       | NBAMIL  | NBIA   |                          |                                |
|                                |         | NBEL   |                          |                                |
| Global Flexible Credit Income  | NBAMIL  | NBIA   |                          |                                |
|                                |         | NBS  |                          |                                |
|                                |         | NBEL   |                          |                                |
|                                |         | NB Alternatives Advisers („NBAA“)            |                          |                                |
| Global High Yield Engagement   | NBAMIL  | NBIA   |                          |                                |
|                                |         | NBS  |                          |                                |
|                                |         | NBEL   |                          |                                |
| Global Investment Grade Credit | NBAMIL  | NBEL   |                          |                                |
|                                |         | NBIA   |                          |                                |
| Global Opportunistic Bond      | NBAMIL  | NBIA   |                          |                                |
|                                |         | NBS  |                          |                                |
|                                |         | NBEL   |                          |                                |
| Global Sustainable Equity      | NBAMIL  | NBIA   |                          |                                |
|                                |         | NBEL   |                          |                                |
| Global Value                   | NBAMIL  | NBIA   |                          |                                |
|                                |         | Neuberger Berman Canada ULC („NB Canada“)    |                          |                                |
|                                |         | NBEL   |                          |                                |
| High Yield Bond                | NBAMIL  | NBIA   |                          |                                |
|                                |         | NBEL   |                          |                                |
| InnovAsia                      | NBAMIL  | NBEL   |                          |                                |
|                                |         | NBIA   |                          |                                |
|                                |         | NBAL   |                          |                                |
| Japan Equity Engagement        | NBAMIL  | Neuberger Berman East Asia Limited („NBEAL“) |                          |                                |
|                                |         | NBEL   |                          |                                |
| Next Generation Connectivity   | NBAMIL  | NBIA   |                          |                                |
|                                |         | NBAL   |                          |                                |
|                                |         | NBEL   |                          |                                |
| Next Generation Mobility       | NBAMIL  | NBIA   |                          |                                |
|                                |         | NBAL   |                          |                                |
|                                |         | NBEL   |                          |                                |

## Anhang VII (Fortsetzung)

### MANAGER, SUB-INVESTMENT-MANAGER UND UNTERBERATER (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

| Fondsname   | Manager | Sub-Investment-Manager | Unterberater (verbunden) | Unterberater (nicht verbunden) |
|---|---------|------------------------|--------------------------|--------------------------------|
| Next Generation Space Economy                           | NBAMIL  | NBEL                   |                          |                                |
|   |         | NBIA                   |                          |                                |
| Short Duration Emerging Market Debt                     | NBAMIL  | NBIA                   |                          |                                |
|   |         | NBS                    |                          |                                |
|   |         | NBEL                   |                          |                                |
| Short Duration Euro Bond                                | NBAMIL  | NBEL                   |                          |                                |
| Short Duration High Yield Engagement                    | NBAMIL  | NBIA                   |                          |                                |
|   |         | NBEL                   |                          |                                |
| Strategic Income  | NBAMIL  | NBIA                   |                          |                                |
|   |         | NBS                    |                          |                                |
|   |         | NBEL                   |                          |                                |
|   |         | NBAA                   |                          |                                |
| Sustainable Asia High Yield                             | NBAMIL  | NBEL                   |                          |                                |
|   |         | NBIA                   |                          |                                |
|   |         | NBS                    |                          |                                |
| Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency        | NBAMIL  | NBEL                   |                          |                                |
|   |         | NBIA                   |                          |                                |
|   |         | NBS                    |                          |                                |
| Tactical Macro  | NBAMIL  | NBIA                   |                          |                                |
|   |         | NBEL                   |                          |                                |
| Uncorrelated Strategies                                 | NBAMIL  | NBIA                   | NBAA                     | Altiq LLP                      |
|   |         | NBEL                   |                          |                                |
| P/E Global LLC  |         |                        |                          |                                |
| True Partner Capital USA Holding Inc                    |         |                        |                          |                                |
| Cipher Capital LP (bis zum 1. August 2024)              |         |                        |                          |                                |
| G10 Capital Limited                                     |         |                        |                          |                                |
| Crabel Capital Management, LLC                          |         |                        |                          |                                |
| AllianceBernstein L.P.                                  |         |                        |                          |                                |
| Portman Square Capital LLP                              |         |                        |                          |                                |
| Soloda Investment Advisors LLP (bis zum 1. August 2024) |         |                        |                          |                                |

## Anhang VII (Fortsetzung)

### MANAGER, SUB-INVESTMENT-MANAGER UND UNTERBERATER (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

| Fondsname                    | Manager | Sub-Investment-Manager | Unterberater (verbunden) | Unterberater (nicht verbunden) |
|------------------------------|---------|------------------------|--------------------------|--------------------------------|
| US Equity                    | NBAMIL  | NBIA                   |                          |                                |
|                              |         | NBEL                   |                          |                                |
| US Equity Premium            | NBAMIL  | NBIA                   |                          |                                |
|                              |         | NBEL                   |                          |                                |
| US Large Cap Value           | NBAMIL  | NBEL                   |                          |                                |
|                              |         | NBIA                   |                          |                                |
| US Long Short Equity         | NBAMIL  | NBIA                   |                          |                                |
|                              |         | NBEL                   |                          |                                |
| US Multi Cap Opportunities   | NBAMIL  | NBIA                   |                          |                                |
|                              |         | NBEL                   |                          |                                |
| US Real Estate Securities    | NBAMIL  | NBIA                   |                          |                                |
|                              |         | NBEL                   |                          |                                |
| US Small Cap                 | NBAMIL  | NBIA                   |                          |                                |
|                              |         | NBEL                   |                          |                                |
| US Small Cap Intrinsic Value | NBAMIL  | NBIA                   |                          |                                |
|                              |         | NBEL                   |                          |                                |

## Anhang VIII

### OFFENLEGUNGSVERORDNUNG (UNGEPRÜFT)

Die folgenden Portfolios wurden als Artikel-6-Portfolio für die Zwecke der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rats vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor („SFDR“) kategorisiert: Neuberger Berman US Equity Premium Fund, Neuberger Berman Tactical Macro Fund, Neuberger Berman Event Driven Fund (Liquid Alternatives Portfolios), Neuberger Berman China Equity Fund (China Portfolios), Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (Multi Strategy Portfolio) und Neuberger Berman Commodities Fund (Quantitative und Multi Asset Portfolios).

Für die Zwecke der Taxonomie-Verordnung wird darauf hingewiesen, dass die Anlagen in zugrunde liegenden Artikel-6-Portfolios den EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten nicht Rechnung tragen.

Die folgenden Portfolios wurden als Artikel-8-Portfolios für die Zwecke der SFDR klassifiziert: Neuberger Berman CLO Income Fund (CLO Income Portfolio), Neuberger Berman High Yield Bond Fund, Neuberger Berman Short Duration High Yield Engagement Fund, Neuberger Berman European High Yield Bond Fund, Neuberger Berman Global High Yield Engagement Fund (High Yield Bond Portfolios), Neuberger Berman Emerging Market Debt – Local Currency Fund, Neuberger Berman Emerging Market Debt – Hard Currency Fund, Neuberger Berman EMD Corporate – Social and Environmental Transition Fund, Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund, Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund, Neuberger Berman Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Fund, Neuberger Berman Asia Responsible Transition Bond Fund, Neuberger Berman Sustainable Asia High Yield Fund (Emerging Market Debt Portfolios), Neuberger Berman China Bond Fund (China Bond Portfolios), Neuberger Berman Global Bond Fund, Neuberger Berman Strategic Income Fund, Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund, Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund, Neuberger Berman Global Flexible Credit Income Fund, Neuberger Berman Global Investment Grade Credit Fund (Fixed Income Portfolios), Neuberger Berman Developed Market FMP - 2027 (Fixed Maturity Portfolio), Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund, Neuberger Berman Short Duration Euro Bond Fund, Neuberger Berman Euro Bond Fund (Euro Fixed Income Portfolios), Neuberger Berman Global Value Fund (Quantitative and Multi Asset Portfolios), Neuberger Berman US Long Short Equity Fund (Liquid Alternatives Portfolios), Neuberger Berman US Equity Fund, Neuberger Berman US Small Cap Fund, Neuberger Berman US Multi Cap Opportunities Fund, Neuberger Berman US Large Cap Value Fund, Neuberger Berman US Small Cap Intrinsic Value Fund (US Equity Portfolios), Neuberger Berman Emerging Markets Equity Fund, Neuberger Berman Japan Equity Engagement Fund (Global Equity Portfolios), Neuberger Berman US Real Estate Securities Fund (Real Estate Portfolios), Neuberger Berman China A-Share Equity Fund (China Portfolios), Neuberger Berman Next Generation Connectivity Fund, Neuberger Berman Global Equity Megatrends Fund, Neuberger Berman InnovAsia Fund, Neuberger Berman Next Generation Mobility Fund, Neuberger Berman Next Generation Space Economy Fund, Neuberger Berman Climate Innovation Fund (Thematic Equity Portfolios), Neuberger Berman Global Sustainable Equity Fund und Neuberger Berman European Sustainable Equity Fund (Sustainable Equity Portfolios) (die „Artikel-8-Portfolios“). Informationen zu den ökologischen und sozialen Merkmalen der Artikel-8-Fonds, mit Ausnahme der nicht aufgelegten Fonds, sind im Anhang unten verfügbar.

Der Neuberger Berman Sustainable Emerging Market Debt – Hard Currency Fund (Emerging Market Debt Portfolios) wurde zum Zwecke der SFDR als Artikel-9-Portfolio (das „Artikel-9-Portfolio“) kategorisiert.

Im Einklang mit den Anforderungen von Artikel 11 der SFDR wurden keine Informationen in Bezug auf jedes Artikel-8-Portfolio und das Artikel-9-Portfolio in diesen Anhang aufgenommen.

Der Neuberger Berman Global Diversified Income FMP - 2024 Fund und der Neuberger Berman Global Real Estate Securities Fund wurden im Kalenderjahr 2024 (der „Bezugszeitraum“) aufgelöst und werden nicht mehr als Finanzprodukte gemäß Artikel 8 Absatz 1 der SFDR zur Verfügung gestellt. Dementsprechend sind die in Artikel 11 der SFDR genannten Informationen hier nicht enthalten.

Sofern nicht anderweitig in diesem Anhang VIII definiert, haben Begriffe in Großbuchstaben die ihnen in diesem Prospekt verliehene Bedeutung.

Soweit Unstimmigkeiten zwischen dem Prospekt, dem Nachtrag und der vorgeschriebenen Vorlage für den regelmäßigen Bericht (gemäß den Anforderungen von Artikel 11 der SFDR) (der „regelmäßige SFDR-Bericht“) in Bezug auf das Portfolio bestehen, hat der Nachtrag zum Portfolio Vorrang. Jeder regelmäßige SFDR-Bericht ist in Zusammenhang mit dem Prospekt und dem Nachtrag zum Portfolio zu lesen.

Sofern in einem regelmäßigen SFDR-Bericht nicht anders angegeben, bezieht sich jeder regelmäßige SFDR-Bericht auf den Bezugszeitraum.

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Asia Responsible Transition Bond Fund\* (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 54930058PUF4SZOVOD17

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser 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?

**Ja**

**Nein**

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

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht 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: \_\_\_%

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 44,9 % 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**

\*Im Bezugszeitraum wurde der Neuberger Berman Responsible Asian Debt – Hard Currency Fund in Neuberger Berman Asia Responsible Transition Bond Fund umbenannt.

\*\*Weitere Einzelheiten zum Mindestanteil nachhaltiger Investitionen, die ökologische oder soziale Merkmale bewerben, finden Sie unter der Frage „Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?“.

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie hier.

Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen,

die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio für Unternehmen beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und Landnutzung, Kohlenstoffemissionen, Gelegenheiten für saubere Technologien, Wasserstress, Schadstoffemissionen und Abfälle, Finanzierung von Umweltauswirkungen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck von Produkten, Umweltpolitik, Umweltmanagementsystem, Programme zur Reduzierung von THG-Emissionen („**THG**“) umweltfreundliche Beschaffungspolitik und Programme für treibhausfreie Luftemissionen.
- **Soziale Merkmale:** Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Schutz der Privatsphäre und Datensicherheit, Produktsicherheit und -qualität, Sicherheit von Finanzprodukten, Diskriminierungspolitik, Programme zur Einbindung der Gemeinschaft, Diversitätsprogramme und Menschenrechtspolitik.

Das Portfolio zielt auf Konformität mit einem Netto-Null-Ziel ab, wie im SFDR-Anhang und im Abschnitt „Nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten“ im Prospekt ausführlicher beschrieben.

Das Portfolio erreichte eine CO<sub>2</sub>-Emissionsintensität, die mindestens 30 % unter der des breiteren Anlageuniversums asiatischer Schuldtitel lag, das durch den JP Morgan Asian Credit Index (Total Return, USD) (der „Referenzwert“) repräsentiert wird. Das Portfolio wird aktiv verwaltet und beabsichtigt nicht, den Referenzwert nachzubilden (zu tracken). Er wird hier lediglich zu Zwecken des Vergleichs der Wertentwicklung herangezogen.

Für den Bezugszeitraum erreichte das Portfolio eine höhere ESG-Bewertung als das breitere Universum asiatischer Schuldtitel, das durch den Referenzwert repräsentiert wird, basierend auf den ESG-Bewertungen eines etablierten externen Anbieters.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

## Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses haben der Manager und der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten den NB-ESG-Quotienten, um die aufgeführten ökologischen und sozialen Merkmale zu bewerben, indem sie primär in Wertpapiere von Emittenten mit einem relativ günstigen und/oder einem sich

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

verbessernden NB-ESG-Quotienten-Rating investierten. Dementsprechend beschränkten der Manager und der Sub-Investment-Manager das Engagement in Emittenten mit dem schlechtesten NB-ESG-Quotienten-Rating, außer es bestand die begründete Erwartung, dass sich das NB-ESG-Quotienten-Rating im Laufe der Zeit verbessern würde.

| Bezugszeitraum    | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|--------|---------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient   | 60     | 1-100   | 99 %                  |
| Daten von Dritten | 5,7    | 0-10    |                       |

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

## 2. ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy, die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy, Ausschlüsse gemäß dem EU-Referenzwert für klimabedingten Wandel (der „**EU-CTB**“), wie im Rahmen der Neuberger Berman EU Climate Benchmark Standard Exclusions Policy vorgesehen, und die sonstigen spezifischen Ausschlüsse identifiziert wurden, die im SFDR-Anhang des Portfolios angegeben sind, oder nicht mit diesen vereinbar waren.

Zudem investierte das Portfolio nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstößend identifiziert wurden (oder nicht mit dieser vereinbar waren), wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischen Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik auf das Portfolio haben der Manager und der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik verstießen. Wo möglich haben der Manager und der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise ihrer Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager erörterten und diskutierten die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund ihres eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

### Sonstiges

Im Bezugszeitraum führte das Portfolio die EU-CTB-Ausschlüsse ein, wie im Rahmen der Neuberger Berman EU Climate Benchmark Standard Exclusions Policy vorgesehen. Die Neuberger Berman EU Climate Benchmark Standard Exclusions Policy wurde vom Manager und vom Sub-Investment-Manager erstellt zur Ausrichtung auf die Leitlinien der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde zu Fondsnamen, die ESG- oder nachhaltigkeitsbezogene Begriffe verwenden.

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

Ausnahmsweise wurden für den Bezugszeitraum 2022 die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgte (sie umfassen die Veröffentlichung der SFDR-Vorlagen für vorvertragliche Informationen).

#### 1. Der NB-ESG-Quotient

|                            | <b>NB-ESG-Quotient-Rating</b> | <b>Rating der Daten durch externe Anbieter</b> | <b>Kombinierte Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| <b>Bereich</b>             | 1-100                         | 0-10   | 0-100 %                      |
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 59                            | 5,6  | 97 %                         |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 59                            | 5,5  | 100 %                        |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 60                            | 5,7  | 99 %                         |

#### 2. Ausschlüsse

|                            | <b>Gesamtzahl der Verstöße</b> |
|----------------------------|--------------------------------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 0                              |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 0                              |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 0                              |

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

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckte sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Anlage zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Anlage eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat (wie nachstehend erläutert) und (iii) auf eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die gute Unternehmensführung eines Emittenten, um festzustellen, ob der Emittent einer derartigen Beurteilung standhält. Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griffen der Manager und der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die wirtschaftlichen Tätigkeiten eines Emittenten auf ökologische oder soziale Merkmalen ausgerichtet waren.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager überprüften die Emittenten auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Emittenten diese Prüfung bestanden haben, haben der Manager und der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag des Emittenten zur Wirtschaft gemessen.

Bei Unternehmensemittenten haben der Manager und der Sub-Investment-Manager dies auf drei Arten erfasst:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden);
- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDGs“) und
- Unternehmensemittenten in Sektoren mit großen Auswirkungen, die sich auf der Grundlage des NB Net-Zero Alignment Indicator auf einen Netto-Null-Kurs umstellen.

Im Bezugszeitraum aktualisierten der Manager und Sub-Investment Manager den SFDR-Anhang des Portfolios, um dem Umstand Rechnung zu tragen, dass der Manager und Sub-Investment Manager bei der Ermittlung nachhaltiger Investitionen Unternehmensemittenten aus Sektoren mit großen Auswirkungen berücksichtigen, die sich auf der Grundlage des NB Net-Zero Alignment Indicator auf einen Netto-Null-Kurs umstellen.

Bei staatlichen Emittenten haben der Manager und der Sub-Investment-Manager dies auf folgenden Arten erfasst:

- Fortschritte bei der Anpassung an den Klimawandel und dem Klimaschutz und
- Fortschritte bei der Erreichung der SDGs, mit Schwerpunkt auf Lebenserwartung und Bildung

Nachhaltige Investitionen wiesen zu einer höheren Wahrscheinlichkeit eine Ausrichtung der aus Produkten/Dienstleistungen erzielten Umsätze auf die SDGs auf.

Sowohl die nachhaltigen als auch die nicht nachhaltigen Investitionen im Portfolio zielten bis 2050 auf eine Netto-Null-Ausrichtung ab.

Die Berücksichtigung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs, nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers, wurde durch die Verfügbarkeit von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griffen der Manager und der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Stellvertreterdaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

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?***

Der Manager und der Sub-Investment-Manager wandten ihren Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigen. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachteten der Manager und der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Bei der Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen kein ökologisches oder soziales nachhaltiges Anlageziel erheblich beeinträchtigen, berücksichtigten der Manager und der Sub-Investment-Manager die in Teil 1 der nachstehenden Tabelle aufgeführten Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen für Unternehmensemittenten (die „**PAIs für Unternehmensemittenten**“) und die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen für staatliche Emittenten (die „**staatlichen PAIs**“) wie nachfolgend in Teil 2 der Tabelle dargelegt (zusammen die „**PAIs**“):

| <b>Teil 1 – PAIs für Untermehensemittenten</b> |   |
|--|---|
| <b>Thema</b>                                   | <b>Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen</b>  |
| <i>Treibhausgasemissionen</i>                  | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind<br>PAI 5 - Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen<br>PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren  |
| <i>Biodiversität</i>                           | PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken  |
| <i>Wasser</i>                                  | PAI 8 - Emissionen in Wasser  |
| <i>Abfall</i>                                  | PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle  |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i>              | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen<br>PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen<br>PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle<br>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen<br>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |
| <b>Teil 2 – staatliche PAIs</b>                |   |
| <i>Umwelt</i>                                  | PAI 15 – THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird   |
| <i>Soziales</i>                                | PAI 16 - Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen   |

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigten ferner Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen und investierte nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

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

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Manager und den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, dass die ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen des Portfolios nicht erheblich beeinträchtigt wurden, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Emittenten, die quantitative und qualitative Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden, unterschreiten;
- Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Emittenten, wenn sie unter die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

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

Der Manager und der Sub-Investment-Manager investierten nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*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 EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



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

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager und den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigten PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

1. Wie oben unter „*Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?*“ erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele führten, alle PAIs berücksichtigt.
2. Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigten die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

| PAIs auf Produktebene         |   |
|-------------------------------|---|
| Thema                         | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen   |
| <i>Treibhausgasemissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| <i>Soziales und</i>           | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen   |

|                      |   |
|----------------------|---|
| <i>Beschäftigung</i> | PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen<br>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |
|----------------------|---|

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbareren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager und den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager und der Sub-Investment-Manager haben den Bloomberg Industry Classification Standard („BICS“) verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem über die vier Kalenderquartalsenden des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitt basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2024 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2024 – 31. Dezember 2024

| Größte Investitionen                         | Sektor       | In % der Vermögenswerte | Land               |
|--|--------------|-------------------------|--------------------|
| PT PERTAMINA (PERSERO) REGD                  | ENERGIE      | 3,3                     | INDONESIEN         |
| REPUBLIC OF INDONESIA REGD                   | STAATLICH    | 2,6                     | INDONESIEN         |
| REPUBLIC OF INDONESIA /EUR/ REGD             | STAATLICH    | 1,9                     | INDONESIEN         |
| STANDARD CHARTERED PLC REGD V/R              | FINANZWERTEN | 1,5                     | GROSSBRITANNIEN    |
| DUA CAPITAL LTD REGD REG S                   | FINANZWERTEN | 1,4                     | MALAYSIA           |
| STANDARD CHARTERED PLC REGD V/R /PERP/ REG S | FINANZWERTEN | 1,3                     | GROSSBRITANNIEN    |
| MEDCO BELL PTE LTD REGD                      | ENERGIE      | 1,3                     | SINGAPUR           |
| PRUDENTIAL FUNDING ASIA REGD V/R REG S EMTN  | FINANZWERTEN | 1,2                     | GROSSBRITANNIEN    |
| IND & COMM BK OF CHINA REGD REG S            | FINANZWERTEN | 1,2                     | CHINA              |
| CHINA CONSTRUCTION BANK REGD V/R REG S       | FINANZWERTEN | 1,2                     | CHINA              |
| UNITED OVERSEAS BANK LTD REGD V/R REG S EMTN | FINANZWERTEN | 1,2                     | SINGAPUR           |
| REPUBLIC OF INDONESIA /EUR/ REGD             | STAATLICH    | 1,2                     | INDONESIEN         |
| 10 RENEW POWER SUBSIDIAR REGD REG S          | VERSORGUNG   | 1,1                     | INDIEN             |
| EXPORT-IMPORT BANK KOREA REGD                | STAATLICH    | 1,0                     | KOREA<br>BRITISCHE |
| ENN CLEAN ENERGY REGD REG S                  | VERSORGUNG   | 1,0                     | JUNGFERNINSELN     |

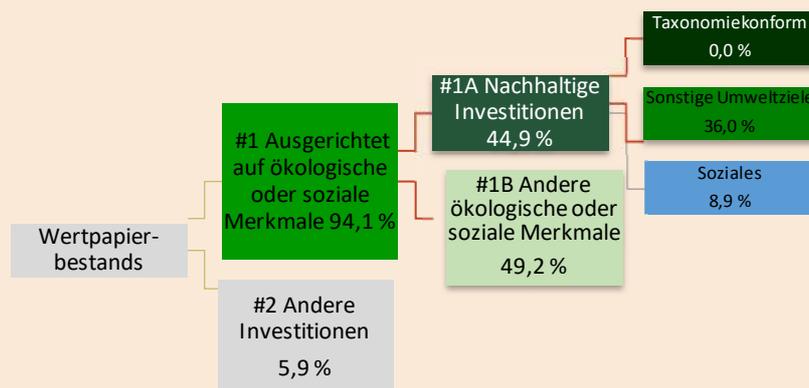


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Vermögensallokation des Portfolios im Bezugszeitraum wird in nachstehender Grafik dargestellt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager berechneten den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager und der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatten. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen.



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

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

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige** Investitionen umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● *In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?*

| <b>Wirtschaftssektoren - BICS</b> | <b>In % der Vermögenswerte</b> |
|-----------------------------------|--------------------------------|
| FINANZWERTEN                      | 48,2                           |
| STAATLICH                         | 16,1                           |
| ENERGIE                           | 8,0                            |
| KOMMUNIKATION                     | 6,8                            |
| ZYKLISCHE KONSUMGÜTER             | 5,2                            |
| VERSORGUNG                        | 4,9                            |
| TECHNOLOGIE                       | 4,4                            |
| GRUNDSTOFFE                       | 2,7                            |
| INDUSTRIE                         | 2,3                            |
| NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER       | 1,0                            |
| DIVERSIFIZIERT                    | 0,4                            |



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager können bestätigen, dass das Portfolio in Investitionen investiert hat, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Manager und der Sub-Investment-Manager werden das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

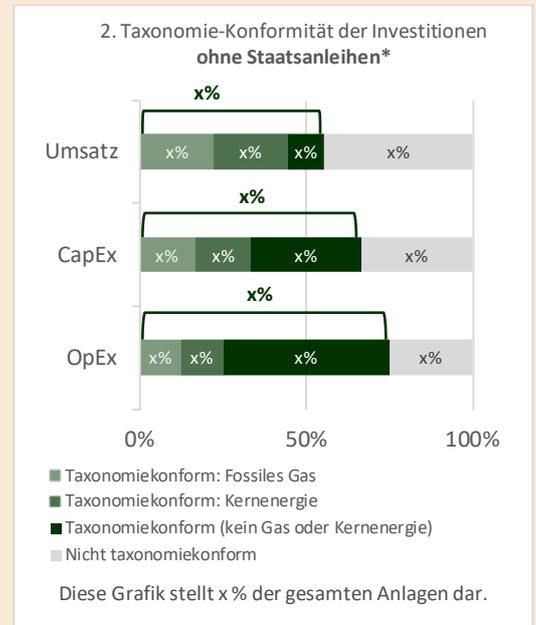
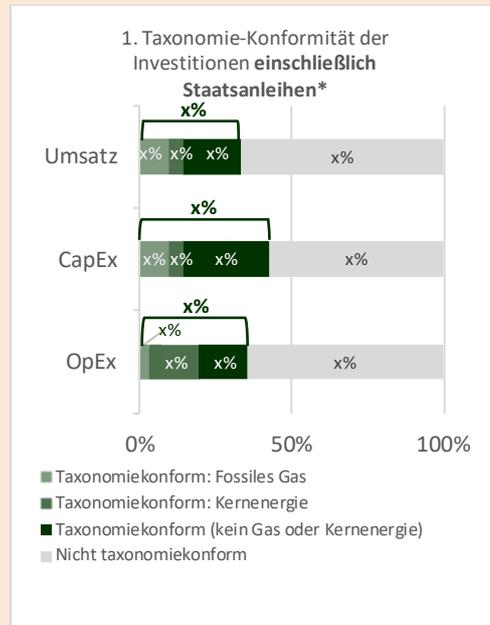
Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten 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 Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. 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.



\* 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?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



## Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Dies ist in der Grafik zur Vermögensallokation unter der Frage „Wie sah die Vermögensallokation aus?“ oben angegeben.



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?

Dies ist in der Grafik zur Vermögensallokation unter der Frage „Wie sah die Vermögensallokation aus?“ oben angegeben.



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

„Andere Investitionen“ umfasst die übrigen Investitionen des Portfolios, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren noch als nachhaltige Investitionen eingestuft wurden.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager und der Sub-Investment-Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachteten, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen, verhinderten und sie sicherstellen, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager wendeten bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager verstehen unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Managers und des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Managers und des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten sowie Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotienten herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Manager und vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

### II. Mitwirkung:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager engagierten sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager betrachteten diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil ihres Anlageprozesses. Die Fortschritte bei der Einbindung wurden vom Manager und dem Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### III. ESG-Sektor-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k.A.
- **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?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k.A.

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

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman China A-Share Equity Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 54930037QMZTCH4D7291

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser 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 type="checkbox"/> Ja ●   | <input checked="" type="checkbox"/> Nein   |
|---|--|
| <input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: ___% <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> </ul> <input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: ___% | <input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen. <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel</li> </ul> <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden <b>damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt</b> |

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Sofem in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Luftqualität, Energiemanagement, Umweltpolitik, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zur Gesundheitsversorgung, Cybersicherheitssystem und -schulungen, Qualitätsmanagement, Gesundheit und Arbeitsbedingungen und Arbeitsunfälle, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement und Preistransparenz.

Die Performance bezüglich dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem hausinternen ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman gemessen, das sich spezifisch auf den chinesischen Markt fokussiert (der „**NB-China-ESG-Quotient**“) und wird im Folgenden in aggregierter Form dargestellt.

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

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-China-ESG-Quotient:

Der NB China ESG Quotient basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und ergab ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem er diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-China-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („NB“) für China, die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor in China angesehen werden. Der Sub-Investment-Manager griff auf die Wesentlichkeitsmatrix von NB China und lokale Erkenntnisse zum chinesischen Markt zurück, um die wesentlichen ESG-Merkmale für chinesische A-Aktien anzupassen. Im Hinblick auf chinesische A-Aktien bewertete der Sub-Investment-Manager die langfristigen ESG-Merkmale und Werttreiber der Branchen Chinas und der darin tätigen Unternehmen.

Der NB-China-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-China-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Das Rating des NB-China-ESG-Quotienten von Unternehmen wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein NB-China-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss. Unternehmen mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-China-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Unternehmen mit einem schlechten NB China ESG Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Unternehmen diesbezüglich keine Maßnahmen ergreift, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Darüber hinaus bemühte sich der Sub-Investment-Manager, konstruktiven Dialogen bei Unternehmen mit einem schlechten NB China Quotient-Rating Vorrang einzuräumen, um zu beurteilen, ob Bedenken angemessen berücksichtigt wurden.

Der aktualisierte NB-China-ESG-Quotient verwendet ein Rating zwischen CCC und AAA, wobei CCC das niedrigste und AAA das höchste Rating darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-China-ESG-Quotienten, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss.

| Bezugszeitraum        | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|-----------------------|--------|---------|-----------------------|
| NB-China-ESG-Quotient | AA     | CCC-AAA | 100 %                 |
| Daten von Dritten     | 4,4    | 0-10    |                       |

Das durchschnittliche Rating des NB China ESG Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jedes im Portfolio gehaltene Unternehmen erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums erfasste Climate Value-at-Risk („**CVaR**“) das Ausmaß der Risiken und der Chancen des Klimaübergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmen.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

|  |         |
|--|---------|
| Der CVaR prognostizierte, dass ein Szenario der Klimaerwärmung beim verwalteten Vermögen im Bezugszeitraum zu folgendem Wertverlust führen könnte. | -39,8 % |
| CVaR-Abdeckung im Bezugszeitraum.  | 90 %    |

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken und Chancen, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügt.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

## 3. ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons

Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy, die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy und die sonstigen spezifischen Ausschlüsse identifiziert wurden, die im SFDR-Anhang des Portfolios angegeben sind, oder nicht mit diesen vereinbar waren. Zudem investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB China ESG Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

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

Ausnahmsweise wurden für den Bezugszeitraum 2022 die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgte (sie umfassen die Veröffentlichung der SFDR-Vorlagen für vorvertragliche Informationen).

1. NB-China-ESG-Quotient

Wie in nachstehender Tabelle angegeben, wurde das Spektrum für den NB-China-ESG-Quotienten ab dem Bezugszeitraum 2023 aktualisiert.

| 2022                       | NB-China-ESG-Quotient | Daten von Dritten | Kombinierte Abdeckung |
|----------------------------|-----------------------|-------------------|-----------------------|
| <b>Bereich</b>             | <b>CCC-AA</b>         | <b>0-10</b>       | <b>0-100 %</b>        |
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | BBB                   | 4,0               | 92 %                  |

| Ab 2023                    | NB-China-ESG-Quotient | Daten von Dritten | Kombinierte Abdeckung |
|----------------------------|-----------------------|-------------------|-----------------------|
| <b>Bereich</b>             | <b>CCC-AAA</b>        | <b>0-10</b>       | <b>0-100 %</b>        |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | AAA                   | 4,2               | 96 %                  |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | AA                    | 4,4               | 100 %                 |

2. CVaR

|                            | CVaR    | Abdeckung |
|----------------------------|---------|-----------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | -23,7 % | 94 %      |

|                            |         |      |
|----------------------------|---------|------|
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | -33,1 % | 91 % |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | -39,8 % | 90 % |

Im Jahresvergleich hat sich der vom CVaR projizierte Verlust aufgrund der mit den gehaltenen Unternehmensmitteln und der Handelsaktivität verbundenen Veränderungen wie einer Erhöhung der Gewichtungen oder Käufe von Wertpapieren mit einem höheren projizierten Verlust vergrößert. Ferner aktualisiert unser Daten-Drittanbieter seine Bewertungen der klimabezogenen Risiken für Wertpapiere fortlaufend, was über die Jahre ebenfalls zu dem erhöhten projizierten Verlust für manche der von uns gehaltenen Wertpapiere beitrug. Wie bereits erwähnt, kann die Szenarioanalyse als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken dienen, um sie durch einen Dialog mit den Unternehmensmitteln anzusprechen.

### 3. Ausschlüsse

|                            | <b>Gesamtzahl der Verstöße</b> |
|----------------------------|--------------------------------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 0                              |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 0                              |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 0                              |

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

k.A.

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

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten. Dessen ungeachtet war der Sub-Investment-Manager nicht in Unternehmen investiert, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst 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.

*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 EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



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

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Unternehmen durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

| PAIs auf Produktebene             |  |
|-----------------------------------|--|
| Thema                             | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen  |
| <i>Treibhausgasemissionen</i>     | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind  |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen<br>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen<br>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbar Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



### Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat den Bloomberg Industry Classification Standard („BICS“) verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2024 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2024 – 31. Dezember 2024

| Größte Investitionen            | Sektor                         | In % der Vermögenswerte | Land  |
|---------------------------------|--------------------------------|-------------------------|-------|
| KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A /CNY/  | NICHT-ZYKLISCHE<br>KONSUMGÜTER | 4,7                     | CHINA |
| MIDEA GROUP CO LTD-A /CNH/      | ZYKLISCHE KONSUMGÜTER          | 3,7                     | CHINA |
| CHINA CONSTRUCTION BANK- /CNY/  | FINANZWERTEN                   | 3,4                     | CHINA |
| LUXSHARE PRECISION INDUS /CNH/  | INDUSTRIE                      | 3,0                     | CHINA |
| CONTEMPORARY AMPEREX TEC /CNH/  | ZYKLISCHE KONSUMGÜTER          | 2,5                     | CHINA |
| SHENZHEN MINDRAY BIO-MED /CNH/  | NICHT-ZYKLISCHE<br>KONSUMGÜTER | 2,5                     | CHINA |
| CHINA YANGTZE POWER CO L /CNH/  | VERSORGUNG                     | 2,5                     | CHINA |
| CHINA MOLYBDENUM CO LTD- /CNY/  | GRUNDSTOFFE                    | 2,2                     | CHINA |
| BYD CO LTD -A /CNH/             | ZYKLISCHE KONSUMGÜTER          | 2,1                     | CHINA |
| JIANGSU YANGHE BREWERY - /CNH/  | NICHT-ZYKLISCHE<br>KONSUMGÜTER | 2,0                     | CHINA |
| CHINA MERCHANTS BANK-A /CNY/    | FINANZWERTEN                   | 1,9                     | CHINA |
| FUYAO GROUP GLASS INDUST /CNY/  | ZYKLISCHE KONSUMGÜTER          | 1,8                     | CHINA |
| HAIER SMART HOME CO LTD-A /CNH/ | ZYKLISCHE KONSUMGÜTER          | 1,7                     | CHINA |
| JIANGSU HENGRUI PHARMACE /CNY/  | NICHT-ZYKLISCHE<br>KONSUMGÜTER | 1,5                     | CHINA |
| BANK OF HANGZHOU CO LTD- /CNY/  | FINANZWERTEN                   | 1,5                     | CHINA |

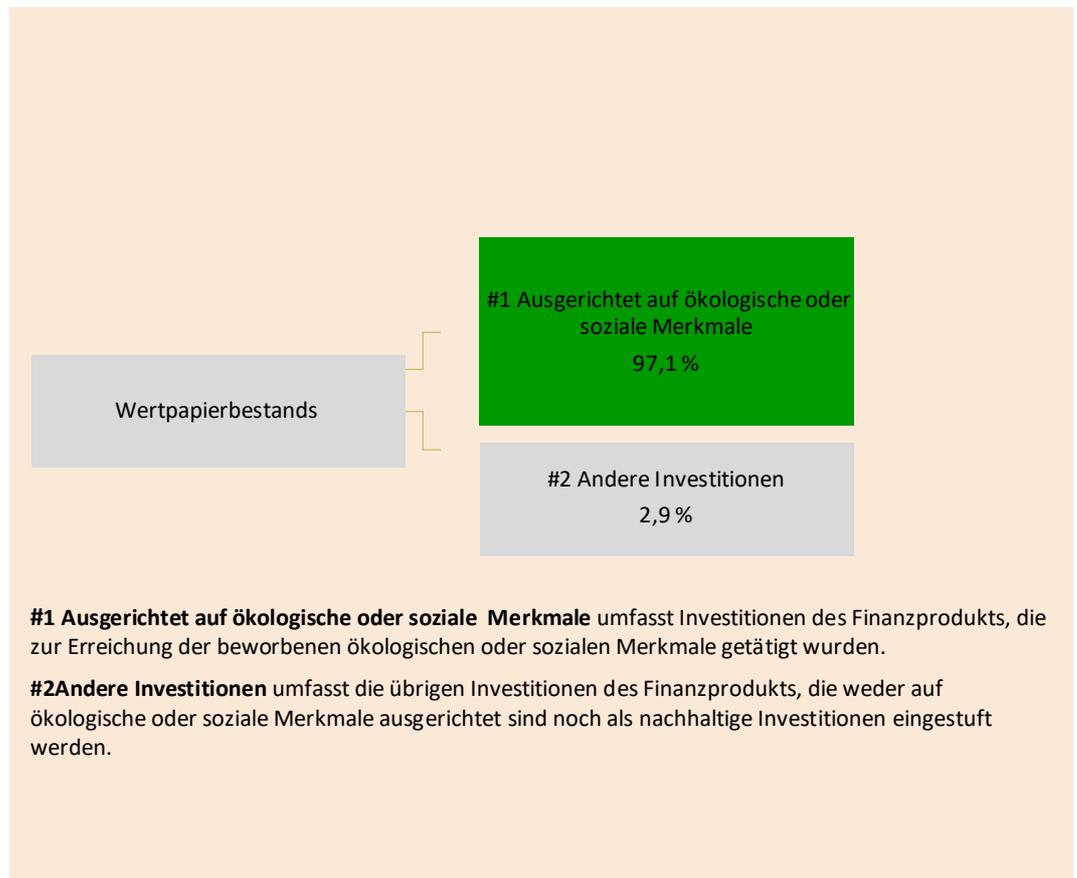


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### ● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Die Vermögensallokation des Portfolios im Bezugszeitraum wird in nachstehender Grafik dargestellt. Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB China ESG Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder externen Anbietern beruhen.



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

| Wirtschaftssektoren - BICS  | In % der Vermögenswerte |
|-----------------------------|-------------------------|
| NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 24,3                    |
| ZYKLISCHE KONSUMGÜTER       | 19,6                    |
| INDUSTRIE                   | 17,3                    |
| FINANZWERTEN                | 15,1                    |

|               |      |
|---------------|------|
| GRUNDSTOFFE   | 12,2 |
| KOMMUNIKATION | 3,7  |
| TECHNOLOGIE   | 3,6  |
| VERSORGUNG    | 2,5  |
| ENERGIE       | 1,7  |

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Bei-trag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

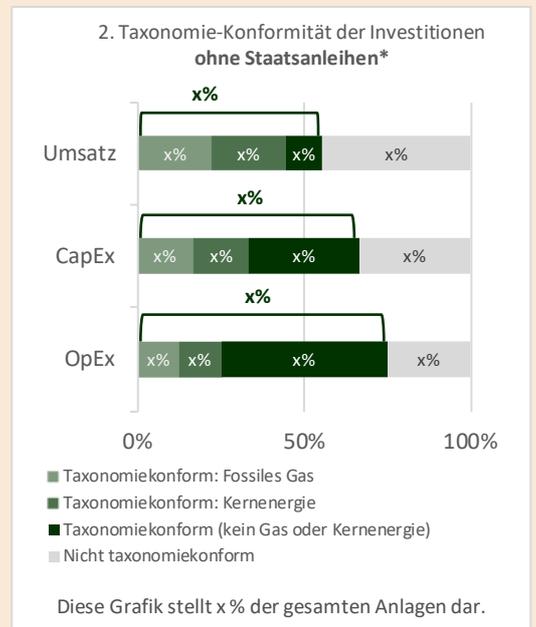
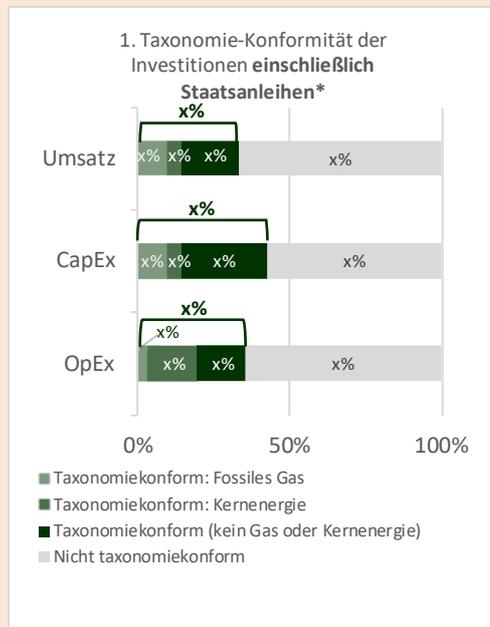
● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?**

- Ja:  
 In fossiles Gas     In Kernenergie  
 Nein

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten 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 Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



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

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

 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 nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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

„Andere Investitionen“ umfasst die übrigen Investitionen des Portfolios, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren noch als nachhaltige Investitionen eingestuft wurden.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Ausrichtung der Investitionen auf die mit dem Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-China-ESG-Quotienten sowie Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-China-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde herangezogen, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung besser zu erkennen. Durch die Integration der hausinternen lokalen Erkenntnisse zum chinesischen Markt und der ESG-Analyse des Investmentteams (der NB China ESG Quotient) in die Gesamtbeurteilung des Unternehmens bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

### II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager arbeitete mit den Unternehmen mit einem soliden ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses.

Um die Beziehungen zu den Unternehmen aufrechtzuerhalten und zu verbessern und sicherzustellen, dass die Unternehmen ihren ESG-Kurs verfolgten, führte der Sub-Investment-Manager mit den Unternehmen einen aktiven Dialog, unabhängig davon, ob sie Kontroversen mit großen Auswirkungen oder ein schlechtes NB China ESG Quotient-Rating aufwiesen oder nicht. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### III. ESG-Sektor-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



### **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k.A.
- **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?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k.A.

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

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman China Bond Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300I3S2HFIMB3V932

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser 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?

**Ja**

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

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht 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**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Sofem in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio für Unternehmensemittenten beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und Landnutzung, Kohlenstoffemissionen, Gelegenheiten für saubere Technologien, Wasserstress, Schadstoffemissionen und Abfälle, Finanzierung von Umweltauswirkungen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck von Produkten, Umweltpolitik, Umweltmanagementsystem, Programme zur Reduzierung von THG-Emissionen („THG“) umweltfreundliche Beschaffungspolitik und Programme für treibhausfreie Luftemissionen.
- **Soziale Merkmale:** Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Schutz der Privatsphäre und Datensicherheit, Produktsicherheit und -qualität, Sicherheit von Finanzprodukten, Diskriminierungspolitik, Programme zur Einbindung der Gemeinschaft, Diversitätsprogramme und Menschenrechtspolitik.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses haben der Manager und der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „NB- ESG-Quotient“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten den NB-ESG-Quotienten, um die aufgeführten ökologischen und sozialen Merkmale zu bewerten, indem sie primär in Wertpapiere von Emittenten mit einem relativ günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotienten-Rating investierten. Dementsprechend beschränkten der Manager und der Sub-Investment-Manager das Engagement in Emittenten mit dem schlechtesten NB-ESG-Quotienten-Rating, außer es bestand die begründete Erwartung, dass sich das NB-ESG-Quotienten-Rating im Laufe der Zeit verbessern würde.

| Bezugszeitraum    | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|--------|---------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient   | 53     | 1-100   | 94 %                  |
| Daten von Dritten | 4,2    | 0-10    |                       |

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein

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

ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

## 2. ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy und die sonstigen spezifischen Ausschlüsse identifiziert wurden, die im SFDR-Anhang des Portfolios angegeben sind, oder nicht mit diesen vereinbar waren. Außerdem investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik auf das Portfolio haben der Manager und der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik verstoßen. Wo möglich haben der Manager und der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise ihrer Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager erörterten und diskutierten die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund ihres eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

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

Ausnahmsweise wurden für den Bezugszeitraum 2022 die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgte (sie umfassen die Veröffentlichung der SFDR-Vorlagen für vorvertragliche Informationen).

### 1. NB-ESG-Quotient

|                            | <b>NB-ESG-Quotient-Rating</b> | <b>Rating der Daten durch externe Anbieter</b> | <b>Kombinierte Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| <b>Bereich</b>             | 1-100                         | 0-10   | 0-100 %                      |
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 50                            | 4,4  | 67 %                         |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 54                            | 4,2  | 69 %                         |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 53                            | 4,2  | 94 %                         |

## 2. Ausschlüsse

|                            | Gesamtzahl der Verstöße |
|----------------------------|-------------------------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 0                       |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 0                       |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 0                       |

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten. Dessen ungeachtet waren der Manager und der Sub-Investment-Manager nicht in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*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 EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

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 bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager und den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „PAIs auf Produktebene“):

| PAIs auf Produktebene             |  |
|-----------------------------------|--|
| Thema                             | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen  |
| <i>Treibhausgasemissionen</i>     | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind  |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen<br>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen<br>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager und den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel, die für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager und der Sub-Investment-Manager haben den Bloomberg Industry Classification Standard („BICS“) verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2024 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2024 – 31. Dezember 2024

| Größte Investitionen                         | Sektor                      | In % der Vermögenswerte | Land     |
|--|-----------------------------|-------------------------|----------|
| CHINA GOVERNMENT BOND /CNY/ REGD SER INBK    | STAATLICH                   | 12,3                    | CHINA    |
| CHINA DEVELOPMENT BANK /CNY/ REGD SER2402    | FINANZWERTEN                | 8,0                     | CHINA    |
| CENTRAL HUIJIN INV /CNY/ REGD MTN            | FINANZWERTEN                | 7,4                     | CHINA    |
| AGRICULTURAL BK OF CHINA /CNY/ REGD REG S    | FINANZWERTEN                | 5,8                     | CHINA    |
| CHINA GOVERNMENT BOND /CNY/ REGD SER INBK    | STAATLICH                   | 4,4                     | CHINA    |
| AGRICUL DEV BANK CHINA /CNY/ REGD SER2207    | FINANZWERTEN                | 4,4                     | CHINA    |
| EXPORT-IMPORT BANK CHINA /CNY/ REGD SER 2403 | STAATLICH                   | 4,4                     | CHINA    |
| CHINA GOVERNMENT BOND /CNY/ REGD SER INBK    | STAATLICH                   | 4,0                     | CHINA    |
| GUOTAI JUNAN SECURITIES /CNY/ REGD SER B     | FINANZWERTEN                | 3,7                     | CHINA    |
| CHINA GOVERNMENT BOND /CNY/ REGD SER INBK    | STAATLICH                   | 3,6                     | CHINA    |
| CHINA MINMETALS CORP /CNY/ REGD MTN          | INDUSTRIE                   | 2,9                     | CHINA    |
| SHANGHAI PORT GROUP BV REGD REG S            | NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 2,5                     | HONGKONG |
| GZ MTR FIN BVI REGD REG S EMTN               | INDUSTRIE                   | 2,5                     | CHINA    |
| LENOVO GROUP LTD REGD REG S                  | TECHNOLOGIE                 | 2,5                     | CHINA    |
| STUDIO CITY FINANCE LTD REGD REG S           | ZYKLISCHE KONSUMGÜTER       | 2,2                     | HONGKONG |

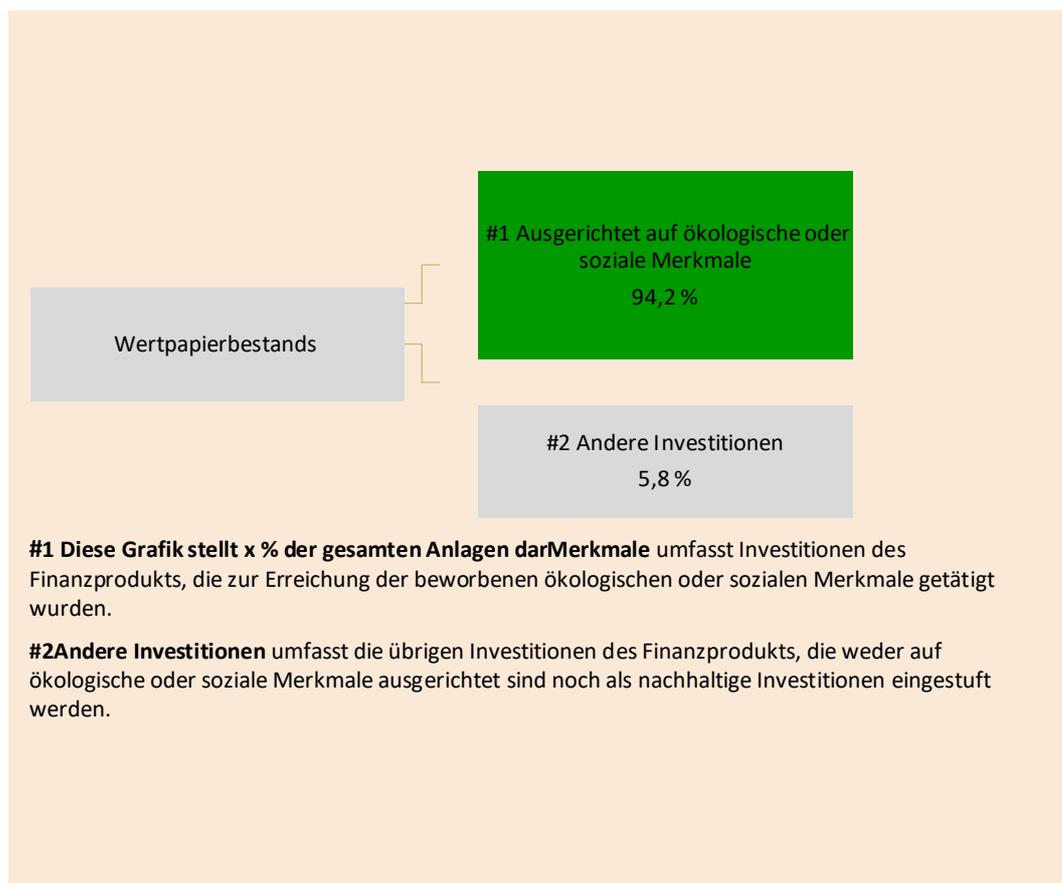


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Vermögensallokation des Portfolios im Bezugszeitraum wird in nachstehender Grafik dargestellt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager berechneten den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager und der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatten. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen.



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

| Wirtschaftssektoren - BICS  | In % der Vermögenswerte |
|-----------------------------|-------------------------|
| FINANZWERTEN                | 40,2                    |
| STAATLICH                   | 33,7                    |
| ZYKLISCHE KONSUMGÜTER       | 7,3                     |
| INDUSTRIE                   | 6,6                     |
| VERSORGUNG                  | 3,9                     |
| KOMMUNIKATION               | 2,7                     |
| NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 2,5                     |
| TECHNOLOGIE                 | 2,5                     |
| ENERGIE                     | 0,6                     |

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager können bestätigen, dass das Portfolio in Investitionen investiert hat, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Manager und der Sub-Investment-Manager werden das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessert.

### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

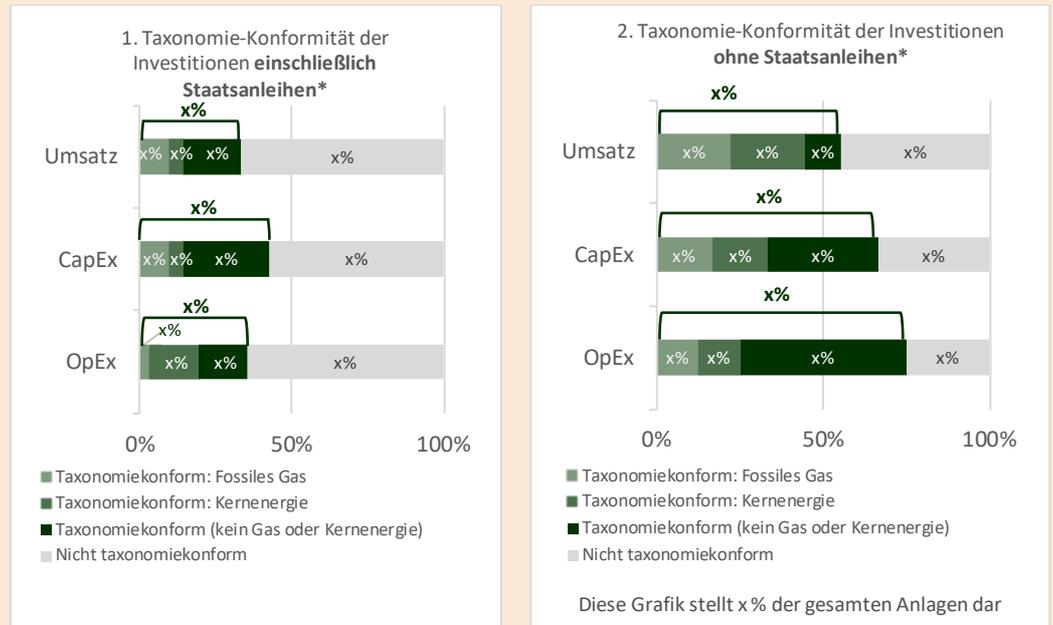
- Ja:
- In fossiles Gas     In Kernenergie
- Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten 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 Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. 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.



\* 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?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



### **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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

„Andere Investitionen“ umfasst die übrigen Investitionen des Portfolios, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren noch als nachhaltige Investitionen eingestuft wurden.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager und der Sub-Investment-Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachteten, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen, verhinderten und sie sicherstellen, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager wendeten bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager verstehen unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Managers und des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Managers und des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und soziale Ausschussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotienten herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Manager und vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

### II. Mitwirkung:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager engagierten sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager betrachteten diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil ihres Anlageprozesses. Die Fortschritte bei der Einbindung wurden vom Manager und dem Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### III. ESG-Sektor-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



### **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***  
k.A.
- ***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?***  
k.A.
- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***  
k.A.
- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***  
k.A.

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

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Climate Innovation Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 5493000I8IKJFVXLQ109

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser 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?

**Ja**

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

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht 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 60,6 %\* 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**

\*Weitere Einzelheiten zur Vermögensallokation des Portfolios (einschließlich des Engagements in nachhaltige Investitionen) finden Sie unter der Frage „*Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?*“

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

**Ökologische Merkmale:** Klimarisiken, THG-Emissionen, Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Wasserbewirtschaftung, Energiemanagement, Abfallentsorgung, Kraftstoffeffizienz, Gelegenheiten für saubere Technologien, Management des Produktlebenszyklus, Materialbeschaffung und Chemikaliensicherheit.

**Soziale Merkmale:** Betriebssicherheit und Krisenvorsorge, Zugang zu Finanzmitteln, Zugang zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen im Gemeinwesen, Datenschutz und -sicherheit, Gesundheit und Ernährung, Preistransparenz, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Vielfalt und Integration in der Belegschaft, Geschäftsethik, Produktsicherheit, -qualität und -integrität, Management systemischer Risiken, Management des Rechts- und Regulierungsumfelds und Lieferkettenmanagement.

Das Portfolio zielt auf Konformität mit einem Netto-Null-Ziel ab, wie im SFDR-Anhang und im Abschnitt „Nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten“ im Prospekt ausführlicher beschrieben.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

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

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB China ESG Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**NB**“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analyistenteam für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Unternehmen wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss. Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes NB-ESG-Quotient- oder externes Rating aufweisen, um im Laufe der Zeit eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachten) zu erreichen.

| Bezugszeitraum                           | Rating          | Bereich           | Kombinierte Abdeckung |
|--|-----------------|-------------------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient                          | ES: B<br>G: 2,7 | ES: A-D<br>G: 1-4 | 100 %                 |
| Rating aufgrund Daten von Drittanbietern | 6,9             | 0-10              |                       |

Im Hinblick auf das NB-ESG-Quotient-Rating für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale („ES“) werden die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance („G“) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jedes im Portfolio gehaltene Unternehmen erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums erfasste Climate Value-at-Risk („**CVaR**“) das Ausmaß der Risiken und der Chancen des Klimaübergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmen.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

|  |        |
|--|--------|
| Der CVaR prognostizierte, dass ein Szenario der Klimaerwärmung beim verwalteten Vermögen im Bezugszeitraum zu folgendem Wertverlust führen könnte. | -9,3 % |
| CVaR-Abdeckung im Bezugszeitraum.  | 96 %   |

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Suv-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

### 3. ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy, die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy, Ausschlüsse gemäß dem Paris-abgestimmten EU-Referenzwert („EU-PAB“), wie im Rahmen der Neuberger Berman EU Climate Benchmark Standard Exclusions Policy vorgesehen, und die sonstigen spezifischen Ausschlüsse identifiziert wurden, die im SFDR-Anhang des Portfolios angegeben sind, oder nicht mit diesen vereinbar waren. Zudem investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

#### Sonstiges

Im Bezugszeitraum brachte das Portfolio die Neuberger Berman Enhanced Sustainable Exclusion Policy nicht zur Anwendung.

Im Bezugszeitraum führte das Portfolio die EU-PAB-Ausschlüsse ein, wie im Rahmen der Neuberger Berman EU Climate Benchmark Standard Exclusions Policy vorgesehen. Die Neuberger Berman EU Climate Benchmark Standard Exclusions Policy wurde vom Sub-Investment-Manager erstellt zur Ausrichtung auf die Leitlinien der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde zu Fondsamen, die ESG- oder nachhaltigkeitsbezogene Begriffe verwenden.

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

Für den Bezugszeitraum 2023 wurden die angegebenen quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) ausnahmsweise anhand des Durchschnitts der Daten vom Ende des dritten und des vierten Kalenderquartals berechnet. Dies waren die einzigen Quartalsenden im Bezugszeitraum, die auf die Auflegung des Portfolios folgten.

### 1. NB-ESG-Quotient

|                            | <b>NB-ESG-Quotient-Rating</b> | <b>Rating der Daten durch externe Anbieter</b> | <b>Kombinierte Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| <b>Bereich</b>             | ES: A-D<br>G: 1-4             | 0-10   | 0-100 %                      |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | ES: B<br>G: 2,7               | 6,8  | 96 %                         |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | ES: B<br>G: 2,7               | 6,9  | 100 %                        |

### 2. CvaR

|                            | <b>CVaR</b> | <b>Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------|------------------|
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | -9,5 %      | 96 %             |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | -9,3 %      | 96 %             |

### 3. Ausschlüsse

|                            | <b>Gesamtzahl der Verstöße</b> |
|----------------------------|--------------------------------|
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 0                              |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 0                              |

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

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckte sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Anlage zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Anlage eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat, wie nachstehend erläutert, und (iii) auf eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die gute Unternehmensführung eines Unternehmens, um festzustellen, ob das Unternehmen einer derartigen Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griff der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die Wirtschaftstätigkeit eines Unternehmens auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren.

Der Sub-Investment-Manager überprüfte die Unternehmen auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Unternehmen dieser Prüfung standhielten, quantifizierte der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag der Unternehmen zur Wirtschaft.

Der Sub-Investment-Manager erfasste dies auf drei Arten:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden);
- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDGs“) und
- Unternehmen aus Sektoren mit großen Auswirkungen, die sich auf der Grundlage des NB Net-Zero Alignment Indicator auf einen Netto-Null-Kurs umstellen.

Im Bezugszeitraum aktualisierte der Sub-Investment Manager den SFDR-Anhang des Portfolios, um dem Umstand Rechnung zu tragen, dass der Sub-Investment Manager bei der Ermittlung nachhaltiger Investitionen Unternehmen aus Sektoren mit großen Auswirkungen berücksichtigt, die sich auf der Grundlage des NB Net-Zero Alignment Indicator auf einen Netto-Null-Kurs umstellen.

Die Beurteilung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs wurde durch die Verfügbarkeit von angemessenen, verfügbaren und überprüfbaren Daten eingeschränkt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griff der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Proxydaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

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

Der Sub-Investment-Manager wandte seinen Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigten. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachtete der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachhaltigen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele waren, die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Indikatoren für die wichtigsten nachhaltigen Auswirkungen (die „PAIs“):

| PAIs                          |  |
|-------------------------------|--|
| Thema                         | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen  |
| <i>Treibhausgasemissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind<br>PAI 5 - Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen<br>PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren |
| <i>Biodiversität</i>          | PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken   |
| <i>Wasser</i>                 | PAI 8 - Emissionen in Wasser   |

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.

|                                   |  |
|-----------------------------------|--|
| <i>Abfall</i>                     | PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle   |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | <p>PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen</p> <p>PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen</p> <p>PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle</p> <p>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen</p> <p>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)</p> |

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Sub-Investment-Manager hat auch Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen berücksichtigt. Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

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

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, dass die ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen des Portfolios nicht erheblich beeinträchtigt wurden, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Unternehmen, die unter die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen;
- Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Unternehmen, die unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

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

Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*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 EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



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

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Unternehmen durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

1. Wie oben unter „Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?“ erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele führten, alle PAIs berücksichtigt.
2. Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „PAIs auf Produktebene“):

| PAIs auf Produktebene  |   |
|------------------------|---|
| Thema                  | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen   |
| Treibhausgasemissionen | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |

*Soziales und Beschäftigung*

PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen  
 PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen  
 PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



**Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?**

Der Sub-Investment-Manager hat den Bloomberg Industry Classification Standard („**BICS**“) verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2024 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2024 – 31. Dezember 2024

| Größte Investitionen          | Sektor                      | In % der Vermögenswerte | Land            |
|-------------------------------|-----------------------------|-------------------------|-----------------|
| NVENT ELECTRIC PLC            | INDUSTRIE                   | 6,7                     | GROSSBRITANNIEN |
| GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT  | INDUSTRIE                   | 6,7                     | KANADA          |
| QUANTA SERVICES INC           | NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 6,0                     | USA             |
| DSM-FIRMENICH AG /EUR/        | GRUNDSTOFFE                 | 5,6                     | SCHWEIZ         |
| KIA CORP /KRW/                | ZYKLISCHE KONSUMGÜTER       | 5,4                     | KOREA           |
| HITACHI LTD /JPY/             | INDUSTRIE                   | 5,2                     | JAPAN           |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC        | INDUSTRIE                   | 4,5                     | IRLAND          |
| BYD CO LTD-H /HKD/            | ZYKLISCHE KONSUMGÜTER       | 3,2                     | CHINA           |
| XYLEM INC                     | INDUSTRIE                   | 2,7                     | USA             |
| HEIDELBERG MATERIALS AG /EUR/ | INDUSTRIE                   | 2,6                     | DEUTSCHLAND     |
| NEXTRACKER INC-CL A           | INDUSTRIE                   | 2,6                     | USA             |
| FIRST SOLAR INC               | ENERGIE                     | 2,5                     | USA             |
| IBERDROLA SA /EUR/            | VERSORGUNG                  | 2,5                     | SPANIEN         |

ON SEMICONDUCTOR  
NXP SEMICONDUCTORS NV

TECHNOLOGIE  
TECHNOLOGIE

2,4 USA  
2,2 NIEDERLANDE

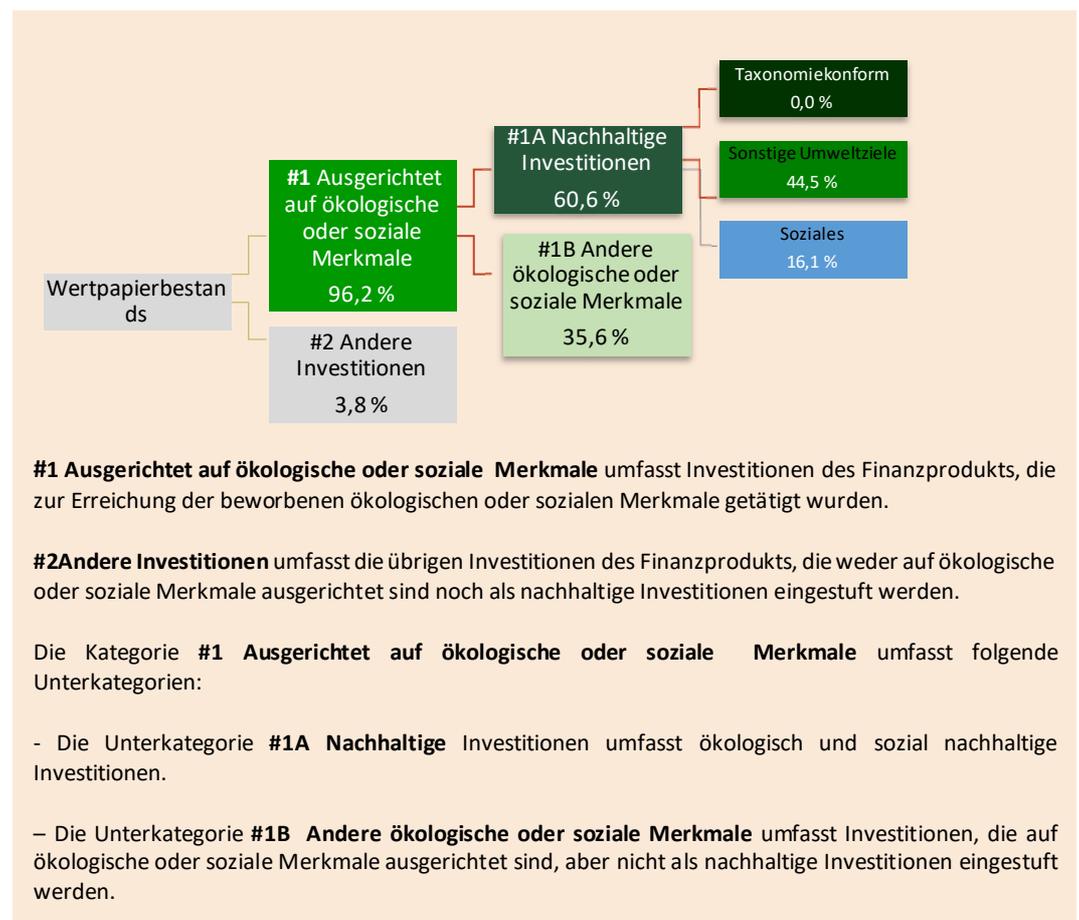


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Die Vermögensallokation des Portfolios im Bezugszeitraum wird in nachstehender Grafik dargestellt. Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder externen Anbietern beruhen.



● *In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?*

| <b>Wirtschaftssektoren - BICS</b> | <b>In % der Vermögenswerte</b> |
|-----------------------------------|--------------------------------|
| INDUSTRIE                         | 45,1                           |
| TECHNOLOGIE                       | 18,3                           |
| ZYKLISCHE KONSUMGÜTER             | 15,8                           |
| GRUNDSTOFFE                       | 7,3                            |
| NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER       | 6,4                            |
| ENERGIE                           | 3,8                            |
| VERSORGUNG                        | 2,5                            |
| FINANZWERTEN                      | 0,8                            |



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für

**Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

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

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

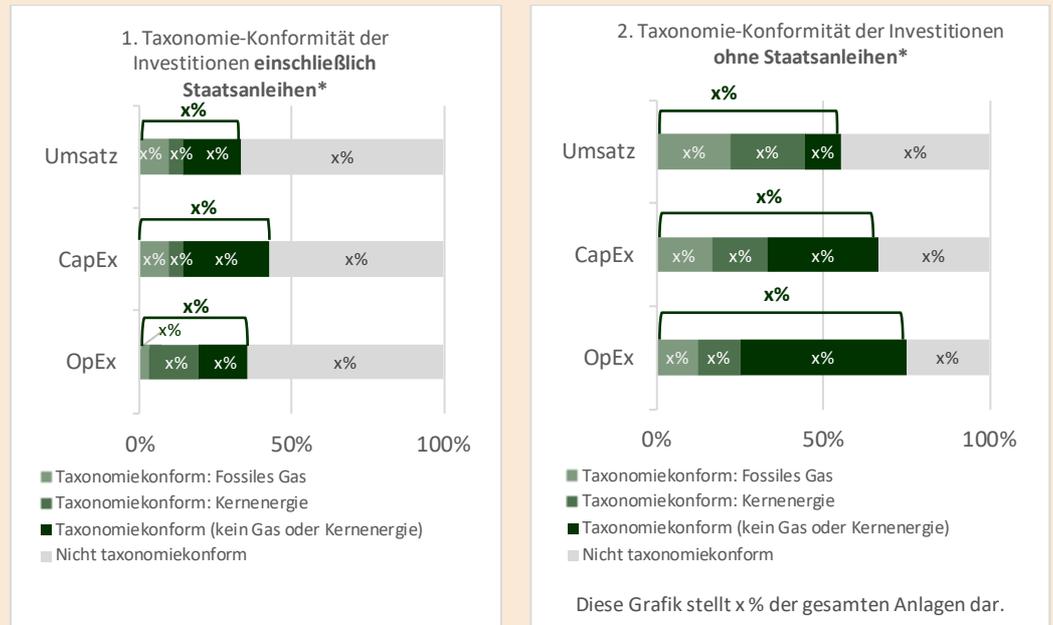
- Ja:
- In fossiles Gas  In Kernenergie
- Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten 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 Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* 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?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



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 nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Dies ist in der Grafik zur Vermögensallokation unter der Frage „Wie sah die Vermögensallokation aus?“ oben angegeben.



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

Dies ist in der Grafik zur Vermögensallokation unter der Frage „Wie sah die Vermögensallokation aus?“ oben angegeben.



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

„Andere Investitionen“ umfasst die übrigen Investitionen des Portfolios, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren noch als nachhaltige Investitionen eingestuft wurden.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten sowie Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das externe oder NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung eines Unternehmens besser zu erkennen, wobei darauf hingewiesen wird, dass der Schwerpunkt des Portfolios auf Investitionen in Unternehmen liegt, die an Technologien und/oder Aktivitäten im Zusammenhang mit der Klima-Innovation beteiligt sind oder davon profitieren.

Der Sub-Investment-Manager nutzte den NB-ESG-Quotienten und eine Bewertung der thematischen Reinheit zwecks Identifikation von Unternehmen, die im Bereich des langfristigen Trends der Klimainnovation operieren. Beteiligungen mit thematischer Reinheit werden als solche definiert, bei denen mindestens 50 % des zusätzlichen Gewinn-/Umsatzwachstums oder der Investitionsausgaben auf Aktivitäten im Zusammenhang mit der Klimainnovation ausgerichtet sind.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die thematische Beurteilung und die Gesamtbeurteilung des Unternehmens bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

### II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager arbeitete mit den Unternehmen mit einem soliden ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. ESG-Sektor-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wendete das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



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

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k.A.
- **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?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k.A.

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

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

Name des Produkts: Neuberger Berman CLO Income Fund (das „Portfolio“)

Unternehmenskennung: 54930003X66WAS12MV11

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser 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?

**Ja**

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

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht 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**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Das Portfolio wurde am 12. Dezember 2024 zum Artikel-8-Portfolio umklassifiziert. Diese regelmäßige Berichtsvorlage wurde daher auf der Grundlage der Portfolio positionen im Bezugszeitraum erstellt, da dies das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum ist, das auf die Umklassifizierung des Portfolios folgte (der „Bezugszeitraum“).



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

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Klima, THG-Emissionen und weltweite Umweltverschmutzung, Auswirkungen auf Landschaften, Ökosysteme und biologische Vielfalt und
- **Soziale Merkmale:** Kinderarbeit, Korruption, Bestechung, Erpressung und Geldwäsche, Zwangsarbeit, Menschenrechtsverletzungen und Mittäterschaft von Unternehmen und Arbeitsmedizin und Arbeitsschutz.

Die Performance bezüglich dieser ökologischen und sozialen Merkmale auf CLO-Sicherheitenebene wurde durch das NB-Rating gemessen, unterstützt durch Daten von Drittanbietern, und wird im Folgenden in aggregierter Form dargestellt.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio auf der Ebene der den CLO-Wertpapieren zugrunde liegenden Sicherheiten beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Erteilung eines NB-Ratings:

Das NB-Rating ist eine interne Analyseverfahren, die vom Research-Analystenteam des Sub-Investment-Managers entwickelt und gepflegt wird (unterstützt durch Daten von Drittanbietern). Das NB-Rating fußt auf dem Konzept finanziell wesentlicher ESG-Risiken, die für sämtliche CLO-Wertpapieren zugrunde liegenden Sicherheiten berücksichtigt wurden.

Das NB-Rating wurde für die den CLO-Wertpapieren zugrunde liegenden Sicherheiten erteilt und beruhte auf der Berücksichtigung der vorstehend aufgeführten ökologischen und sozialen Merkmale. Inwieweit ein einzelnes ökologisches und soziales Merkmal auf CLO-Sicherheitenebene in das (dem Schuldtitle) erteilte NB-Rating einfließt, richtete sich nach der Relevanz und der Wesentlichkeit des spezifischen Merkmals für den Emittenten der Unternehmensanleihe und nach dem Industriesektor des Marktes für Unternehmensanleihen wie gemäß der subjektiven Analyse des Sub-Investment-Managers bestimmt.

Das NB-Rating liegt auf einer Skala von 1 bis 5, wobei ,1' das höchste und ,5' das niedrigste Rating darstellt. ,2' entspricht einem ,zufriedenstellenden' Rating, bei dem keine wesentlichen ESG-Risiken oder negative ESG-Ereignisse festgestellt wurden.

Der Sub-Investment-Manager stellte sicher, dass die den vom Portfolio gehaltenen CLO-Wertpapieren zugrunde liegenden Sicherheiten ein NB-Rating aufwiesen.

#### 2. Leistung des NB-Ratings:

Der Sub-Investment-Manager misst die Leistung der ökologischen und sozialen Merkmale auf der Ebene der CLO-Sicherheiten durch das NB-Rating, das im Folgenden in aggregierter Form dargestellt wird.

- Der Sub-Investment-Manager stellte sicher, dass das Portfolio auf der Portfolioebene (auf der sämtliche Sicherheiten für alle vom Portfolio gehaltenen CLO-Wertpapiere aggregiert werden) eine höhere Konzentration der NB-Ratings ,1' und ,2' aufwies als das investierbare Universum (wie nachstehend definiert). Das investierbare Universum war definiert als sämtliche Euro-CLO-Wertpapiere sowie: (i) USD-CLO-Wertpapiere, die vor 2019 emittiert wurden und (ii) USD-CLO-Wertpapiere die nach November 2022 emittiert wurden. Die nach November 2022 emittierten USD-CLO-Wertpapiere müssen die Regelungen der EU zum Risikoseibstbehalt und die Berichterstattungsstandards gemäß Artikel 7 der EU-Verbriefungsverordnung einhalten (das „investierbare Universum“).

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

- Der Sub-Investment-Manager stellte sicher, dass mindestens 70 % der CLO-Wertpapieren zugrunde liegenden Sicherheiten ein NB-Rating von ‚1‘ oder ‚2‘ aufwiesen. Dies wurde insgesamt für alle Portfoliopositionen berechnet und ist in nachstehender Tabelle angegeben.

|   | <b>Mindestverpflichtung auf Wertpapiererebene</b> | <b>Erreichte Mindestverpflichtung auf Wertpapiererebene</b>   | <b>Investierbares Universum von CLO-Tranchen</b> | <b>Fondsübergreifendes Engagement in mit ‚1‘ und ‚2‘ eingestuftem Krediten</b> |
|---|---|---|--|--|
| <b>Gehaltene Kredite mit einem NB-Rating von ‚1‘ oder ‚2‘ nach den CLO-Wertpapieren zugrunde liegenden Sicherheiten während des Bezugszeitraums</b> | 70 %  | Ja - 100 % der gehaltenen CLO-Wertpapiere weisen ein Engagement von mindestens 70 % in mit ‚1‘ oder ‚2‘ eingestuftem Krediten auf | 79,8 %   | 81,8 %   |

### 3. ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Der Sub-Investment-Manager stellte sicher, dass das Portfolio nicht in CLO-Wertpapiere investierte, die als solche ermittelt wurden, die mit Kreditnehmern assoziierte Kreditsicherheiten enthielten, die nachweislich gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstießen. Ebenso investierte das Portfolio nicht in CLOs, die als solche ermittelt wurden, die mit Kreditnehmern assoziierten Sicherheiten enthielten, die gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstießen, was alle Kreditnehmer ausschließt, die gegen die UNGC-Grundsätze, die OECD-Leitsätze, die UNGPs und die ILO-Normen verstoßen. Der Sub-Investment-Manager wendete auch die übrigen spezifischen Ausschlüsse an, die im SFDR-Anhang des Portfolios angegeben sind.

Der Sub-Investment-Manager bewertete unverbindlich die Verfahrensweisen der Unternehmensführung einer Auswahl von CLO-Managern anhand des Annual CLO Manager Questionnaire. Dieser Fragebogen verlangte Antworten auf Fragen, die sich insbesondere auf die Neuberger Berman ESG Policy, Verfahrensweisen der Unternehmensführung, Research- und Investmentprozesse, Risikoüberwachung und Mitwirkung beim Kreditnehmer bezogen.

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

Nicht zutreffend – dies ist der erste Bezugszeitraum.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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?***

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

k.A.

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

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager nicht in CLO investiert, deren zugrunde liegendes Kreditportfolio als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurde (oder nicht diesen vereinbar war), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*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 EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

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

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



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

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, wichtigste nachteilige Auswirkungen zu berücksichtigen.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat den Bloomberg Industry Classification Standard („BICS“) verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten CLO-Tranchen des Portfolios zu ermitteln.

Die wichtigsten vom Portfolio zum 31. Dezember 2024 gehaltenen CLO-Tranchen waren:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 31. Dezember 2024

| Größte Investitionen                               | Sektor  | In % der Vermögenswerte | Land         |
|--|---|-------------------------|--------------|
| UNITED STATES TREASURY BILL ZCP                    | STAATLICH                                       | 7,8                     | USA          |
| ARBOUR CLO XIII DAC SER 13X CL E V/R REGD REG S /E | FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE (ABS-ANLEIHEN) | 1,0                     | IRLAND       |
| AGL CLO 37 LTD SER 2024-37X CL E V/R REGD REG S    | FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE (ABS-ANLEIHEN) | 0,7                     | KAIMANINSELN |
| GOLDENTREE LOAN MANAGEMENT EUR CLO 5 DAC SER 5X CL | FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE (ABS-ANLEIHEN) | 0,6                     | IRLAND       |
| TRINITAS EURO CLO VII DAC SER 7X CL E V/R REGD REG | FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE (ABS-ANLEIHEN) | 0,6                     | IRLAND       |
| BAIN CAPITAL CREDIT CLO 2024-4 LTD SER 2024-4X CL  | FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE (ABS-ANLEIHEN) | 0,6                     | KAIMANINSELN |
| AQUEDUCT EUROPEAN CLO 10 DAC SER 2024-10X CL E V/R | FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE (ABS-ANLEIHEN) | 0,6                     | IRLAND       |
| WATERSTOWN PARK CLO DAC SER 2024-1X CL E V/R REGD  | FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE (ABS-ANLEIHEN) | 0,6                     | IRLAND       |
| SYMPHONY CLO 46 LTD SER 2024-46X CL E V/R REGD REG | FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE (ABS-ANLEIHEN) | 0,6                     | KAIMANINSELN |
| AVOCA CAPITAL CLO X LTD SER 10X CL ERR V/R REGD RE | FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE (ABS-ANLEIHEN) | 0,6                     | IRLAND       |
| OAKTREE CLO 2024-28 LTD SER 2024-28X CL E V/R REGD | FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE (ABS-ANLEIHEN) | 0,6                     | KAIMANINSELN |
| SIXTH STREET CLO 27 LTD SER 2024-27X CL E V/R REGD | FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE (ABS-ANLEIHEN) | 0,6                     | KAIMANINSELN |
| SYMPHONY CLO 39 LTD SER 2023-39X CL ER V/R REGD RE | FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE (ABS-ANLEIHEN) | 0,6                     | BERMUDA      |
| TRESTLES CLO VII LTD SER 2024-7X CL E V/R REGD REG | FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE (ABS-ANLEIHEN) | 0,6                     | KAIMANINSELN |
| OCP EURO CLO 2022-5 DAC SER 2022-5X CL E V/R REGD  | FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE (ABS-ANLEIHEN) | 0,6                     | IRLAND       |



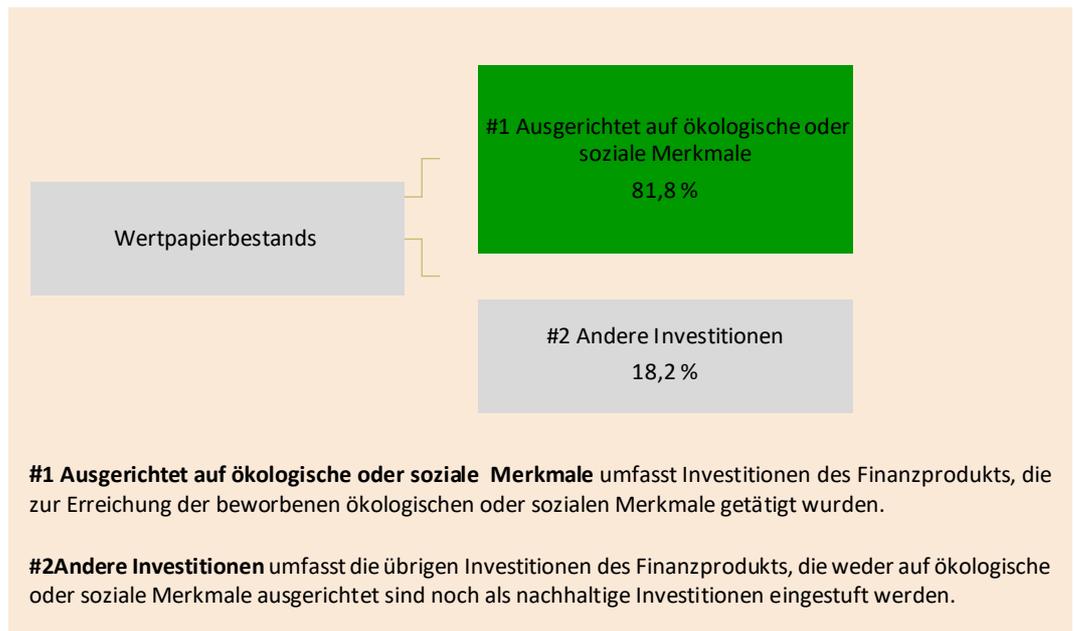
## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Sub-Investment-Manager berechnete den auf mit dem Portfolio beworbene ökologische und/oder soziale Merkmale ausgerichteten Anteil der Investitionen als zugrunde liegende Sicherheiten mit einem NB-Rating von ‚1‘ oder ‚2‘. Jede von dem Portfolio gehaltene zugrunde liegende Sicherheit ohne ein NB-Rating von ‚1‘ oder ‚2‘ wurde in dem Abschnitt „Andere Investitionen“ des Portfolios erfasst.

Die Vermögensallokation des Portfolios im Bezugszeitraum wird in nachstehender Grafik dargestellt. Diese Berechnung kann auf unvollständigen oder unrichtigen Daten von Emittenten oder Drittanbietern beruhen.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.



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

Die wichtigsten Wirtschaftssektoren der vom Portfolio zum 31. Dezember 2024 gehaltenen CLO-Tranchen waren folgende:

| Wirtschaftssektoren - BICS                      | In % der Vermögenswerte |
|---|-------------------------|
| FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE (ABS-ANLEIHEN) | 92,2                    |
| STAATLICH                                       | 7,8                     |



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

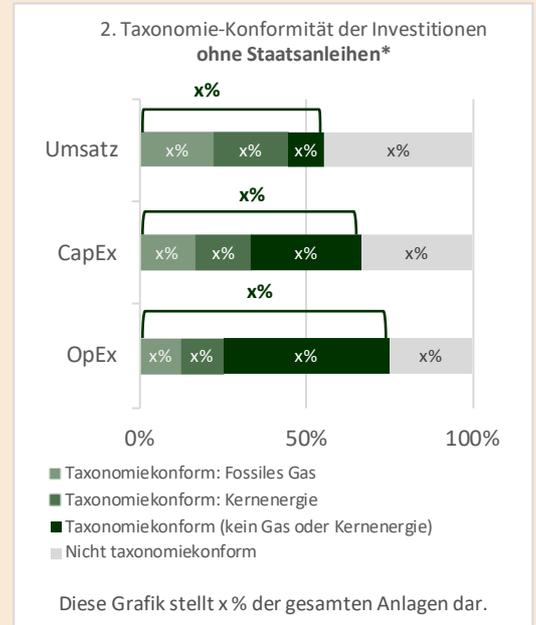
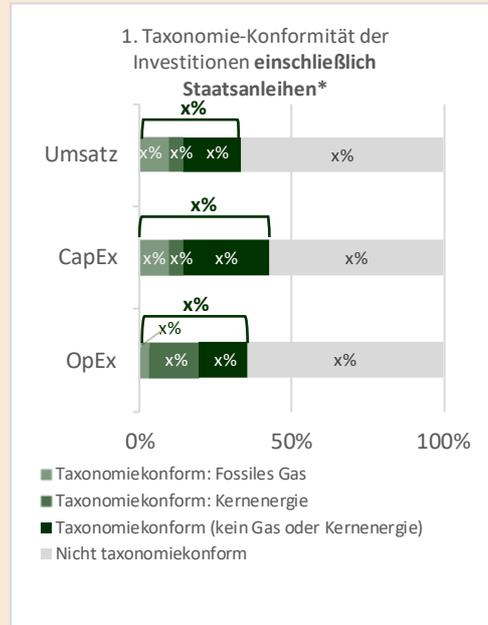
- Ja:
- In fossiles Gas  In Kernenergie
- Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten 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 Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. 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.



\* 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?**

Nicht zutreffend – das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – dies ist der erste Bezugszeitraum.



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 nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



### Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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

„Andere Investitionen“ umfasst die übrigen Investitionen des Portfolios, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren noch als nachhaltige Investitionen eingestuft wurden.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten. Er umfasst auch zugrunde liegende Sicherheiten mit einem NB-Rating von ‚3‘ oder niedriger.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Das NB-Rating ergänzte die qualitative Analyse des Sub-Investment-Managers durch quantitative Daten, um ESG-Faktoren und alle finanziell wesentlichen Faktoren ganzheitlich zu betrachten, die sich auf die Leistung und den Ausblick eines Unternehmens auswirken können.

Vorbehaltlich der Verfügbarkeit von Daten berücksichtigte das NB-Rating die einzelnen Unternehmen und ihre Schuldtitel (die Teil der Sicherheiten von CLO-Wertpapieren sind) und erteilte den Schuldtiteln anschließend ein NB-Rating auf der Grundlage der Berücksichtigung der vorstehenden ökologischen und sozialen Merkmale auf der Ebene der CLO-Sicherheiten. Inwieweit ein einzelnes ökologisches oder soziales Merkmal auf CLO-Sicherheitenebene in das (dem Schuldtitel) erteilte NB-Rating einfluss, richtete sich nach der Relevanz und der Wesentlichkeit des spezifischen Merkmals für den Emittenten der Unternehmensanleihe und nach dem Industriesektor des Marktes für Unternehmensanleihen wie gemäß der subjektiven Analyse des Sub-Investment-Managers bestimmt.

### II. Mitwirkung:

Aufgrund des Charakters der Anlageklasse kann der Sub-Investment-Manager nicht direkt auf Unternehmen einwirken, die wesentlichen ESG-Risiken oder negativen ESG-Ereignissen ausgesetzt sind. Stattdessen bewertet er die CLO-Manager anhand des ‚Annual CLO Manager Questionnaire‘.

### III. ESG-Sektor-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

### ● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

k.A.

### ● **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?**

k.A.

### ● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

k.A.

---

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 im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k.A.

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300TMYI9EFR4Q1G47

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser 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?

**Ja**

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

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht 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 26,9 % 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**

\*Weitere Einzelheiten zur Vermögensallokation des Portfolios (einschließlich des Engagements in nachhaltigen Investitionen) finden Sie nachfolgend unter der Frage „*Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?*“.

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Sofem in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen,

die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, verantwortliche und transparente Risikoübernahme, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung, Wasserbewirtschaftung und Entsorgung gefährlicher Abfälle.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Geschäftsethik; Chemikaliensicherheit, Beziehungen im Gemeinwesen, umstrittene Beschaffung, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität, verantwortungsbewusste Werbung, Etikettierung und Marketing und Menschenrechte.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB China ESG Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („NB“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sekorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analyistenteam für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Emittenten ein, die einen schlechten NB-ESG-Quotienten aufweisen, um im Laufe der Zeit eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachen) zu erreichen.

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

| Bezugszeitraum    | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|--------|---------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient   | 60     | 1-100   | 100 %                 |
| Daten von Dritten | 7,4    | 0-10    |                       |

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums wurde mit Climate Value-at-Risk („**CVaR**“) das Ausmaß der Risiken und Chancen des Übergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmensemittenten gemessen.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts einer Emission oder eines Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

|  |        |
|--|--------|
| Der CVaR prognostizierte, dass ein Szenario der Klimaerwärmung beim verwalteten Vermögen im Bezugszeitraum zu folgendem Wertverlust führen könnte. | -3,4 % |
| CVaR-Abdeckung im Bezugszeitraum.  | 62 %   |

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

### 3. ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy und die sonstigen spezifischen Ausschlüsse identifiziert wurden, die im SFDR-Anhang des Portfolios angegeben sind, oder nicht mit diesen vereinbar waren. Zudem investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

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

Ausnahmsweise wurden für den Bezugszeitraum 2022 die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgte (sie umfassen die Veröffentlichung der SFDR-Vorlagen für vorvertragliche Informationen).

#### 1. Der NB-ESG-Quotient

|                            | <b>NB-ESG-Quotient-Rating</b> | <b>Rating der Daten durch externe Anbieter</b> | <b>Kombinierte Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| <b>Bereich</b>             | 1-100                         | 0-10   | 0-100 %                      |
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 58                            | 6,9  | 96 %                         |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 59                            | 7,3  | 100 %                        |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 60                            | 7,4  | 100 %                        |

2. CVaR

|                            | CVaR   | Abdeckung |
|----------------------------|--------|-----------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | -5,2 % | 41 %      |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | -5,4 % | 56 %      |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | -3,4 % | 62 %      |

3. Ausschlüsse

|                            | Gesamtzahl der Verstöße |
|----------------------------|-------------------------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 0                       |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 0                       |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 0                       |

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

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es während des Bezugszeitraums kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckte sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Anlage zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Anlage eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat (wie nachstehend erläutert) und (iii) auf eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die gute Unternehmensführung eines Emittenten, um festzustellen, ob der Emittent einer derartigen Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griff der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die Wirtschaftstätigkeit eines Emittenten auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren.

Der Sub-Investment-Manager überprüfte die Emittenten auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Emittenten diese Prüfung bestanden haben, hat der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag des Emittenten zur Wirtschaft gemessen.

Der Sub-Investment-Manager erfasste dies auf drei Arten:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden);
- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDGs“) und
- Untermehensemittenten in Sektoren mit großen Auswirkungen, die sich auf der Grundlage des NB Net-Zero Alignment Indicator auf einen Netto-Null-Kurs umstellen.

Im Bezugszeitraum aktualisierte der Sub-Investment Manager den SFDR-Anhang des Portfolios, um dem Umstand Rechnung zu tragen, dass der Sub-Investment Manager bei der Ermittlung nachhaltiger Investitionen Emittenten aus Sektoren mit großen Auswirkungen berücksichtigt, die sich auf der Grundlage des NB Net-Zero Alignment Indicator auf einen Netto-Null-Kurs umstellen.

Die Beurteilung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs wurde durch die Verfügbarkeit von angemessenen, verfügbaren und überprüfbaren Daten eingeschränkt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griff der Sub-Investment-Manager auf Daten

von Drittanbietern und Proxydaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

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.

| PAIs                              |   |
|-----------------------------------|---|
| Thema                             | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen   |
| <i>Treibhausgasemissionen</i>     | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind<br>PAI 5 - Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen<br>PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren  |
| <i>Biodiversität</i>              | PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken  |
| <i>Wasser</i>                     | PAI 8 - Emissionen in Wasser  |
| <i>Abfall</i>                     | PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle  |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen<br>PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen<br>PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle<br>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen<br>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

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

Der Sub-Investment-Manager wandte seinen Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigten. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachtete der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele waren, die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (die „PAIs“):

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte ferner Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen und investierte nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden oder nicht mit diesen übereinstimmen, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

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

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, dass die ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen des Portfolios nicht erheblich beeinträchtigt wurden, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Emittenten, die quantitative und qualitative Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI festgelegt wurden, unterschreiten;
- Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Emittenten, wenn sie unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

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

Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*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 EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

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

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



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

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

1. Wie oben unter „*Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?*“ erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele führten, alle PAIs berücksichtigt.
2. Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

| PAIs auf Produktebene  |   |
|------------------------|---|
| Thema                  | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen   |
| Treibhausgasemissionen | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |

|                                   |  |
|-----------------------------------|--|
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen<br><br>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen<br><br>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |
|-----------------------------------|--|

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



### Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat den Bloomberg Industry Classification Standard („**BICS**“) verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2024 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2024 – 31. Dezember 2024

| Größte Investitionen                               | Sektor                | In % der Vermögenswerte | Land             |
|--|-----------------------|-------------------------|------------------|
| ELECTRICITE DE FRANCE SA /GBP/ REGD V/R /PERP/ EMT | VERSORGUNG            | 4,9                     | FRANKREICH       |
| VOLKSWAGEN INTL FIN NV /EUR/ REGD V/R /PERP/ REG S | ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 4,5                     | NIEDERLANDE      |
| SOUTHERN CO /EUR/ REGD V/R                         | VERSORGUNG            | 4,4                     | USA              |
| NGG FINANCE PLC /GBP/ REGD V/R REG S SER GBP       | VERSORGUNG            | 4,0                     | GROSS-BRITANNIEN |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT SA /EUR/ REGD V/R /PERP/ REG  | VERSORGUNG            | 3,7                     | FRANKREICH       |
| BP CAPITAL MARKETS PLC /EUR/ REGD V/R /PERP/ REG S | ENERGIE               | 3,4                     | GROSS-BRITANNIEN |
| IBERDROLA FINANZAS SAU /EUR/ REGD V/R /PERP/ REG S | VERSORGUNG            | 3,3                     | SPANIEN          |
| HEIMSTADEN BOSTAD AB /EUR/ REGD V/R /PERP/ REG S   | FINANZWERTEN          | 3,2                     | SCHWEDEN         |
| TENNET HOLDING BV /EUR/ REGD V/R /PERP/ REG S      | VERSORGUNG            | 3,1                     | NIEDERLANDE      |
| ELIA GROUP SA/NV /EUR/ REGD V/R /PERP/ REG S       | VERSORGUNG            | 3,1                     | BELGIEN          |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFLD /EUR/ REGD V/R /PERP/ REG  | FINANZWERTEN          | 3,0                     | FRANKREICH       |

|  |               |     |                  |
|--|---------------|-----|------------------|
| ENEL SPA /EUR/ REGD V/R /PERP/ REG S               | VERSORGUNG    | 3,0 | ITALIEN          |
| BRITISH TELECOMMUNICATIO /GBP/ REGD V/R REG S EMTN | KOMMUNIKATION | 3,0 | GROSS-BRITANNIEN |
| SSE PLC /EUR/ REGD V/R /PERP/ REG S                | VERSORGUNG    | 2,8 | GROSS-BRITANNIEN |
| ENBW ENERGIE BADEN - WU /EUR/ REGD V/R REG S       | VERSORGUNG    | 2,8 | DEUTSCHLAND      |

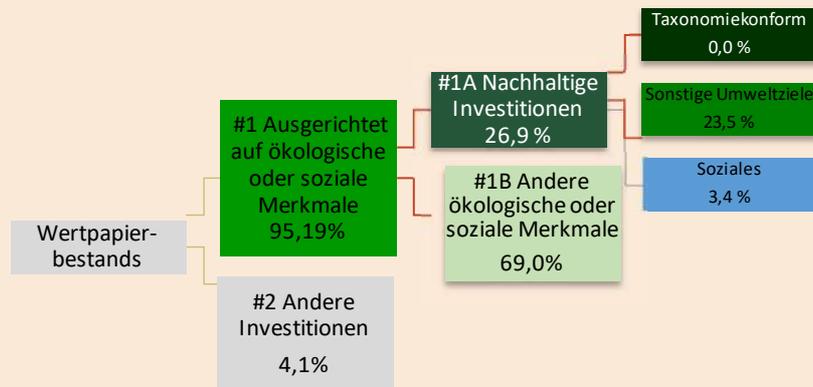


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### ● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Die Vermögensallokation des Portfolios im Bezugszeitraum wird in nachstehender Grafik dargestellt. Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen.



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

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

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige** Investitionen umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

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

| Wirtschaftssektoren - BICS  | In % der Vermögenswerte |
|-----------------------------|-------------------------|
| VERSORGUNG                  | 56,0                    |
| KOMMUNIKATION               | 13,9                    |
| ENERGIE                     | 13,3                    |
| FINANZWERTEN                | 6,9                     |
| ZYKLISCHE KONSUMGÜTER       | 4,5                     |
| GRUNDSTOFFE                 | 3,4                     |
| NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 1,8                     |
| INDUSTRIE                   | 0,2                     |



## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

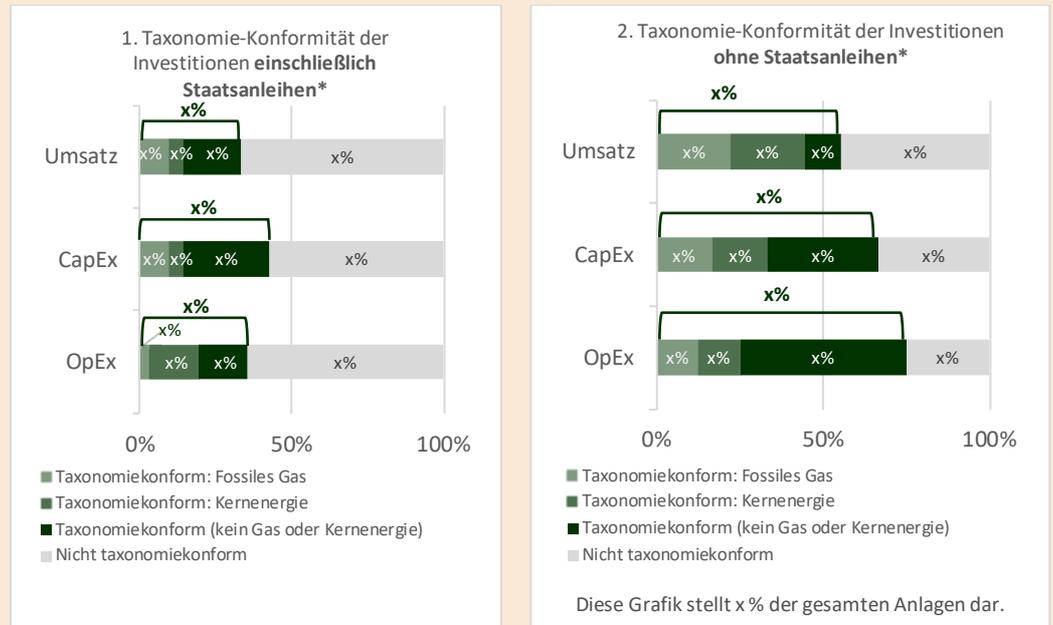
- Ja:
- In fossiles Gas  In Kernenergie
- Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten 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 Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* 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?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



## Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Dies ist in der Grafik zur Vermögensallokation unter der Frage „Wie sah die Vermögensallokation aus?“ oben angegeben.



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?

Dies ist in der Grafik zur Vermögensallokation unter der Frage „Wie sah die Vermögensallokation aus?“ oben angegeben.



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

„Andere Investitionen“ umfasst die übrigen Investitionen des Portfolios, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren noch als nachhaltige Investitionen eingestuft wurden.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Emittenteanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten sowie Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in seine internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

### II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Er strebte danach, konstruktiven Dialogen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### III. ESG-Sektor-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



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

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k.A.
- **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?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k.A.

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

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Developed Market FMP – 2027 (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300GF7EOMWXAHXG64

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser 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?

**Ja**

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

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht 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**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben zudem die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung dieser ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

Angesichts des Anlageziels, der Anlagedauer und des Fälligkeitsdatums am 31. Juli 2027 (das „Fälligkeitsdatum“) war der Portfolioumschlag begrenzt. Obwohl das Portfolio während seiner gesamten Lebensdauer ökologische und soziale Merkmale bewerben wird, konzentrierte sich die Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale auf die Aufbauphase des Portfolios.

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, THG-Emissionen, Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, verantwortliche und transparente Risikoübernahme, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung, Wasserbewirtschaftung und Entsorgung gefährlicher Abfälle.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Geschäftsethik; Chemikaliensicherheit, Beziehungen im Gemeinwesen, umstrittene Beschaffung, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität, verantwortungsbewusste Werbung, Etikettierung und Marketing und Menschenrechte.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „NB- ESG-Quotient“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB China ESG Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („NB“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analytenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergreift, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Darüber hinaus bemühte sich der Sub-Investment-Manager, konstruktiven Dialogen bei Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating Vorrang einzuräumen, um zu beurteilen, ob Bedenken angemessen berücksichtigt wurden.

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

| Bezugszeitraum    | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|--------|---------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient   | 61     | 1-100   | 100 %                 |
| Daten von Dritten | 6,5    | 0-10    |                       |

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums wurde mit Climate Value-at-Risk („**CVaR**“) das Ausmaß der Risiken und Chancen des Übergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmensemittenten gemessen.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts einer Emission oder eines Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

|  |        |
|--|--------|
| Der CVaR prognostizierte, dass ein Szenario der Klimaerwärmung beim verwalteten Vermögen im Bezugszeitraum zu folgendem Wertverlust führen könnte. | -7,7 % |
| CVaR-Abdeckung im Bezugszeitraum.  | 86 %   |

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Suv-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

### 3. ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy und die sonstigen spezifischen Ausschlüsse identifiziert wurden, die im SFDR-Anhang des Portfolios angegeben sind, oder nicht mit diesen vereinbar waren. Zudem investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

Da das Portfolio darauf abzielte, eine Rendite über eine bestimmte Laufzeit zu erzielen, die am Fälligkeitsdatum endet, war der Portfolioumschlag begrenzt.

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

Für den Bezugszeitraum 2023 wurden die angegebenen quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) ausnahmsweise anhand des Durchschnitts der Daten vom Ende des dritten und des vierten Kalenderquartals berechnet. Dies waren die einzigen Quartalsenden im Bezugszeitraum, die auf die Auflegung des Portfolios folgten.

#### 1. NB-ESG-Quotient

|                            | <b>NB-ESG-Quotient-Rating</b> | <b>Rating der Daten durch externe Anbieter</b> | <b>Kombinierte Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| <b>Bereich</b>             | 1-100                         | 0-10   | 0-100 %                      |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 60                            | 6,4  | 100 %                        |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 61                            | 6,5  | 100 %                        |

#### 2. CVaR

|                            | <b>CVaR</b> | <b>Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------|------------------|
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | -10,1 %     | 83 %             |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | -7,7 %      | 86 %             |

### 3. Ausschlüsse

|                     | Gesamtzahl der Verstöße |
|---------------------|-------------------------|
| Bezugszeitraum 2023 | 0                       |
| Bezugszeitraum 2024 | 0                       |

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten. Dessen ungeachtet war der Sub-Investment-Manager nicht in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst 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.

*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 EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

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

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



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

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

| PAIs auf Produktebene             |  |
|-----------------------------------|--|
| Thema                             | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen  |
| <i>Treibhausgasemissionen</i>     | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind  |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen<br>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen<br>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbar Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



### Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat den Bloomberg Industry Classification Standard („BICS“) verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem über die vier Kalenderquartalsenden des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitt basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2024 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2024 – 31. Dezember 2024

| Größte Investitionen                  | Sektor  | In % der Vermögenswerte | Land            |
|---------------------------------------|---|-------------------------|-----------------|
| SANTANDER UK GROUP HLDGS REGD V/R     | FINANZWERTEN  | 2,8                     | GROSSBRITANNIEN |
| BPCE SA REGD 144A P/P MTN             | FINANZWERTEN  | 2,7                     | FRANKREICH      |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CO REGD         | FINANZWERTEN  | 2,7                     | USA             |
| AIR LEASE CORP REGD                   | FINANZWERTEN  | 2,7                     | USA             |
| AERCAP IRELAND CAP/GLOBA REGD         | FINANZWERTEN  | 2,7                     | IRLAND          |
| MORGAN STANLEY REGD MTN               | FINANZWERTEN  | 2,6                     | USA             |
| GENERAL MOTORS FINL CO REGD           | ZYKLISCHE KONSUMGÜTER                                   | 2,5                     | USA             |
| MICRON TECHNOLOGY INC REGD            | TECHNOLOGIE<br>NICHT-ZYKLISCHE<br>KONSUMGÜTER           | 2,5                     | USA             |
| VIATRIS INC REGD SER WI               | KONSUMGÜTER   | 2,5                     | USA             |
| NATIONWIDE BLDG SOCIETY REGD 144A P/P | FINANZWERTEN  | 2,5                     | GROSSBRITANNIEN |
| PARAMOUNT GLOBAL REGD                 | KOMMUNIKATION   | 2,5                     | USA             |
| UBS GROUP AG REGD                     | FINANZWERTEN  | 2,5                     | SCHWEIZ         |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC REGD         | FINANZWERTEN  | 2,5                     | GROSSBRITANNIEN |
| FORD MOTOR CREDIT CO LLC REGD         | ZYKLISCHE KONSUMGÜTER<br>NICHT-ZYKLISCHE<br>KONSUMGÜTER | 2,5                     | USA             |
| IMPERIAL BRANDS FIN PLC REGD 144A P/P | KONSUMGÜTER   | 2,4                     | GROSSBRITANNIEN |

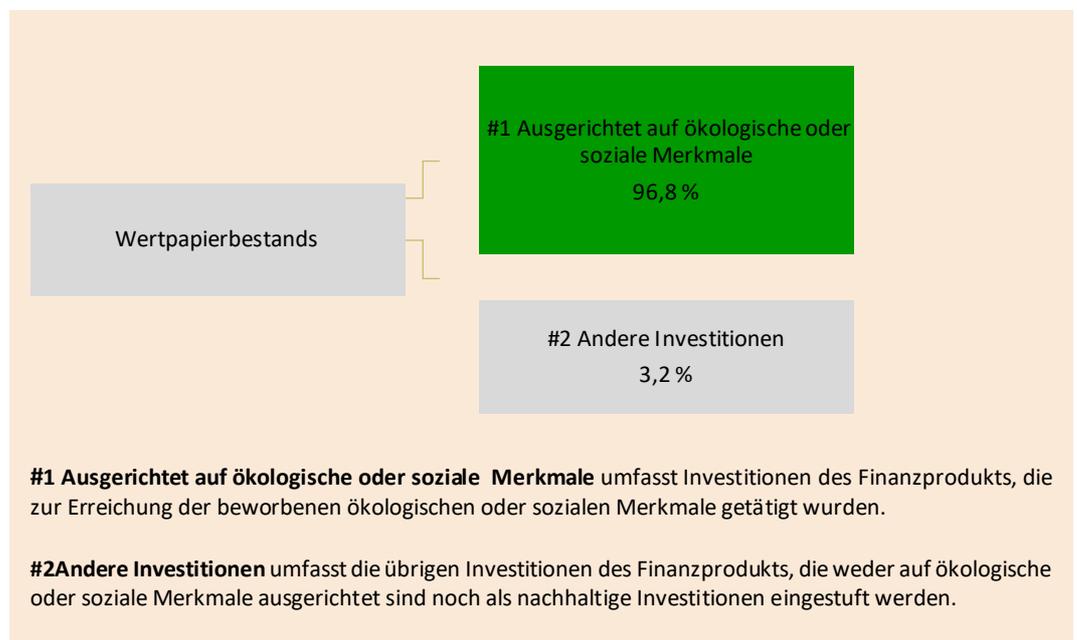


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### ● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Die Vermögensallokation des Portfolios im Bezugszeitraum wird in nachstehender Grafik dargestellt. Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder Dritten beruhen.



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

| Wirtschaftssektoren - BICS  | In % der Vermögenswerte |
|-----------------------------|-------------------------|
| FINANZWERTEN                | 36,3                    |
| ZYKLISCHE KONSUMGÜTER       | 13,8                    |
| NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 13,8                    |
| ENERGIE                     | 11,2                    |
| KOMMUNIKATION               | 7,6                     |
| TECHNOLOGIE                 | 7,4                     |
| INDUSTRIE                   | 5,7                     |
| VERSORGUNG                  | 3,2                     |
| GRUNDSTOFFE                 | 1,0                     |



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

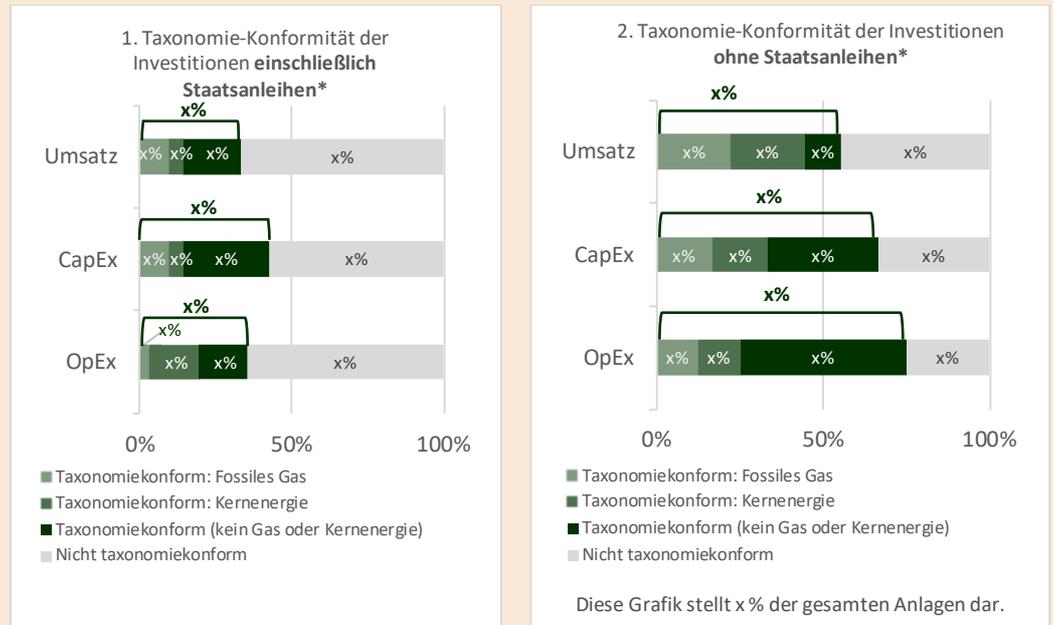
- Ja:  
 In fossiles Gas  In Kernenergie
- Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten 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 Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. 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.



\* 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?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



## Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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

„Andere Investitionen“ umfasst die übrigen Investitionen des Portfolios, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren noch als nachhaltige Investitionen eingestuft wurden.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

In Anbetracht des Anlageziels, der Anlagedauer und des Fälligkeitstermins des Portfolios werden zwar während der gesamten Laufzeit des Portfolios ökologische und soziale Merkmale beworben, doch konzentrierte sich die Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale auf die Aufbauphase des Portfolios, da es die Absicht des Sub-Investment-Managers war, einen geringen Portfolioumschlag zu haben.

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Emittenteanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten sowie Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

### II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Sub-Investment-Manager erachtete diese Zusammenarbeit mit Emittenten als wichtigen Bestandteil seines Anlageprozesses, der es ihm ermöglichte sicherzustellen, dass die erstmalige Beurteilung des Emittenten (bei Auflage) weiterhin zutreffend war und in die laufende Bewertung durch das NB-ESG-Quotient-Rating einfluss. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. ESG-Sektor-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wendete das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



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

Nicht zutreffend – Das Portfolio verwendet keinen Referenzwert.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k.A.
- **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?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k.A.

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

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman EMD Corporate – Social and Environmental Transition Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300GFVSJXLSLRQ502

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser 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?

**Ja**

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

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht 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 50,3 %\* 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**

Im Bezugszeitraum wurde der Neuberger Berman Sustainable Emerging Market Corporate Debt Fund in Neuberger Berman EMD Corporate – Social and Environmental Transition Fund umbenannt und verringerte seine Verpflichtung, nachhaltige Investitionen zu halten, von 50 % auf 45 %.

\*Weitere Einzelheiten zum Mindestanteil nachhaltiger Investitionen, die ökologische oder soziale Merkmale bewerben, finden Sie unter der Frage „Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?“.

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie hier.

Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und Landnutzung, Kohlenstoffemissionen, Gelegenheiten für saubere Technologien, Wasserstress, Schadstoffemissionen und Abfälle, Finanzierung von Umweltauswirkungen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck von Produkten, Umweltpolitik, Umweltmanagementsystem, Programme zur Reduzierung von THG-Emissionen („**THG**“) umweltfreundliche Beschaffungspolitik und Programme für treibhausfreie Luftemissionen.
- **Soziale Merkmale:** Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Schutz der Privatsphäre und Datensicherheit, Produktsicherheit und -qualität, Sicherheit von Finanzprodukten, Diskriminierungspolitik, Programme zur Einbindung der Gemeinschaft, Diversitätsprogramme und Menschenrechtspolitik.

Das Portfolio zielt auf Konformität mit einem Netto-Null-Ziel ab, wie im SFDR-Anhang und im Abschnitt „Nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten“ im Prospekt ausführlicher beschrieben.

Das Portfolio erreichte eine CO<sub>2</sub>-Emissionsintensität, die mindestens 30 % unter derjenigen des breiteren Anlageuniversums für Unternehmensanleihen aus Schwellenländern lag, das durch den Index J.P. Morgan CEMBI Diversified (USD) Index (der „**Index**“) repräsentiert wird. Davon ausgenommen sind Wertpapiere, die von Nicht-Unternehmensemittenten begeben wurden, zu denen öffentliche oder quasi-öffentliche Emittenten (d. h. staatliche Emittenten) sowie Barmittel oder Barmitteläquivalente gehören („**ausgeschlossene Wertpapiere**“). Das Portfolio wurde aktiv verwaltet und bildete nicht den Index ab. Er wurde hier zu Vergleichszwecken für die Reduzierung der CO<sub>2</sub>-Emissionsintensität und von aufgenommen.

Für den Bezugszeitraum erreichte das Portfolio eine höhere ESG-Bewertung (wie von einem dritten Datenanbieter zugewiesen) als das breitere, durch den Index repräsentierte Universum der Unternehmensanleihen aus Schwellenländern.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses haben der Manager und der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein NB-ESG-Quotienten-

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

Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergriffen hat, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Darüber hinaus bemühten sich der Manager und der Sub-Investment-Manager einem konstruktiven Dialog mit Emittenten mit einer schlechten Bewertung des NB-ESG-Quotienten Vorrang einzuräumen, um zu beurteilen, ob Bedenken angemessen berücksichtigt wurden.

| Bezugszeitraum           | Rating    | Bereich      | Kombinierte Abdeckung |
|--------------------------|-----------|--------------|-----------------------|
| <b>NB-ESG-Quotient</b>   | <b>59</b> | <b>1-100</b> | 98 %                  |
| <b>Daten von Dritten</b> | 5,6       | 0-10         |                       |

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

## 2. ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy, die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy, Ausschlüsse gemäß dem EU-Referenzwert für klimabedingten Wandel („**EU-CTB**“), wie im Rahmen der Neuberger Berman EU Climate Benchmark Standard Exclusions Policy vorgesehen, und die sonstigen spezifischen Ausschlüsse identifiziert wurden, die im SFDR-Anhang des Portfolios angegeben sind, oder nicht mit diesen vereinbar waren. Zudem investierte das Portfolio nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit dieser vereinbar waren), wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischen Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik auf das Portfolio haben der Manager und der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik verstoßen. Wo möglich haben der Manager und

der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise ihrer Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager erörtern und diskutieren die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund ihres eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützen.

#### Sonstiges

Im Bezugszeitraum führte das Portfolio die EU-CTB-Ausschlüsse ein, wie im Rahmen der Neuberger Berman EU Climate Benchmark Standard Exclusions Policy vorgesehen. Die Neuberger Berman EU Climate Benchmark Standard Exclusions Policy wurde vom Manager und vom Sub-Investment-Manager erstellt zur Ausrichtung auf die Leitlinien der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde zu Fondsamen, die ESG- oder nachhaltigkeitsbezogene Begriffe verwenden.

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

Ausnahmsweise wurden für den Bezugszeitraum 2022 die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgte (sie umfassen die Veröffentlichung der SFDR-Vorlagen für vorvertragliche Informationen).

#### 1. Der NB-ESG-Quotient

|                            | <b>NB-ESG-Quotient-Rating</b> | <b>Rating der Daten durch externe Anbieter</b> | <b>Kombinierte Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| <b>Bereich</b>             | <b>1-100</b>                  | <b>0-10</b>                                    | <b>0-100 %</b>               |
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 59                            | 5,5  | 98 %                         |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 60                            | 5,6  | 100 %                        |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 59                            | 5,6  | 98 %                         |

#### 2. Ausschlüsse

|                            | <b>Gesamtzahl der Verstöße</b> |
|----------------------------|--------------------------------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 0                              |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 0                              |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 0                              |

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

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckt sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Investition zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Investition eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat (wie nachstehend erläutert) und (iii) eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf

die Unternehmensführung eines Emittenten, um festzustellen, ob der Emittent einer derartige Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griffen der Manager und der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die wirtschaftlichen Tätigkeiten eines Emittenten auf ökologische oder soziale Merkmalen ausgerichtet waren.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager überprüften die Emittenten auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Emittenten diese Prüfung bestanden haben, haben der Manager und der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag des Emittenten zur Wirtschaft gemessen.

Bei Unternehmensemittenten haben der Manager und der Sub-Investment-Manager dies auf drei Arten erfasst:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden);
- Ausrichtung der Umsätze auf die UN-Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDGs“) und
- Unternehmensemittenten in Sektoren mit großen Auswirkungen, die sich auf der Grundlage des NB Net-Zero Alignment Indicator auf einen Netto-Null-Kurs umstellen.

Im Bezugszeitraum aktualisierten der Manager und der Sub-Investment Manager den SFDR-Anhang des Portfolios, um dem Umstand Rechnung zu tragen, dass der Manager und Sub-Investment Manager bei der Ermittlung nachhaltiger Investitionen Unternehmensemittenten aus Sektoren mit großen Auswirkungen berücksichtigen, die sich auf der Grundlage des NB Net-Zero Alignment Indicator auf einen Netto-Null-Kurs umstellen.

Die Berücksichtigung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs, nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers, war durch die Verfügbarkeit von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griffen der Manager und der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Stellvertreterdaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

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

Der Manager und der Sub-Investment-Manager wandten ihren Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigen. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachteten der Manager und der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigten bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele waren, die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (die „**PAIs**“):

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.

| PAIs                              |   |
|-----------------------------------|---|
| Thema                             | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen   |
| <i>Treibhausgasemissionen</i>     | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind<br>PAI 5 - Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen<br>PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren  |
| <i>Biodiversität</i>              | PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken  |
| <i>Wasser</i>                     | PAI 8 - Emissionen in Wasser  |
| <i>Abfall</i>                     | PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle  |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen<br>PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen<br>PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle<br>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen<br>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbar Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager haben auch Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen berücksichtigt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager investierten nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

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

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Manager und den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, dass die ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen des Portfolios nicht erheblich beeinträchtigt wurden, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Emittenten, die quantitative und qualitative Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden, unterschreiten;
- Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Emittenten, wenn sie unter die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

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

Der Manager und der Sub-Investment-Manager investierten nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*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 EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



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

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager und den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigten PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

- I. Wie oben unter *„Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?“* erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele führten, alle PAIs berücksichtigt.
- II. Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigten die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die **„PAIs auf Produktebene“**):

| PAIs auf Produktebene         |   |
|-------------------------------|---|
| Thema                         | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen   |
| <i>Treibhausgasemissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |

|                                   |  |
|-----------------------------------|--|
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen<br>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen<br>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |
|-----------------------------------|--|

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager und den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager und der Sub-Investment-Manager haben den Bloomberg Industry Classification Standard („BICS“) verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2024 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2024 – 31. Dezember 2024

| Größte Investitionen                           | Sektor                    | In % der Vermögenswerte | Land               |
|--|---------------------------|-------------------------|--------------------|
| YPF SOCIEDAD ANONIM REGD REG S                 | ENERGIE                   | 0,9                     | ARGENTINIEN        |
| IVORY COAST /EUR/ REGD REG S                   | STAATLICH<br>ZYKLISCHE    | 0,9                     | COTE D'IVOIRE      |
| SANDS CHINA LTD REGD SER WI                    | KONSUMGÜTER<br>ZYKLISCHE  | 0,9                     | MACAU              |
| WYNN MACAU LTD REGD REG S                      | KONSUMGÜTER               | 0,9                     | MACAU              |
| CEMEX SAB DE CV REGD V/R /PERP/ REG S          | INDUSTRIE                 | 0,8                     | MEXIKO             |
| TSMC ARIZONA CORP REGD                         | TECHNOLOGIE               | 0,8                     | USA                |
| TSMC GLOBAL LTD REGD                           | TECHNOLOGIE               | 0,8                     | TAIWAN             |
| ROMANIA /EUR/ REGD REG S                       | STAATLICH                 | 0,8                     | RUMÄNIEN           |
| DOMINICAN REPUBLIC REGD REG S                  | STAATLICH                 | 0,8                     | DOMINICAN REPUBLIC |
| BANCOLOMBIA SA REGD V/R                        | FINANZWERTEN              | 0,7                     | KOLUMBIEN          |
| BANC CREDITO INVERSIONES REGD V/R /PERP/ REG S | FINANZWERTEN<br>ZYKLISCHE | 0,7                     | CHILE              |
| MELCO RESORTS FINANCE REGD REG S               | KONSUMGÜTER               | 0,7                     | HONGKONG           |
| SEPLAT ENERGY PL REGD REG S                    | ENERGIE                   | 0,7                     | NIGERIA            |
| SAMARCO MINERACAO S REGD REG S                 | GRUNDSTOFFE               | 0,7                     | BRASILIEN          |

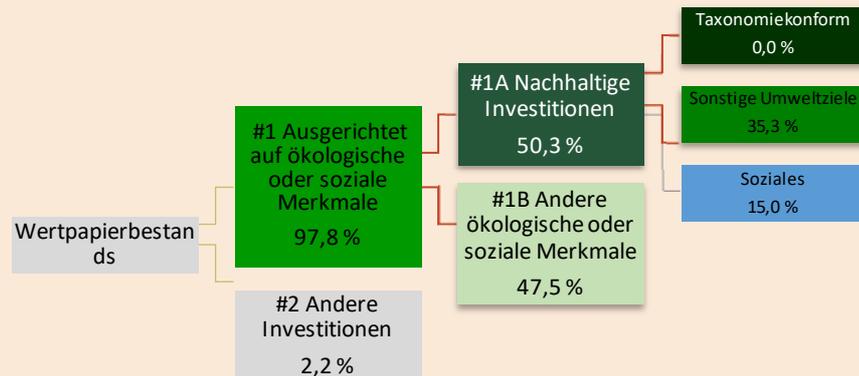


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Vermögensallokation des Portfolios im Bezugszeitraum wird in nachstehender Grafik dargestellt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager berechneten den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager und der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatten. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen.



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

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

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige** Investitionen umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● *In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?*

| <b>Wirtschaftssektoren - BICS</b> | <b>In % der Vermögenswerte</b> |
|-----------------------------------|--------------------------------|
| FINANZWERTEN                      | 32,8                           |
| ENERGIE                           | 15,7                           |
| GRUNDSTOFFE                       | 11,7                           |
| KOMMUNIKATION                     | 7,4                            |
| ZYKLISCHE KONSUMGÜTER             | 7,3                            |
| STAATLICH                         | 7,0                            |
| NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER       | 5,3                            |
| TECHNOLOGIE                       | 4,4                            |
| INDUSTRIE                         | 4,1                            |
| VERSORGUNG                        | 3,9                            |
| DIVERSIFIZIERT                    | 0,4                            |



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Bei-trag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

- **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?**

Ja:  
 In fossiles Gas  In Kernenergie

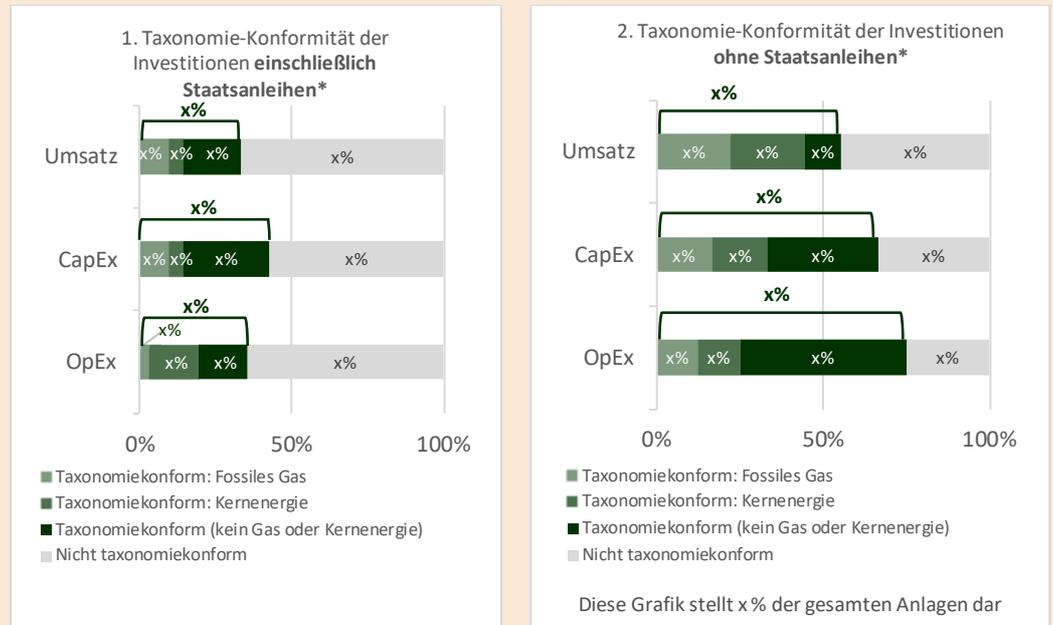
Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten 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 Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



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

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager können bestätigen, dass das Portfolio in Investitionen investiert hat, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Manager und der Sub-Investment-Manager werden das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessert.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



## Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Dies ist in der Grafik zur Vermögensallokation unter der Frage „Wie sah die Vermögensallokation aus?“ oben angegeben.



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?

Dies ist in der Grafik zur Vermögensallokation unter der Frage „Wie sah die Vermögensallokation aus?“ oben angegeben.



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

„Andere Investitionen“ umfasst die übrigen Investitionen des Portfolios, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren noch als nachhaltige Investitionen eingestuft wurden.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager und der Sub-Investment-Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachteten, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen, verhinderten und sie sicherstellen, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager wendeten bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager verstehen unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Managers und des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Managers und des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten sowie Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotienten herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Manager und vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

### II. Mitwirkung:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager engagierten sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager betrachteten diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil ihres Anlageprozesses. Die Fortschritte bei der Einbindung wurden vom Manager und dem Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### III. ESG-Sektor-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



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

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k.A.
- **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?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k.A.

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

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Emerging Market Debt – Hard Currency Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300M7KHGG3BTZ3979

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser 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?

**Ja**

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

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht 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 42,4\* % 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**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

\*Das Portfolio führte während des Bezugszeitraums eine Mindestverpflichtung zu nachhaltigen Investitionen von 10 % ein. Die Angaben zu nachhaltigen Investitionen in dieser periodischen Berichtsvorlage wurden daher auf Grundlage der Portfoliobestände zum 31. Dezember 2024 (als das einzige Quartalsende nach Einführung der Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen) erstellt. Die Zahlen zu den nachhaltigen Investitionen sind, bedingt durch die uneinheitlichen Bezugszeiträume, nicht in der Tabelle zur Vermögensallokation enthalten.

\*\*Weitere Einzelheiten zum Mindestanteil nachhaltiger Investitionen, die ökologische oder soziale Merkmale bewerben, finden Sie unter der Frage „Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?“.

Sofem in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio für staatliche Emittenten beworben:

- **Ökologische Merkmale:** staatliche Energieeffizienz, Anpassung an den Klimawandel, Entwaldung, Treibhausgasemissionen („THG“), Luft- und Haushaltsverschmutzung und unsichere sanitäre Einrichtungen.
- **Soziale Merkmale:** Fortschritte bei den UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung (Sustainable Development Goals, „SDGs“), Gesundheits- und Bildungsniveau, Qualität der Regulierung, politische Stabilität und Freiheiten, Gleichstellung der Geschlechter sowie Forschung und Entwicklung.

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio für Unternehmensemittenten beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und Landnutzung, Kohlenstoffemissionen, Gelegenheiten für saubere Technologien, Wasserstress, Schadstoffemissionen und Abfälle, Finanzierung von Umweltauswirkungen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck von Produkten, Umweltpolitik, Umweltmanagementsystem, Programme zur Reduzierung von THG-Emissionen, umweltfreundliche Beschaffungspolitik und Programme für treibhausfreie Luftemissionen.
- **Soziale Merkmale:** Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Schutz der Privatsphäre und Datensicherheit, Produktsicherheit und -qualität, Sicherheit von Finanzprodukten, Diskriminierungspolitik, Programme zur Einbindung der Gemeinschaft, Diversitätsprogramme und Menschenrechtspolitik.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

## Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses haben der Manager und der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „NB- ESG-Quotient“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Der Manager

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

und der Sub-Investment-Manager nutzten den NB-ESG-Quotienten, um die aufgeführten ökologischen und sozialen Merkmale zu bewerten, indem sie primär in Wertpapiere von Emittenten mit einem relativ günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotienten-Rating investierten. Dementsprechend beschränkten der Manager und der Sub-Investment-Manager das Engagement in Emittenten mit dem schlechtesten NB-ESG-Quotienten-Rating, außer es bestand die begründete Erwartung, dass sich das NB-ESG-Quotienten-Rating im Laufe der Zeit verbessern würde.

| Bezugszeitraum           | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|--------------------------|--------|---------|-----------------------|
| <b>NB-ESG-Quotient</b>   | 52     | 1-100   | 98 %                  |
| <b>Daten von Dritten</b> | 3,7    | 0-10    |                       |

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

## 2. ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy und die sonstigen spezifischen Ausschlüsse identifiziert wurden, die im SFDR-Anhang des Portfolios angegeben sind, oder nicht mit diesen vereinbar waren. Außerdem investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen in Bezug auf eine verantwortungsbewusste Geschäftsführung („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik auf das Portfolio haben der Manager und der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik verstoßen. Wo möglich haben der Manager und der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise ihrer Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager erörterten und diskutierten die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund ihres eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

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

Ausnahmsweise wurden für den Bezugszeitraum 2022 die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgte (sie umfassen die Veröffentlichung der SFDR-Vorlagen für vorvertragliche Informationen).

1. NB-ESG-Quotient

|                            | <b>NB-ESG-Quotient-Rating</b> | <b>Rating der Daten durch externe Anbieter</b> | <b>Kombinierte Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| <b>Bereich</b>             | 1-100                         | 0-10   | 0-100 %                      |
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 51                            | 3,8  | 96 %                         |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 52                            | 3,9  | 97 %                         |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 52                            | 3,7  | 98 %                         |

2. Ausschlüsse

|                            | <b>Gesamtzahl der Verstöße</b> |
|----------------------------|--------------------------------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 0                              |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 0                              |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 0                              |

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

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckt sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Investition zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Investition eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat (wie nachstehend erläutert) und (iii) eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die Unternehmensführung eines Emittenten, um festzustellen, ob der Emittent einer derartigen Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griffen der Manager und der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die wirtschaftlichen Tätigkeiten eines Emittenten auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager überprüften die Emittenten auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Emittenten diese Prüfung bestanden haben, haben der Manager und der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag des Emittenten zur Wirtschaft gemessen.

Bei Unternehmensemittenten haben der Manager und der Sub-Investment-Manager dies auf drei Arten erfasst:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden);
- Ausrichtung der Umsätze auf die UN-Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDGs“) und
- Unternehmensemittenten in Sektoren mit großen Auswirkungen, die sich auf der Grundlage des NB Net-Zero Alignment Indicator auf einen Netto-Null-Kurs umstellen.

Die Berücksichtigung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs, nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers, war durch die Verfügbarkeit von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griffen der Manager und der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Stellvertreterdaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

Bei staatlichen Emittenten haben der Manager und der Sub-Investment-Manager dies auf folgenden Arten erfasst:

- Fortschritte bei der Anpassung an den Klimawandel und dem Klimaschutz und
- Fortschritte bei der Erreichung der SDGs, mit Schwerpunkt auf Lebenserwartung und Bildung

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

Der Manager und der Sub-Investment-Manager wandten ihren Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigen. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachteten der Manager und der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Bei der Feststellung, ob die ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen des Portfolios nicht erheblich beeinträchtigt wurden, berücksichtigten der Manager und der Sub-Investment-Manager die in Teil 1 der nachstehenden Tabelle aufgeführten Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen für Unternehmensemittenten (die „**PAIs**“) und die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen für staatliche Emittenten (die „**staatlichen PAIs**“) wie nachfolgend in Teil 2 der Tabelle dargelegt:

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.

| <b>Teil 1 – PAIs</b>              |   |
|-----------------------------------|---|
| <b>Thema</b>                      | <b>Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen</b>  |
| <i>Treibhausgas-emissionen</i>    | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind<br>PAI 5 - Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen<br>PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren  |
| <i>Biodiversität</i>              | PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken  |
| <i>Wasser</i>                     | PAI 8 - Emissionen in Wasser  |
| <i>Abfall</i>                     | PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle  |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen<br>PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen<br>PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle<br>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen<br>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |
| <b>Teil 2 – staatliche PAIs</b>   |   |
| <i>Umwelt</i>                     | PAI 15 – THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird   |
| <i>Soziales</i>                   | PAI 16 - Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen   |

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigten ferner Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen und investierte nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

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

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Manager und den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, dass die ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen des Portfolios nicht erheblich beeinträchtigt wurden, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Emittenten, die quantitative und qualitative Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden, unterschreiten;
- Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Emittenten, wenn sie unter die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

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

Der Manager und der Sub-Investment-Manager investierten nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*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 EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



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

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager und den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigten PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

1. Wie oben unter „*Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?*“ erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele führten, alle PAIs und staatlichen PAIs berücksichtigt.
2. Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigten in Bezug auf die Nachhaltigkeitsfaktoren die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 1 der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind, für Unternehmensemittenten (die „**PAIs für Unternehmensemittenten**“), und die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 2 der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind, für staatliche Emittenten (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“):

| Teil 1 – PAIs für Unternehmensemittenten |  |
|--|--|
| Thema                                    | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen  |
| <i>Treibhausgasemissionen</i>            | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind  |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i>        | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen<br>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen<br>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |
| Teil 2 – staatliche PAIs                 |  |
| <i>Umwelt</i>                            | PAI 15 – THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird  |
| <i>Soziales</i>                          | PAI 16 - Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen  |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager und den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

1. Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
2. Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel, die für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden; und
3. Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager und der Sub-Investment-Manager haben den Bloomberg Industry Classification Standard („BICS“) verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2024 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2024 – 31. Dezember 2024

| Größte Investitionen                         | Sektor    | In % der Vermögenswerte | Land                    |
|--|-----------|-------------------------|-------------------------|
| PETROLEOS MEXICANOS REGD SER WI              | ENERGIE   | 2,2                     | MEXIKO                  |
| SOUTHERN GAS CORRIDOR REGD REG S             | ENERGIE   | 2,0                     | ASERBAIDSCHAN           |
| REPUBLIC OF ARGENTINA REGD S/UP              | STAATLICH | 1,6                     | ARGENTINIEN             |
| REPUBLIC OF EL SALVADOR REGD REG S           | STAATLICH | 1,6                     | EL SALVADOR             |
| REPUBLIC OF ECUADOR REGD S/UP REG S          | STAATLICH | 1,5                     | ECUADOR                 |
| OMAN GOV INTERNL BOND REGD REG S             | STAATLICH | 1,4                     | OMAN                    |
| DOMINICAN REPUBLIC REGD                      | STAATLICH | 1,4                     | DOMINIKANISCHE REPUBLIK |
| IVORY COAST /EUR/ REGD REG S                 | STAATLICH | 1,4                     | COTE D'IVOIRE           |
| ROMANIA /EUR/ REGD REG S EMTN                | STAATLICH | 1,4                     | RUMÄNIEN                |
| REPUBLIC OF COLOMBIA REGD                    | STAATLICH | 1,3                     | KOLUMBIEN               |
| REPUBLIC OF SOUTH AFRICA REGD                | STAATLICH | 1,2                     | SÜDAFRIKA               |
| REPUBLIC OF ARGENTINA REGD S/UP SER          | STAATLICH | 1,2                     | ARGENTINIEN             |
| UNITED MEXICAN STATES REGD MTN SER GMTN      | STAATLICH | 1,2                     | MEXIKO                  |
| KAZMUNAYGAS NATIONAL CO REGD REG S EMTN      | ENERGIE   | 1,1                     | KASACHSTAN              |
| ARAB REPUBLIC OF EGYPT /EUR/ REGD REG S EMTN | STAATLICH | 1,1                     | ÄGYPTEN                 |

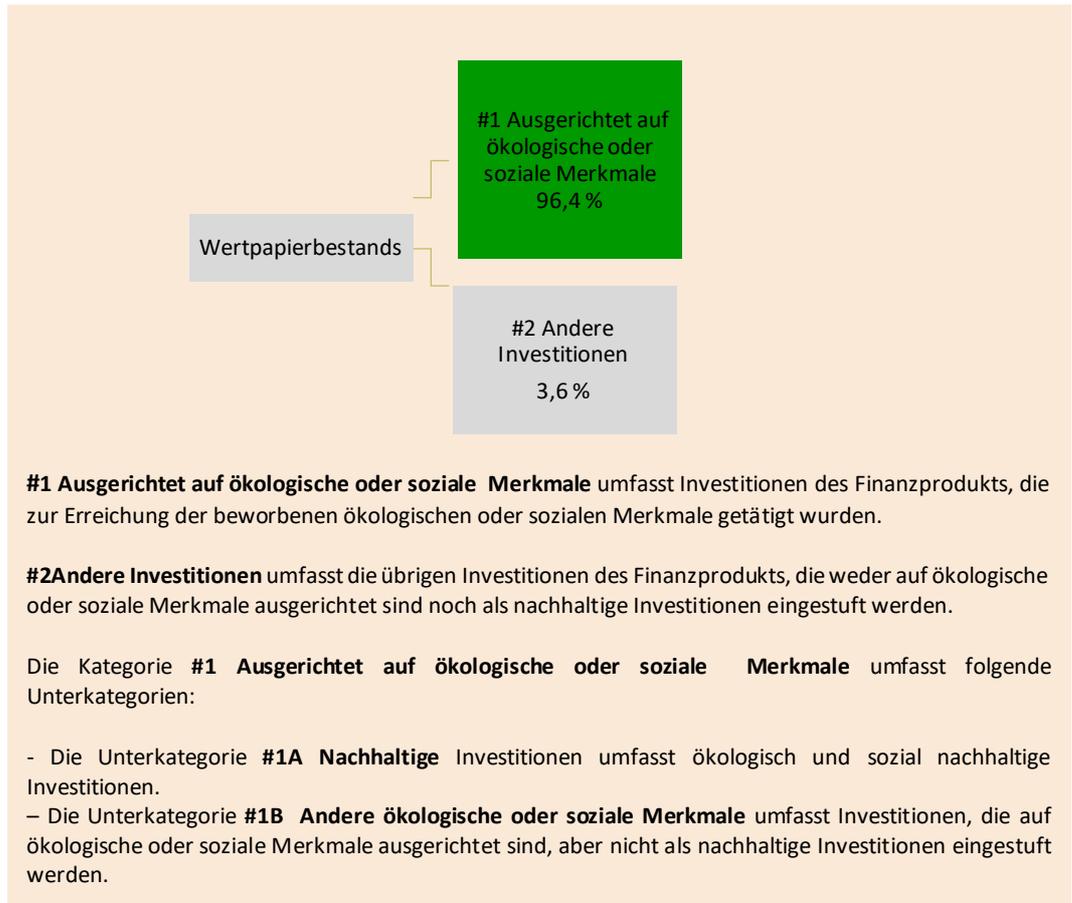


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### ● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Die Vermögensallokation des Portfolios im Bezugszeitraum wird in nachstehender Grafik dargestellt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager berechneten den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager und der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatten. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen.



Der prozentuale Anteil der nachhaltigen Investitionen zum 31. Dezember 2024 betrug 42,4 %. Darin enthalten waren 26,8 % an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, und 15,6 % an sozial nachhaltigen Investitionen. Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

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

| Wirtschaftssektoren - BICS | In % der Vermögenswerte |
|----------------------------|-------------------------|
| STAATLICH                  | 71,6                    |
| ENERGIE                    | 16,0                    |
| VERSORGUNG                 | 3,4                     |
| GRUNDSTOFFE                | 3,3                     |
| FINANZWERTEN               | 3,2                     |

|                             |     |
|-----------------------------|-----|
| INDUSTRIE                   | 1,1 |
| NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 0,8 |
| KOMMUNIKATION               | 0,6 |



## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager können bestätigen, dass das Portfolio in Investitionen investiert hat, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Manager und der Sub-Investment-Manager werden das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

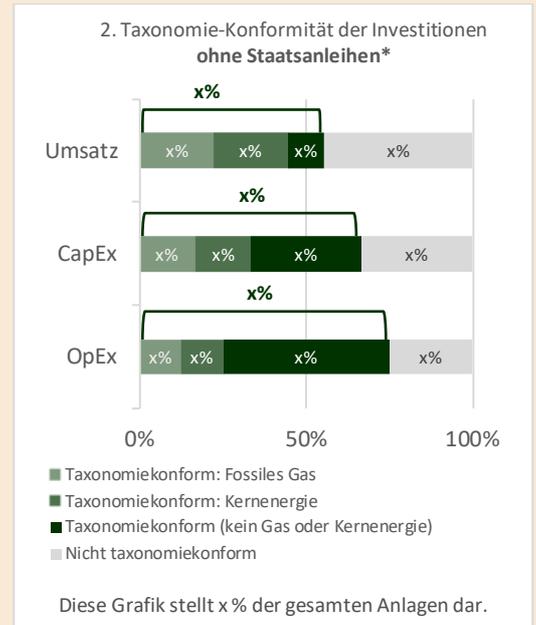
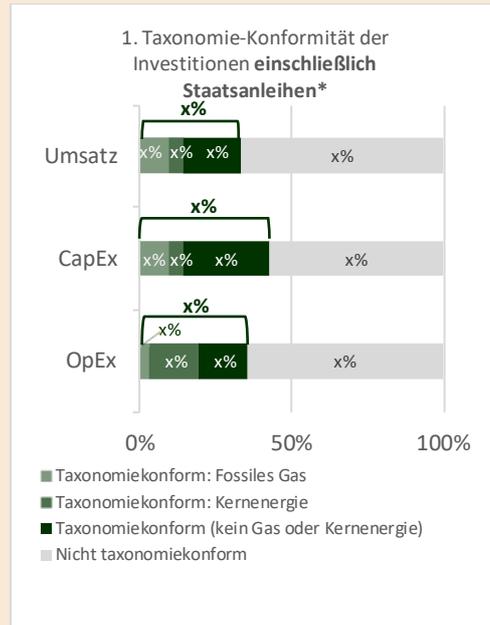
- Ja:
- In fossiles Gas  In Kernenergie
- Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten 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 Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* 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?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



## Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Dies ist in der Grafik zur Vermögensallokation unter der Frage „Wie sah die Vermögensallokation aus?“ oben angegeben.



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?

Dies ist in der Grafik zur Vermögensallokation unter der Frage „Wie sah die Vermögensallokation aus?“ oben angegeben.



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

„Andere Investitionen“ umfasst die übrigen Investitionen des Portfolios, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren noch als nachhaltige Investitionen eingestuft wurden.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager und der Sub-Investment-Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachteten, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen, verhinderten und sie sicherstellen, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager wendeten bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager verstehen unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Managers und des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Managers und des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten sowie Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotienten herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Manager und vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

### II. Mitwirkung:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager engagierten sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager betrachteten diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil ihres Anlageprozesses. Die Fortschritte bei der Einbindung wurden vom Manager und dem Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### III. ESG-Sektor-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k.A.
- **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?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k.A.

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

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Emerging Market Debt – Local Currency Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300VLRPBFFXL0DB81

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser 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?

**Ja**

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

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht 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**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Sofem in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio für staatliche Emittenten beworben:

- **Ökologische Merkmale:** staatliche Energieeffizienz, Anpassung an den Klimawandel, Entwaldung, Treibhausgasemissionen („THG“) , Luft- und Haushaltsverschmutzung und unsichere sanitäre Einrichtungen.
- **Soziale Merkmale:** Fortschritte bei den UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung (Sustainable Development Goals, „SDGs“), Gesundheits- und Bildungsniveau, Qualität der Regulierung, politische Stabilität und Freiheiten, Gleichstellung der Geschlechter sowie Forschung und Entwicklung.

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio für Unternehmensemittenten beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und Landnutzung, Kohlenstoffemissionen, Gelegenheiten für saubere Technologien, Wasserstress, Schadstoffemissionen und Abfälle, Finanzierung von Umweltauswirkungen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck von Produkten, Umweltpolitik, Umweltmanagementsystem, Programme zur Reduzierung von THG-Emissionen, umweltfreundliche Beschaffungspolitik und Programme für treibhausfreie Luftemissionen.
- **Soziale Merkmale:** Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Schutz der Privatsphäre und Datensicherheit, Produktsicherheit und -qualität, Sicherheit von Finanzprodukten, Diskriminierungspolitik, Programme zur Einbindung der Gemeinschaft, Diversitätsprogramme und Menschenrechtspolitik.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses haben der Manager und der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „NB- ESG-Quotient“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und - Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten den NB-ESG-Quotienten, um die aufgeführten ökologischen und sozialen Merkmale zu bewerten, indem sie primär in Wertpapiere von Emittenten mit einem relativ günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotienten-Rating investierten. Dementsprechend beschränkten der Manager und der Sub-Investment-Manager das Engagement in Emittenten mit dem schlechtesten NB-ESG-Quotienten-Rating, außer es bestand die begründete Erwartung, dass sich das NB-ESG-Quotienten-Rating im Laufe der Zeit verbessern würde.

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

| Bezugszeitraum    | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|--------|---------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient   | 54     | 1-100   | 98 %                  |
| Daten von Dritten | 4,5    | 0-10    |                       |

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy und die sonstigen spezifischen Ausschlüsse identifiziert wurden, die im SFDR-Anhang des Portfolios angegeben sind, oder nicht mit diesen vereinbar waren. Außerdem investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik auf das Portfolio haben der Manager und der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik verstoßen. Wo möglich haben der Manager und der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise ihrer Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager erörterten und diskutierten die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund ihres eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

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

Ausnahmsweise wurden für den Bezugszeitraum 2022 die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgte (sie umfassen die Veröffentlichung der SFDR-Vorlagen für vorvertragliche Informationen).

1. NB-ESG-Quotient

|                            | <b>NB-ESG-Quotient-Rating</b> | <b>Rating der Daten durch externe Anbieter</b> | <b>Kombinierte Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| <b>Bereich</b>             | 1-100                         | 0-10   | 0-100 %                      |
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 54                            | 4,8  | 96 %                         |

|                            |    |     |      |
|----------------------------|----|-----|------|
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 55 | 4,8 | 97 % |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 54 | 4,5 | 98 % |

## 2. Ausschlüsse

|                            | Gesamtzahl der Verstöße |
|----------------------------|-------------------------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 0                       |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 0                       |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 0                       |

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten. Dessen ungeachtet waren der Manager und der Sub-Investment-Manager nicht in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst 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.

*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 EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



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

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager und den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigten in Bezug auf die Nachhaltigkeitsfaktoren die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 1 der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind, für Unternehmensemittenten (die „**PAIs für Unternehmensemittenten**“), und die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 2 der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind, für staatliche Emittenten (die „**staatliche PAIs**“) (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“):

| <b>Teil 1 – PAIs für Untermehensemittenten</b> |  |
|--|--|
| <b>Thema</b>                                   | <b>Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen</b>   |
| <i>Treibhausgas-emissionen</i>                 | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind  |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i>              | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen<br>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen<br>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |
| <b>Teil 2 – staatliche PAIs</b>                |  |
| <i>Umwelt</i>                                  | PAI 15 – THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird  |
| <i>Soziales</i>                                | PAI 16 - Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen  |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfaren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen. Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager und den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel, die für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager und der Sub-Investment-Manager haben den Bloomberg Industry Classification Standard („BICS“) verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2024 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts** entfiel: 1. Januar 2024 – 31. Dezember 2024

| Größte Investitionen                               | Sektor    | In % der Vermögenswerte | Land                  |
|--|-----------|-------------------------|-----------------------|
| MEX BONOS DESARR FIX RT /MXN/ REGD SER M           | STAATLICH | 2,3                     | MEXIKO                |
| REPUBLIC OF SOUTH AFRICA /ZAR/ REGD SER2037        | STAATLICH | 2,2                     | SÜDAFRIKA             |
| POLAND GOVERNMENT BOND /PLN/ REGD SER 0728         | STAATLICH | 2,2                     | POLEN                 |
| MEX BONOS DESARR FIX RT /MXN/ REGD SER M           | STAATLICH | 2,0                     | MEXIKO                |
| REPUBLIC OF SOUTH AFRICA /ZAR/ REGD SER2040        | STAATLICH | 1,6                     | SÜDAFRIKA             |
| TITULOS DE TESORERIA /COP/ REGD SER B              | STAATLICH | 1,6                     | KOLUMBIEN             |
| TURKIYE GOVERNMENT BOND /TRY/ REGD SER10Y          | STAATLICH | 1,5                     | TÜRKEI                |
| REPUBLIC OF SOUTH AFRICA /ZAR/ REGD SER R209       | STAATLICH | 1,4                     | SÜDAFRIKA             |
| CZECH REPUBLIC /CZK/ REGD REG S SER94              | STAATLICH | 1,4                     | TSCHECHISCHE REPUBLIK |
| REPUBLIC OF SOUTH AFRICA /ZAR/ REGD SER2044        | STAATLICH | 1,4                     | SÜDAFRIKA             |
| MALAYSIA GOVERNMENT /MYR/ REGD SER0222             | STAATLICH | 1,4                     | MALAYSIA              |
| INDONESIA GOVERNMENT /IDR/ REGD SER FR95           | STAATLICH | 1,3                     | INDONESIEN            |
| INDIA GOVERNMENT BOND /INR/ REGD                   | STAATLICH | 1,3                     | INDIEN                |
| INTERNATIONAL BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMEN | STAATLICH | 1,2                     | USA                   |
| REPUBLIC OF SOUTH AFRICA /ZAR/ REGD SER2035        | STAATLICH | 1,2                     | SÜDAFRIKA             |

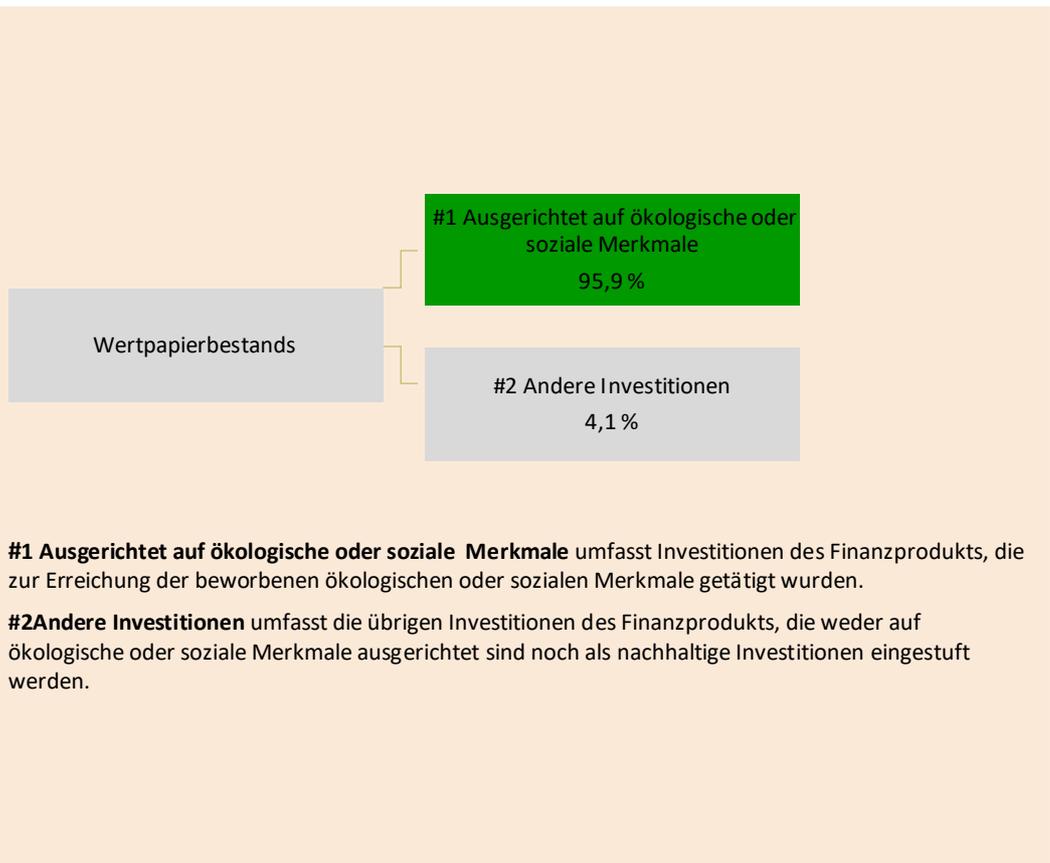


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Vermögensallokation des Portfolios im Bezugszeitraum wird in nachstehender Grafik dargestellt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager berechneten den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager und der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatten. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen.



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

| Wirtschaftssektoren - BICS | In % der Vermögenswerte |
|----------------------------|-------------------------|
| STAATLICH                  | 94,0                    |
| FINANZWERTEN               | 4,5                     |
| VERSORGUNG                 | 1,5                     |



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für

**Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

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

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager können bestätigen, dass das Portfolio in Investitionen investiert hat, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Manager und der Sub-Investment-Manager werden das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

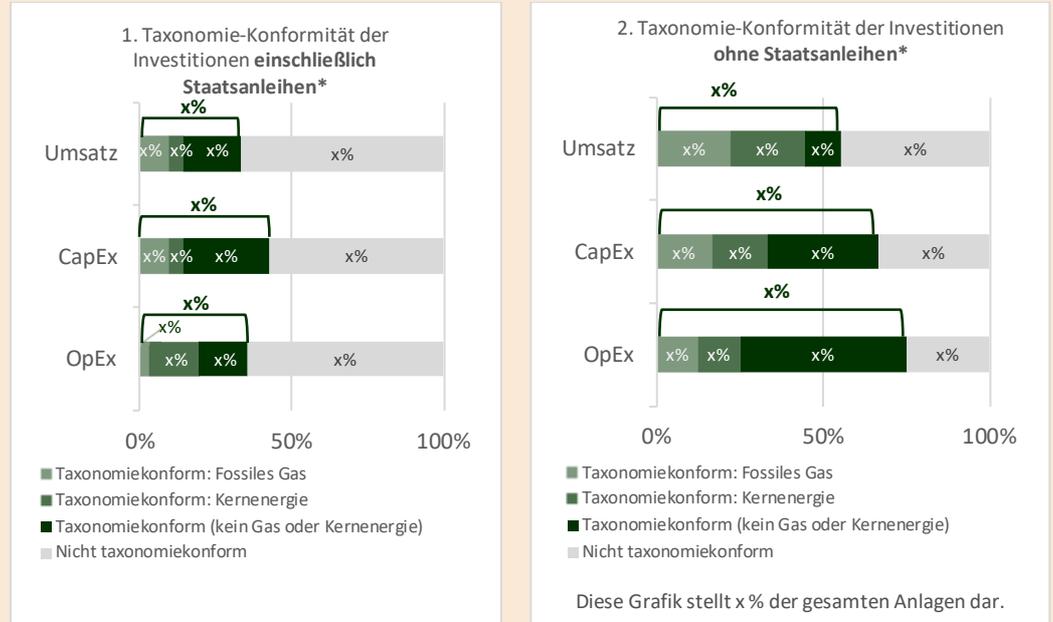
- Ja:
- In fossiles Gas  In Kernenergie
- Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten 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 Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* 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?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



## Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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

„Andere Investitionen“ umfasst die übrigen Investitionen des Portfolios, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren noch als nachhaltige Investitionen eingestuft wurden.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager und der Sub-Investment-Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachteten, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen, verhinderten und sie sicherstellen, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager wendeten bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager verstehen unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Managers und des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Managers und des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten sowie Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotienten herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Manager und vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

### II. Mitwirkung:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager engagierten sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager betrachteten diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil ihres Anlageprozesses. Die Fortschritte bei der Einbindung wurden vom Manager und dem Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### III. ESG-Sektor-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

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?**  
k.A.
- **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?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k.A.

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300JASQ1JIDYO8X22

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser 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?

**Ja**

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

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht 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**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Sofem in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio für staatliche Emittenten beworben:

- **Ökologische Merkmale:** staatliche Energieeffizienz, Anpassung an den Klimawandel, Entwaldung, Treibhausgasemissionen („THG“), Luft- und Haushaltsverschmutzung und unsichere sanitäre Einrichtungen.
- **Soziale Merkmale:** Fortschritte bei den UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung (Sustainable Development Goals, „SDGs“), Gesundheits- und Bildungsniveau, Qualität der Regulierung, politische Stabilität und Freiheiten, Gleichstellung der Geschlechter sowie Forschung und Entwicklung.

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio für Unternehmensemittenten beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und Landnutzung, Kohlenstoffemissionen, Gelegenheiten für saubere Technologien, Wasserstress, Schadstoffemissionen und Abfälle, Finanzierung von Umweltauswirkungen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck von Produkten, Umweltpolitik, Umweltmanagementsystem, Programme zur Reduzierung von THG-Emissionen, umweltfreundliche Beschaffungspolitik und Programme für treibhausfreie Luftemissionen.
- **Soziale Merkmale:** Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Schutz der Privatsphäre und Datensicherheit, Produktsicherheit und -qualität, Sicherheit von Finanzprodukten, Diskriminierungspolitik, Programme zur Einbindung der Gemeinschaft, Diversitätsprogramme und Menschenrechtspolitik.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

### ● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Im Rahmen des Anlageprozesses haben der Manager und der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten den NB-ESG-Quotienten, um die aufgeführten ökologischen und sozialen Merkmale zu bewerben, indem sie primär in Wertpapiere von Emittenten mit einem relativ günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotienten-Rating investierten. Dementsprechend beschränkten der Manager und der Sub-Investment-Manager das Engagement in Emittenten mit dem schlechtesten NB-ESG-Quotienten-Rating, außer es bestand die begründete Erwartung, dass sich das NB-ESG-Quotienten-Rating im Laufe der Zeit verbessern würde.

| Bezugszeitraum           | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|--------------------------|--------|---------|-----------------------|
| <b>NB-ESG-Quotient</b>   | 54     | 1-100   | 98 %                  |
| <b>Daten von Dritten</b> | 4,6    | 0-10    |                       |

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

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

## 2. ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy und die sonstigen spezifischen Ausschlüsse identifiziert wurden, die im SFDR-Anhang des Portfolios angegeben sind, oder nicht mit diesen vereinbar waren. Außerdem investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstößend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik auf das Portfolio haben der Manager und der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik verstoßen. Wo möglich haben der Manager und der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise ihrer Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager erörterten und diskutierten die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund ihres eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

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

Ausnahmsweise wurden für den Bezugszeitraum 2022 die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgte (sie umfassen die Veröffentlichung der SFDR-Vorlagen für vorvertragliche Informationen).

### 1. NB-ESG-Quotient

|                            | <b>NB-ESG-Quotient-Rating</b> | <b>Rating der Daten durch externe Anbieter</b> | <b>Kombinierte Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| <b>Bereich</b>             | 1-100                         | 0-10   | 0-100 %                      |
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 54                            | 4,6  | 95 %                         |

|                            |    |     |      |
|----------------------------|----|-----|------|
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 55 | 4,7 | 97 % |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 54 | 4,6 | 98 % |

## 2. Ausschlüsse

|                            | Gesamtzahl der Verstöße |
|----------------------------|-------------------------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 0                       |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 0                       |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 0                       |

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten. Dessen ungeachtet waren der Manager und der Sub-Investment-Manager nicht in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst 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.

*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 EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



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

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager und den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigten in Bezug auf die Nachhaltigkeitsfaktoren die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 1 der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind, für Unternehmensemittenten (die „**PAIs für Unternehmensemittenten**“), und die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 2 der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind, für staatliche Emittenten (die „**staatliche PAIs**“) (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“):

| Teil 1 – PAIs für Unternehmensemittenten |  |
|--|--|
| Thema                                    | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen  |
| Treibhausgasemissionen                   | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind  |
| Soziales und Beschäftigung               | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen<br>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen<br>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |
| Teil 2 – staatliche PAIs                 |  |

|          |   |
|----------|---|
| Umwelt   | PAI 15 – THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird               |
| Soziales | PAI 16 - Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager und den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel, die für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager und der Sub-Investment-Manager haben den Bloomberg Industry Classification Standard („BICS“) verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2024 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2024 – 31. Dezember 2024

| Größte Investitionen                         | Sektor     | In % der Vermögenswerte | Land                  |
|--|------------|-------------------------|-----------------------|
| INDONESIA GOVERNMENT /IDR/ REGD SER 101      | STAATLICH  | 1,3                     | INDONESIEN            |
| REPUBLIC OF SOUTH AFRICA /ZAR/ REGD SER2037  | STAATLICH  | 1,3                     | SÜDAFRIKA             |
| TITULOS DE TESORERIA /COP/ REGD SER B        | STAATLICH  | 1,2                     | KOLUMBIEN             |
| MEX BONOS DESARR FIX RT /MXN/ REGD SER M     | STAATLICH  | 1,1                     | MEXIKO                |
| INDIA GOVERNMENT BOND /INR/ REGD             | STAATLICH  | 1,0                     | INDIEN                |
| POLAND GOVERNMENT BOND /PLN/ REGD SER 0728   | STAATLICH  | 0,9                     | POLEN                 |
| MALAYSIA GOVERNMENT /MYR/ REGD SER0222       | STAATLICH  | 0,8                     | MALAYSIA              |
| REPUBLIC OF SOUTH AFRICA /ZAR/ REGD SER2040  | STAATLICH  | 0,8                     | SÜDAFRIKA             |
| POLAND GOVERNMENT BOND /PLN/ REGD SER 0432   | STAATLICH  | 0,8                     | POLEN                 |
| CZECH REPUBLIC /CZK/ REGD SER 121            | STAATLICH  | 0,8                     | TSCHECHISCHE REPUBLIK |
| TURKIYE GOVERNMENT BOND /TRY/ REGD SER10Y    | STAATLICH  | 0,8                     | TÜRKEI                |
| REPUBLIC OF SOUTH AFRICA /ZAR/ REGD SER R209 | STAATLICH  | 0,7                     | SÜDAFRIKA             |
| TITULOS DE TESORERIA /COP/ REGD SER B        | STAATLICH  | 0,7                     | KOLUMBIEN             |
| EMPRESAS PUBLIC MEDELLIN /COP/ REGD REG S    | VERSORGUNG | 0,7                     | KOLUMBIEN             |
| MEX BONOS DESARR FIX RT /MXN/ REGD SER M     | STAATLICH  | 0,7                     | MEXIKO                |

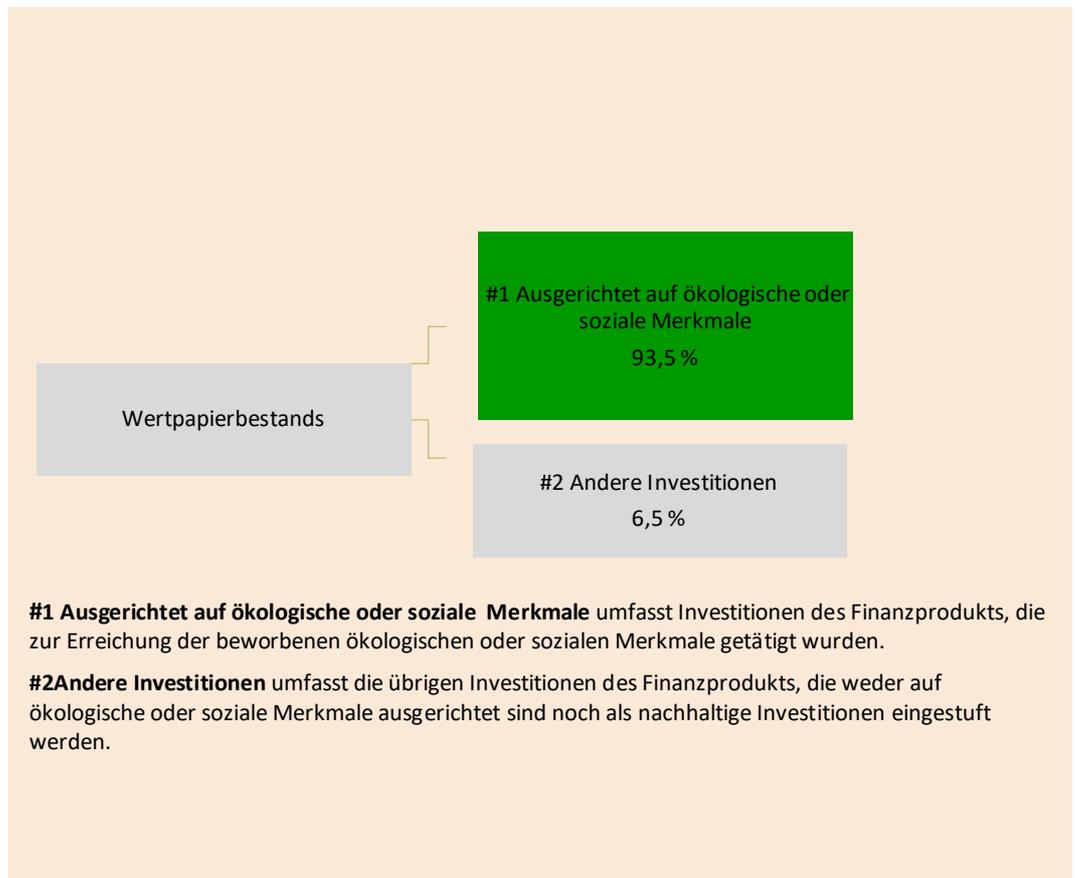


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### ● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Die Vermögensallokation des Portfolios im Bezugszeitraum wird in nachstehender Grafik dargestellt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager berechneten den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager und der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatten. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen.



● *In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?*

| <b>Wirtschaftssektoren - BICS</b> | <b>In % der Vermögenswerte</b> |
|-----------------------------------|--------------------------------|
| STAATLICH                         | 68,8                           |
| FINANZWERTEN                      | 9,0                            |
| ENERGIE                           | 7,5                            |
| VERSORGUNG                        | 4,2                            |
| GRUNDSTOFFE                       | 3,3                            |
| ZYKLISCHE KONSUMGÜTER             | 1,9                            |
| KOMMUNIKATION                     | 1,8                            |
| NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER       | 1,6                            |
| INDUSTRIE                         | 1,4                            |
| TECHNOLOGIE                       | 0,4                            |
| DIVERSIFIZIERT                    | 0,1                            |



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager können bestätigen, dass das Portfolio in Investitionen investiert hat, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Manager und der Sub-Investment-Manager werden das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

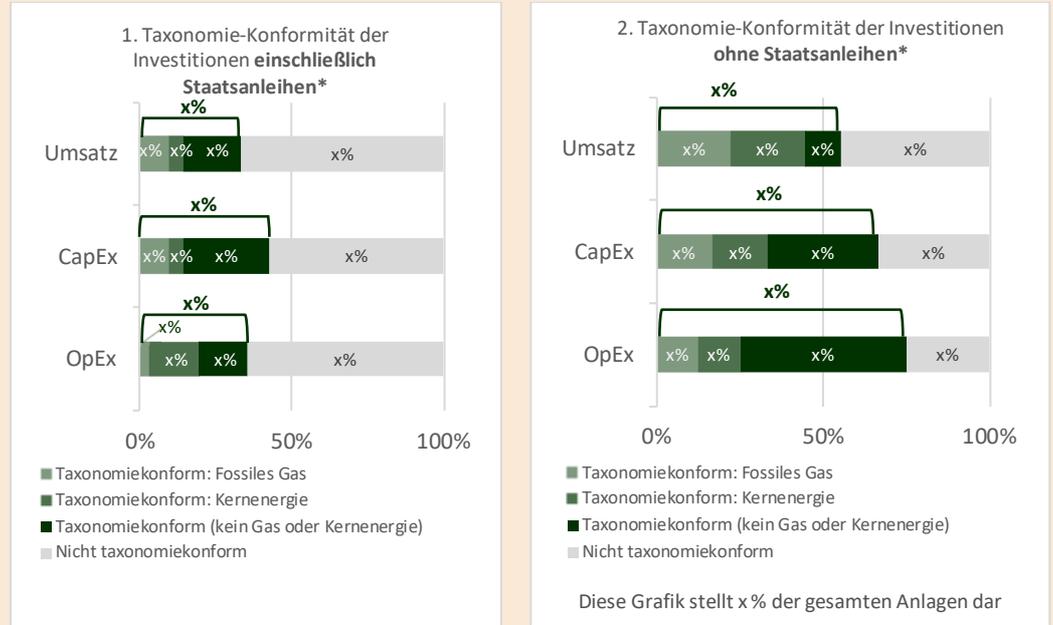
- Ja:  
 In fossiles Gas  In Kernenergie
- Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten 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 Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* 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?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



### **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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

„Andere Investitionen“ umfasst die übrigen Investitionen des Portfolios, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren noch als nachhaltige Investitionen eingestuft wurden.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager und der Sub-Investment-Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachteten, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen, verhinderten und sie sicherstellen, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager wendeten bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager verstehen unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Managers und des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Managers und des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten sowie Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotienten herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Manager und vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in seine internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

### II. Mitwirkung:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager engagierten sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager betrachteten diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil ihres Anlageprozesses. Die Fortschritte bei der Einbindung wurden vom Manager und dem Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### III. ESG-Sektor-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k.A.
- **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?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k.A.

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

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend (das „Portfolio“).

**Unternehmenskennung:** 549300IFJK0FPOE1X496

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser 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?

**Ja**

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

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht 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 57.9 %\* 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**

\*Weitere Einzelheiten zum Mindestanteil nachhaltiger Investitionen, die ökologische oder soziale Merkmale bewerben, finden Sie unter der Frage „Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?“.

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Sofem in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben zudem die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung dieser ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio für staatliche Emittenten beworben:

- **Ökologische Merkmale:** staatliche Energieeffizienz, Anpassung an den Klimawandel, Entwaldung, Treibhausgasemissionen („THG“) , Luft- und Haushaltsverschmutzung und unsichere sanitäre Einrichtungen.
- **Soziale Merkmale:** Fortschritte bei der Verwirklichung der UN-Ziele einer nachhaltigen Entwicklung (Sustainable Development Goals, „SDGs“), Gesundheits- und Bildungsniveau, Qualität der Regulierung, politische Stabilität und Freiheiten, Gleichstellung der Geschlechter sowie Forschung und Entwicklung.

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio für Unternehmensemittenten beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und Landnutzung, Kohlenstoffemissionen, Gelegenheiten für saubere Technologien, Wasserstress, Schadstoffemissionen und Abfälle, Finanzierung von Umweltauswirkungen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck von Produkten, Umweltpolitik, Umweltmanagementsystem, Programme zur Reduzierung von THG-Emissionen, umweltfreundliche Beschaffungspolitik und Programme für treibhausfreie Luftemissionen.
- **Soziale Merkmale:** Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Schutz der Privatsphäre und Datensicherheit, Produktsicherheit und -qualität, Sicherheit von Finanzprodukten, Diskriminierungspolitik, Programme zur Einbindung der Gemeinschaft, Diversitätsprogramme und Menschenrechtspolitik.

Das Portfolio zielt auf Konformität mit einem Netto-Null-Ziel ab, wie im SFDR-Anhang und im Abschnitt „Nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten“ im Prospekt ausführlicher beschrieben.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses haben der Manager und der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „NB- ESG-Quotient“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten den NB-ESG-Quotienten, um die aufgeführten ökologischen und sozialen Merkmale zu bewerten, indem sie primär in Wertpapiere von Emittenten mit einem relativ günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotienten-Rating investierten. Das Portfolio hat nicht in Emittenten investiert, die im Hinblick auf

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

den NB-ESG-Quotienten im unteren Quartil rangieren und bei denen keine Aussicht auf kurzfristige Verbesserungen besteht.

| Bezugszeitraum           | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|--------------------------|--------|---------|-----------------------|
| <b>NB-ESG-Quotient</b>   | 58     | 1-100   | 99 %                  |
| <b>Daten von Dritten</b> | 4,8    | 0-10    |                       |

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

## 2. ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy, die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy, Ausschlüsse gemäß dem Paris-abgestimmten EU-Referenzwert („**EU-PAB**“), wie im Rahmen der Neuberger Berman EU Climate Benchmark Standard Exclusions Policy vorgesehen, und die sonstigen spezifischen Ausschlüsse identifiziert wurden, die im SFDR-Anhang des Portfolios angegeben sind, oder nicht mit diesen vereinbar waren. Zudem investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstößend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen. Bei der Anwendung von ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik auf das Portfolio haben der Manager und der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik verstoßen. Wo möglich haben der Manager und der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise ihrer Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager erörterten und diskutierten die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund ihres eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

### Sonstiges

Im Bezugszeitraum brachte das Portfolio die Neuberger Berman Enhanced Sustainable Exclusion Policy nicht zur Anwendung.

Im Bezugszeitraum führte das Portfolio die EU-PAB-Ausschlüsse ein, wie im Rahmen der Neuberger Berman EU Climate Benchmark Standard Exclusions Policy vorgesehen. Die Neuberger Berman EU Climate Benchmark Standard Exclusions Policy wurde vom Manager und vom Sub-Investment-Manager erstellt zur Ausrichtung auf die Leitlinien der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde zu Fondsnamen, die ESG- oder nachhaltigkeitsbezogene Begriffe verwenden.

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

Ausnahmsweise wurden für den Bezugszeitraum 2022 die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgte (sie umfassen die Veröffentlichung der SFDR-Vorlagen für vorvertragliche Informationen).

1. Der NB-ESG-Quotient

|                            | <b>NB-ESG-Quotient-Rating</b> | <b>Rating der Daten durch externe Anbieter</b> | <b>Kombinierte Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| <b>Bereich</b>             | 1-100                         | 0-10   | 0-100 %                      |
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 56                            | 4,8  | 97 %                         |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 57                            | 4,8  | 99 %                         |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 58                            | 4,8  | 99 %                         |

2. Ausschlüsse

|                     | Gesamtzahl der Verstöße |
|---------------------|-------------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | 0                       |
| Bezugszeitraum 2023 | 0                       |
| Bezugszeitraum 2024 | 0                       |

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

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckt sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Investition zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Investition eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat (wie nachstehend erläutert) und (iii) eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick

auf die Unternehmensführung eines Emittenten, um festzustellen, ob der Emittent einer derartige Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griffen der Manager und der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die wirtschaftlichen Tätigkeiten eines Emittenten auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager überprüften die Emittenten auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Emittenten diese Prüfung bestanden haben, haben der Manager und der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag des Emittenten zur Wirtschaft gemessen.

Bei Unternehmensemittenten haben der Manager und der Sub-Investment-Manager dies auf drei Arten erfasst:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden);
- Ausrichtung der Umsätze auf die UN-Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDGs“) und
- Untemehensemittenten in Sektoren mit großen Auswirkungen, die sich auf der Grundlage des NB Net-Zero Alignment Indicator auf einen Netto-Null-Kurs umstellen.

Im Bezugszeitraum aktualisierten der Manager und der Sub-Investment Manager den SFDR-Anhang des Portfolios, um dem Umstand Rechnung zu tragen, dass der Manager und der Sub-Investment Manager bei der Ermittlung nachhaltiger Investitionen Emittenten aus Sektoren mit großen Auswirkungen berücksichtigen, die sich auf der Grundlage des NB Net-Zero Alignment Indicator auf einen Netto-Null-Kurs umstellen.

Die Berücksichtigung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs, nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers, war durch die Verfügbarkeit von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griffen der Manager und der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Stellvertreterdaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

Bei staatlichen Emittenten haben der Manager und der Sub-Investment-Manager dies auf folgenden Arten erfasst:

- Fortschritte bei der Anpassung an den Klimawandel und dem Klimaschutz und
- Fortschritte bei der Erreichung der SDGs, mit Schwerpunkt auf Lebenserwartung und Bildung

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

Der Manager und der Sub-Investment-Manager wandten ihren Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigen. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachteten der Manager und der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Bei der Feststellung, ob die ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen des Portfolios nicht erheblich beeinträchtigt wurden, berücksichtigten der Manager und der Sub-Investment-Manager die in Teil 1 der nachstehenden Tabelle aufgeführten Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen für Unternehmensemittenten (die „**PAIs**“) und die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen für staatliche Emittenten (die „**staatlichen PAIs**“) wie nachfolgend in Teil 2 der Tabelle dargelegt:

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.

| <b>Teil 1 – PAIs</b>              |   |
|-----------------------------------|---|
| <b>Thema</b>                      | <b>Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen</b>  |
| <i>Treibhausgas-emissionen</i>    | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind<br>PAI 5 – Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen<br>PAI 6 – Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren  |
| <i>Biodiversität</i>              | PAI 7 – Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken  |
| <i>Wasser</i>                     | PAI 8 – Emissionen in Wasser  |
| <i>Abfall</i>                     | PAI 9 – Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle  |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen<br>PAI 11 – Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen<br>PAI 12 – Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle<br>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen<br>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |
| <b>Teil 2 – staatliche PAIs</b>   |   |
| <i>Umwelt</i>                     | PAI 15 – THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird   |
| <i>Soziales</i>                   | PAI 16 - Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen   |

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager haben auch Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen berücksichtigt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager investierten nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

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

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Manager und den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, dass die ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen des Portfolios nicht erheblich beeinträchtigt wurden, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Emittenten, die quantitative und qualitative Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden, unterschreiten;
- Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Emittenten, wenn sie unter die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

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

Der Manager und der Sub-Investment-Manager investierten nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*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 EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

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

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



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

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager und den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigten PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

- I. Wie oben unter „Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?“ erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele führten, alle PAIs und staatlichen PAIs berücksichtigt.
- II. Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigten in Bezug auf die Nachhaltigkeitsfaktoren die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 1 der nachstehenden Tabelle für Unternehmensemittenten (die „**PAIs für Unternehmensemittenten**“), und die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 2 der nachstehenden Tabelle für staatliche Emittenten (die „**staatlichen PAIs**“) (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“) aufgeführt sind:

| <b>Teil 1 – PAIs für Unternehmensemittenten</b> |  |
|---|--|
| <b>Thema</b>                                    | <b>Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen</b>   |
| <i>Treibhausgasemissionen</i>                   | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind  |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i>               | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen<br>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen<br>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |
| <b>Teil 2 – staatliche PAIs</b>                 |  |
| <i>Umwelt</i>                                   | PAI 15 – THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird  |
| <i>Soziales</i>                                 | PAI 16 - Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen  |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager und den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager und der Sub-Investment-Manager haben den Bloomberg Industry Classification Standard („BICS“) verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2024 – 31. Dezember 2024

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2024 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

| Größte Investitionen                         | Sektor      | In % der Vermögenswerte | Land        |
|--|-------------|-------------------------|-------------|
| REPUBLIC OF PERU REGD                        | STAATLICH   | 4,4                     | PERU        |
| REPUBLIC OF INDONESIA /EUR/ REGD             | STAATLICH   | 3,3                     | INDONESIEN  |
| ROMANIA /EUR/ REGD REG S EMTN                | STAATLICH   | 2,7                     | RUMÄNIEN    |
| REPUBLIC OF INDONESIA REGD                   | STAATLICH   | 2,6                     | INDONESIEN  |
| UNITED MEXICAN STATES REGD                   | STAATLICH   | 1,9                     | MEXIKO      |
| UNITED MEXICAN STATES REGD MTN SER GMTN      | STAATLICH   | 1,8                     | MEXIKO      |
| MEX BONOS DESARR FIX RT /MXN/ REGD SER M     | STAATLICH   | 1,4                     | MEXIKO      |
| REPUBLIC OF KAZAKHSTAN /EUR/ REGD REG S EMTN | STAATLICH   | 1,4                     | KASACHSTAN  |
| BANQUE OUEST AFRICAINE D REGD                | STAATLICH   | 1,3                     | TOGO        |
| CODELCO INC REGD                             | GRUNDSTOFFE | 1,3                     | CHILE       |
| REPUBLIC OF PHILIPPINES /EUR/ REGD           | STAATLICH   | 1,3                     | PHILIPPINEN |
| GOVT OF BERMUDA REGD REG S                   | STAATLICH   | 1,3                     | BERMUDA     |
| REPUBLICA ORIENT URUGUAY REGD                | STAATLICH   | 1,3                     | URUGUAY     |
| REPUBLIC OF INDONESIA /EUR/ REGD             | STAATLICH   | 1,3                     | INDONESIEN  |
| MEX BONOS DESARR FIX RT /MXN/ REGD SER M     | STAATLICH   | 1,2                     | MEXIKO      |

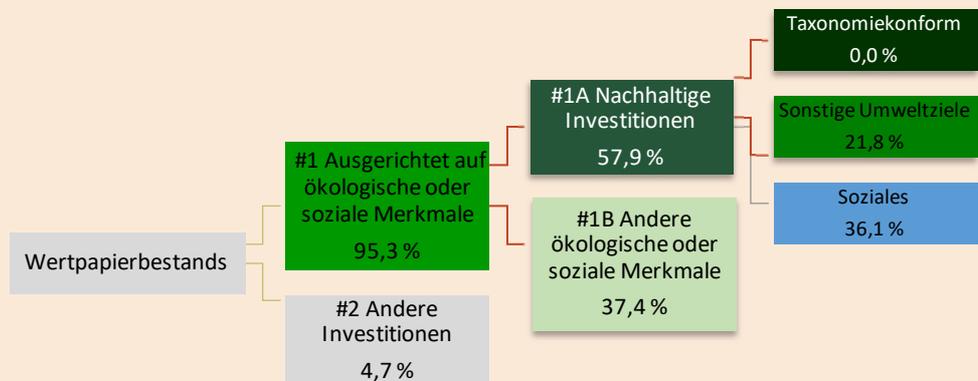


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Vermögensallokation des Portfolios im Bezugszeitraum wird in nachstehender Grafik dargestellt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager berechneten den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager und der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatten. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder Dritten beruhen.



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

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

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige** Investitionen umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.

- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

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

| Wirtschaftssektoren - BICS  | In % der Vermögenswerte |
|-----------------------------|-------------------------|
| STAATLICH                   | 82,9                    |
| FINANZWERTEN                | 7,9                     |
| GRUNDSTOFFE                 | 3,2                     |
| INDUSTRIE                   | 2,0                     |
| NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 1,6                     |
| KOMMUNIKATION               | 1,1                     |
| TECHNOLOGIE                 | 0,6                     |
| VERSORGUNG                  | 0,4                     |
| ENERGIE                     | 0,3                     |



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager können bestätigen, dass das Portfolio in Investitionen investiert hat, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Manager und der Sub-Investment-Manager werden das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessert.

### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

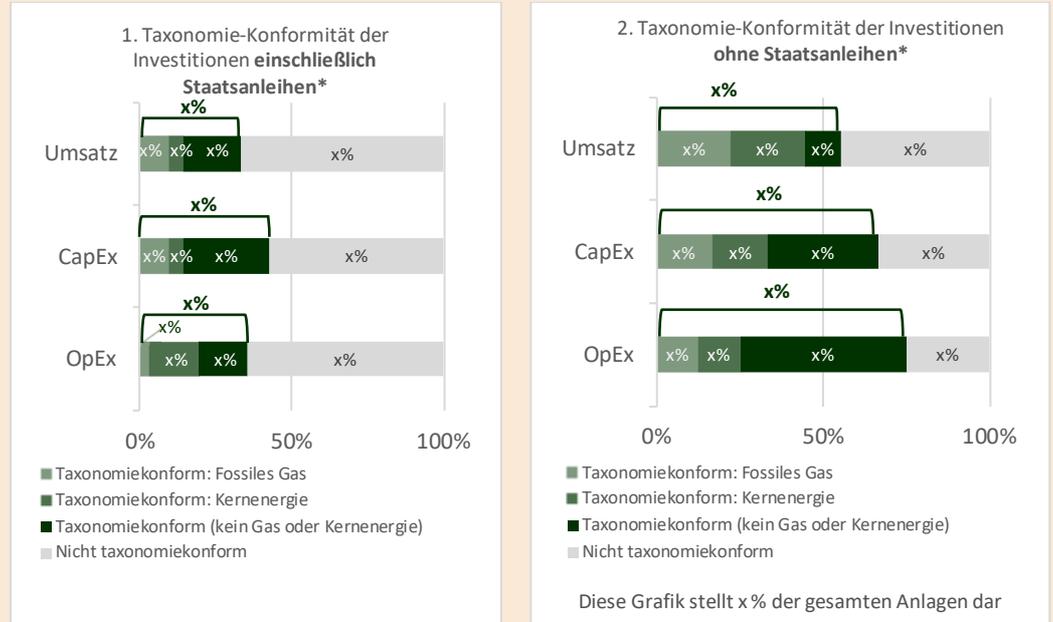
- Ja:  
 In fossiles Gas  In Kernenergie  
 Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten 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 Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* 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?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



## Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

. Dies ist in der Grafik zur Vermögensallokation unter der Frage „Wie sah die Vermögensallokation aus?“ oben angegeben.



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?

Dies ist in der Grafik zur Vermögensallokation unter der Frage „Wie sah die Vermögensallokation aus?“ oben angegeben.



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

„Andere Investitionen“ umfasst die übrigen Investitionen des Portfolios, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren noch als nachhaltige Investitionen eingestuft wurden.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager und der Sub-Investment-Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachteten, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen, verhinderten und sie sicherstellen, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager wendeten bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager verstehen unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Managers und des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Managers und des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten sowie Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotienten herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Manager und vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

### II. Mitwirkung:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager engagierten sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager betrachteten diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil ihres Anlageprozesses. Die Fortschritte bei der Einbindung wurden vom Manager und dem Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### III. ESG-Sektor-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



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

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k.A.
- **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?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k.A.

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

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Emerging Markets Equity Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300XPW2SIPQYGFT52

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser 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?

**Ja**

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

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht 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**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie hier.

Sofem in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.

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



Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Luftqualität, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zur Gesundheitsversorgung, Datenschutz und -sicherheit, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsstandards in den Lieferketten.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „NB- ESG-Quotient“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („NB“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor in den Schwellenländern angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteten ESG-Daten erstellt. Ergänzend kamen interne qualitative Analysen hinzu, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen in Schwellenländern im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Durch die Integration lokaler Erkenntnisse in die globale Wesentlichkeitsmatrix von NB nutzte der Sub-Investment-Manager die globale Wesentlichkeitsmatrix von NB und passte die wesentlichen ESG-Merkmale an, um sicherzustellen, dass sie den Schwellenländern Rechnung trugen. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB berücksichtigte die langfristigen ESG-Merkmale umfassend, welche die Entwicklung der Branchen und Unternehmen in den Schwellenländern betrafen, und identifizierte Unternehmen, die in den Schwellenländern als Werttreiber fungierten.

Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Unternehmen wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss. Unternehmen mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Unternehmen mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Unternehmen diesbezüglich keine Maßnahmen ergriff, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt.

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

| Bezugszeitraum    | Rating          | Bereich           | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|-----------------|-------------------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient   | ES: B<br>G: 2,6 | ES: A-D<br>G: 1-4 | 94 %                  |
| Daten von Dritten | 6,2             | 0-10              |                       |

Im Hinblick auf das NB-ESG-Quotient-Rating für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale („**ES**“) werden die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance („**G**“) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jedes im Portfolio gehaltene Unternehmen erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums erfasste Climate Value-at-Risk („**CVaR**“) das Ausmaß der Risiken und der Chancen des Klimaübergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmen.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

|  |         |
|--|---------|
| Der CVaR prognostizierte, dass ein Szenario der Klimaerwärmung beim verwalteten Vermögen im Bezugszeitraum zu folgendem Wertverlust führen könnte. | -22,2 % |
| CVaR-Abdeckung im Bezugszeitraum.  | 84 %    |

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken und Chancen, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

### 3. ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy und die sonstigen spezifischen Ausschlüsse identifiziert wurden, die im SFDR-Anhang des Portfolios angegeben sind, oder nicht mit diesen vereinbar waren. Zudem investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

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

Ausnahmsweise wurden für den Bezugszeitraum 2022 die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgte (sie umfassen die Veröffentlichung der SFDR-Vorlagen für vorvertragliche Informationen).

#### 1. NB-ESG-Quotient

|                            | <b>NB-ESG-Quotient-Rating</b> | <b>Rating der Daten durch externe Anbieter</b> | <b>Kombinierte Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| <b>Bereich</b>             | ES: A-D<br>G: 1-4             | 0-10   | 0-100 %                      |
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | ES: B<br>G: 2,0               | 5,6  | 95 %                         |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | ES: B<br>G: 2,7               | 5,9  | 90 %                         |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | ES: B<br>G: 2,6               | 6,2  | 94 %                         |

#### 2. CVaR

|                            | <b>CVaR</b> | <b>Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------|------------------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | -28,8 %     | 91 %             |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | -29,6 %     | 90 %             |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | -22,2 %     | 84 %             |

### 3. Ausschlüsse

|                     | Gesamtzahl der Verstöße |
|---------------------|-------------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | 0                       |
| Bezugszeitraum 2023 | 0                       |
| Bezugszeitraum 2024 | 0                       |

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

k.A.

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

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten. Dessen ungeachtet war der Sub-Investment-Manager nicht in Unternehmen investiert, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst 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.

*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 EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



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

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Unternehmen durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

| <b>PAIs auf Produktebene</b>      |   |
|-----------------------------------|---|
| <b>Thema</b>                      | <b>Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen</b>  |
| <i>Treibhausgasemissionen</i>     | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen   |

PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen

PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



### Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat den Bloomberg Industry Classification Standard („**BICS**“) verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2024 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2024 – 31. Dezember 2024

| Größte Investitionen           | Sektor        | In % der Vermögenswerte | Land            |
|--------------------------------|---------------|-------------------------|-----------------|
| TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR    | TECHNOLOGIE   | 9,7                     | TAIWAN          |
| TENCENT HOLDINGS LTD /HKD/     | KOMMUNIKATION | 5,2                     | CHINA           |
| SAMSUNG ELECTRONICS CO L /KRW/ | TECHNOLOGIE   | 3,9                     | KOREA           |
| ALIBABA GROUP HOLDING LT /HKD/ | KOMMUNIKATION | 2,5                     | CHINA           |
| SK HYNIX INC /KRW/             | TECHNOLOGIE   | 2,4                     | KOREA           |
| TBO TEK LTD /INR/              | KOMMUNIKATION | 2,2                     | INDIEN          |
| NVIDIA CORP                    | TECHNOLOGIE   | 2,0                     | USA             |
| CHINA CONSTRUCTION BANK- /HKD/ | FINANZWERTEN  | 1,9                     | CHINA           |
| MEITUAN-CLASS B /HKD/          | KOMMUNIKATION | 1,8                     | CHINA           |
| KIA CORP /KRW/                 | KONSUMGÜTER   | 1,5                     | KOREA           |
| MEDIATEK INC /TWD/             | TECHNOLOGIE   | 1,5                     | TAIWAN          |
| BANK NEGARA INDO /IDR          | FINANZWERTEN  | 1,3                     | INDONESIEN      |
| RIO TINTO PLC /GBP/            | GRUNDSTOFFE   | 1,3                     | GROSSBRITANNIEN |
| PDD HOLDINGS INC               | KOMMUNIKATION | 1,3                     | IRLAND          |
| EMBRAER SA /BRL/               | INDUSTRIE     | 1,3                     | BRASILIEN       |

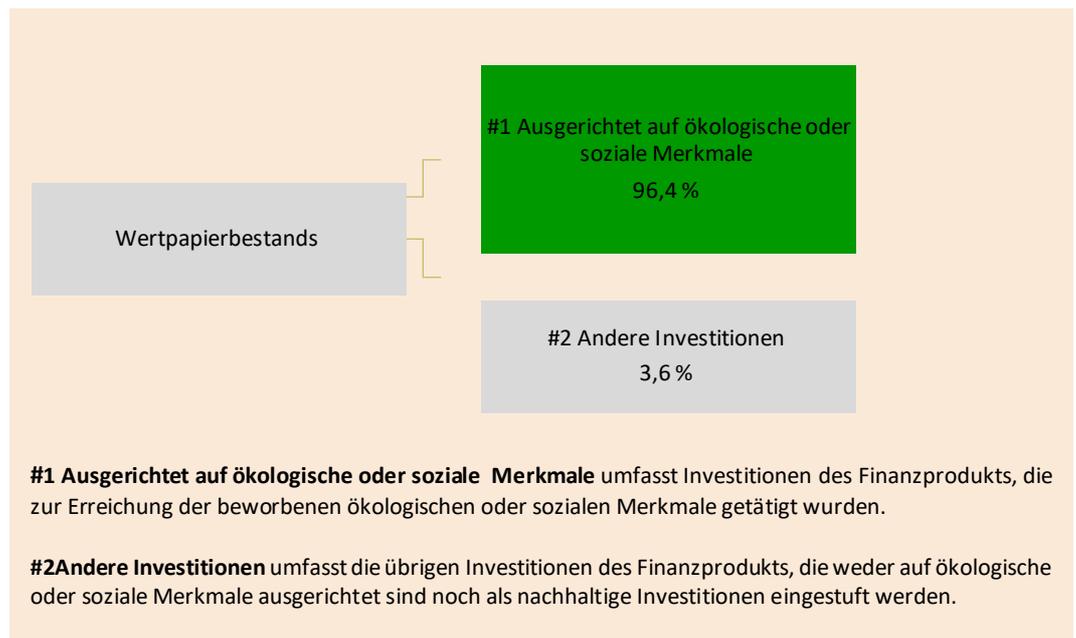


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### ● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Die Vermögensallokation des Portfolios im Bezugszeitraum wird in nachstehender Grafik dargestellt. Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder externen Anbietern beruhen.



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

| Wirtschaftssektoren - BICS  | In % der Vermögenswerte |
|-----------------------------|-------------------------|
| TECHNOLOGIE                 | 23,2                    |
| FINANZWERTEN                | 22,1                    |
| KOMMUNIKATION               | 17,0                    |
| INDUSTRIE                   | 11,8                    |
| NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 8,4                     |

|                       |     |
|-----------------------|-----|
| ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 7,0 |
| ENERGIE               | 4,5 |
| GRUNDSTOFFE           | 3,5 |
| KEINE                 | 1,6 |
| VERSORGUNG            | 0,9 |

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Bei-trag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

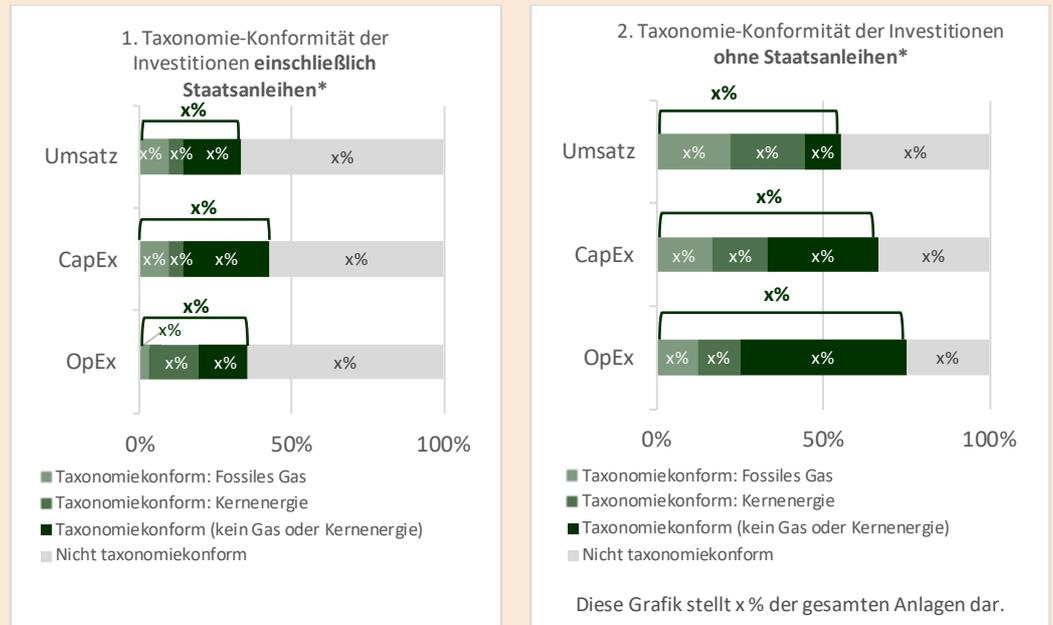
- Ja:
- In fossiles Gas     In Kernenergie
- Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten 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 Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität 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.



\* 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?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



### Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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

„Andere Investitionen“ umfasst die übrigen Investitionen des Portfolios, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren noch als nachhaltige Investitionen eingestuft wurden.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### **I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:**

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten sowie Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde herangezogen, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung besser zu erkennen. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die Gesamtbetrachtung der Unternehmen bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

### **II. Mitwirkung:**

Der Sub-Investment-Manager arbeitete mit den Unternehmen mit einem soliden ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses.

Um die Beziehungen zu den Unternehmen aufrechtzuerhalten und zu verbessern und sicherzustellen, dass die Unternehmen ihren ESG-Kurs verfolgten, führte der Sub-Investment-Manager mit den Unternehmen einen aktiven Dialog, unabhängig davon, ob sie Kontroversen mit großen Auswirkungen oder ein schlechtes NB ESG-Quotient-Rating aufwiesen oder nicht. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### **III. ESG-Sektor-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:**

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



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

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k.A.
- **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?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k.A.

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

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Euro Bond Fund (das „Portfolio“).

**Unternehmenskennung:** 549300TQ5M6FBE2H8T74

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser 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?

**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**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Sofem in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, verantwortliche und transparente Risikoübernahme, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung, Wasserbewirtschaftung und Entsorgung gefährlicher Abfälle.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Geschäftsethik; Chemikaliensicherheit, Beziehungen im Gemeinwesen, umstrittene Beschaffung, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität, verantwortungsbewusste Werbung, Etikettierung und Marketing und Menschenrechte.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigte der Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB China ESG Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („NB“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analyistenteam für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergriffen hat, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Darüber hinaus bemühte sich der Manager, konstruktiven Dialogen bei Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating Vorrang einzuräumen, um zu beurteilen, ob Bedenken angemessen berücksichtigt wurden.

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

| Bezugszeitraum    | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|--------|---------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient   | 64     | 1-100   | 95 %                  |
| Daten von Dritten | 6,5    | 0-10    |                       |

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums wurde mit Climate Value-at-Risk („**CVaR**“) das Ausmaß der Risiken und Chancen des Übergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmensemittenten gemessen.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts einer Emission oder eines Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

|  |        |
|--|--------|
| Der CVaR prognostizierte, dass ein Szenario der Klimaerwärmung beim verwalteten Vermögen im Bezugszeitraum zu folgendem Wertverlust führen könnte. | -3,7 % |
| CVaR-Abdeckung im Bezugszeitraum.  | 18 %   |

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

### 3. ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy und die sonstigen spezifischen Ausschlüsse identifiziert wurden, die im SFDR-Anhang des Portfolios angegeben sind, oder nicht mit diesen vereinbar waren. Außerdem investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („UNGC-Grundsätze“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik auf das Portfolio verwendete der Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten, die gegen die oben dargelegte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik verstoßen. Wo möglich versuchte der Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

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

Ausnahmsweise wurden für den Bezugszeitraum 2022 die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgte (sie umfassen die Veröffentlichung der SFDR-Vorlagen für vorvertragliche Informationen).

#### 1. NB-ESG-Quotient

|                            | <b>NB-ESG-Quotient-Rating</b> | <b>Rating der Daten durch externe Anbieter</b> | <b>Kombinierte Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| <b>Bereich</b>             | 1-100                         | 0-10   | 0-100 %                      |
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 66                            | 6,0  | 90 %                         |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 65                            | 6,3  | 95 %                         |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 64                            | 6,5  | 95 %                         |

#### 2. CVaR

|                            | <b>CVaR</b> | <b>Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------|------------------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | -5,4 %      | 12 %             |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | -3,1 %      | 16 %             |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | -3,7 %      | 18 %             |

### 3. Ausschlüsse

|                     | Gesamtzahl der Verstöße |
|---------------------|-------------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | 0                       |
| Bezugszeitraum 2023 | 0                       |
| Bezugszeitraum 2024 | 0                       |

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Manager nicht in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst 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.

*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 EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

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

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



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

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager) berücksichtigt.

Der Manager berücksichtigte in Bezug auf die Nachhaltigkeitsfaktoren die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 1 der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind, für Unternehmensemittenten (die „**PAIs für Unternehmensemittenten**“), und die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 2 der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind, für staatliche Emittenten (die „**staatliche PAIs**“) (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“):

| <b>Teil 1 – PAIs für Unternehmensemittenten</b> |  |
|---|--|
| <b>Thema</b>                                    | <b>Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen</b>   |
| <i>Treibhausgasemissionen</i>                   | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind  |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i>               | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen<br>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen<br>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

| Teil 2 – staatliche PAIs |   |
|--------------------------|---|
| Umwelt                   | PAI 15 – THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird               |
| Soziales                 | PAI 16 - Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel, die vom Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



### Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager hat den Bloomberg Industry Classification Standard („BICS“) verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2024 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2024 – 31. Dezember 2024

| Größte Investitionen                              | Sektor       | In % der Vermögenswerte | Land          |
|---|--------------|-------------------------|---------------|
| EUROPEAN UNION /EUR/ REGD REG S EMTN SER NGEU     | STAATLICH    | 3,6                     | BELGIEN       |
| EUROPEAN UNION /EUR/ REGD REG S SER NGEU          | STAATLICH    | 3,4                     | BELGIEN       |
| EFSF /EUR/ REGD REG S                             | STAATLICH    | 2,2                     | LUXEMBURG     |
| KFW /EUR/ REGD REG S EMTN                         | FINANZWERTEN | 1,6                     | DEUTSCHLAND   |
| EURO STABILITY MECHANISM /EUR/ REGD REG S         | STAATLICH    | 1,5                     | SUPRANATIONAL |
| SFIL SA /EUR/ REGD REG S EMTN                     | STAATLICH    | 1,4                     | FRANKREICH    |
| CAISSE REFINANCE L'HABIT /EUR/ REGD REG S         | FINANZWERTEN | 1,3                     | FRANKREICH    |
| ASR NEDERLAND NV /EUR/ REGD V/R /PERP/ REG S      | FINANZWERTEN | 1,1                     | NIEDERLANDE   |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO /EUR/ REGD               | STAATLICH    | 1,1                     | SPANIEN       |
| NETHERLANDS GOVERNMENT /EUR/ REGD                 | STAATLICH    | 1,0                     | NIEDERLANDE   |
| BUONI POLIENNALI DEL TES /EUR/ REGD REG S SER 2Y  | STAATLICH    | 1,0                     | ITALIEN       |
| HELLENIC REPUBLIC /EUR/ REGD                      | STAATLICH    | 1,0                     | GRIECHENLAND  |
| SLOVAKIA GOVERNMENT BOND /EUR/ REGD REG S SER 250 | STAATLICH    | 0,9                     | SLOWAKEI      |
| ROMANIA /EUR/ REGD REG S EMTN                     | STAATLICH    | 0,9                     | RUMÄNIEN      |
| ROMANIA /EUR/ REGD REG S EMTN                     | STAATLICH    | 0,9                     | RUMÄNIEN      |

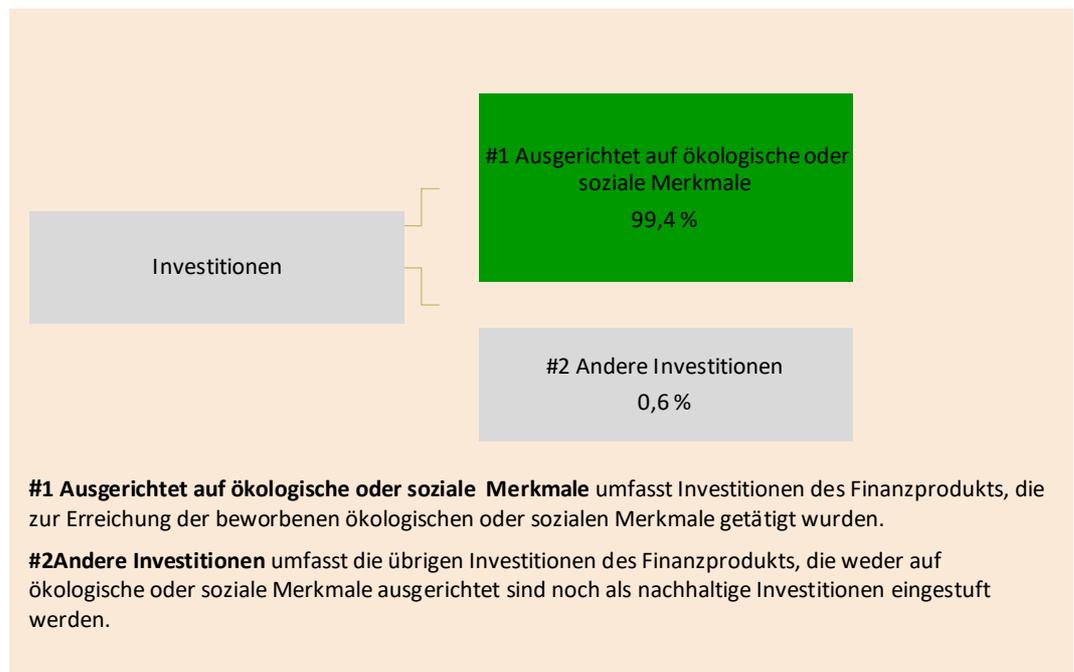


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### ● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Die Vermögensallokation des Portfolios im Bezugszeitraum wird in nachstehender Grafik dargestellt. Der Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen.



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

| Wirtschaftssektoren - BICS  | In % der Vermögenswerte |
|-----------------------------|-------------------------|
| STAATLICH                   | 46,3                    |
| FINANZWERTEN                | 31,7                    |
| NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 5,9                     |
| ZYKLISCHE KONSUMGÜTER       | 5,8                     |
| VERSORGUNG                  | 4,0                     |
| KEINE                       | 1,9                     |
| KOMMUNIKATION               | 1,6                     |
| INDUSTRIE                   | 1,4                     |
| GRUNDSTOFFE                 | 0,8                     |

ENERGIE  
TECHNOLOGIE

0,5  
0,1



### Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für

**Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

#### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

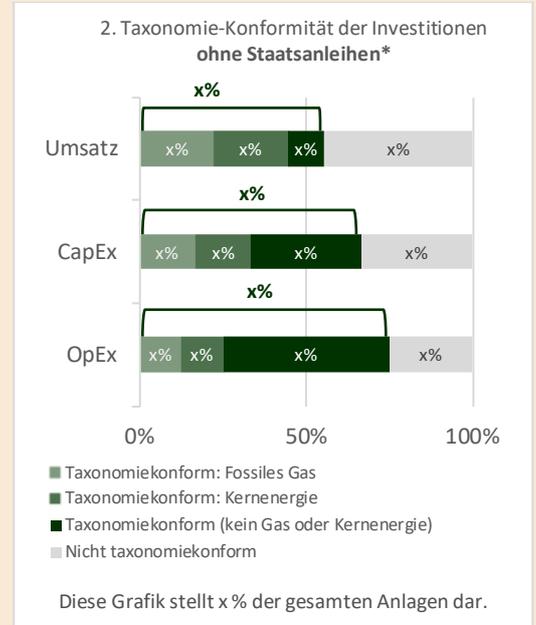
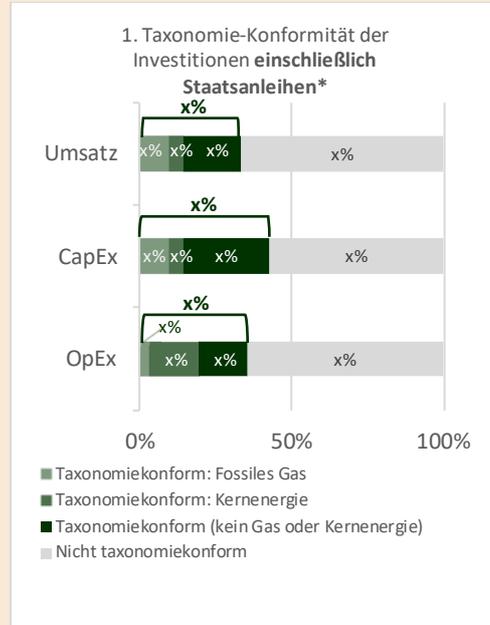
Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten 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 Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. 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.



\* 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?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



### **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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

„Andere Investitionen“ umfasst die übrigen Investitionen des Portfolios, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren noch als nachhaltige Investitionen eingestuft wurden.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder zur Gewährleistung einer adäquaten Liquidität, Absicherung und Besicherung.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Emittentanalysen durch die Investmentteams des Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten sowie Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in seine internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

### II. Mitwirkung:

Der Manager arbeitete mit den Emittenten über ein solides ESG-Dialogprogramm zusammen. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung der Mitwirkung verfolgt.

### III. ESG-Sektor-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



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

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k.A.
- **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?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k.A.

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

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300ZPJNN43P39QR29

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser 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?

**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**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Sofem in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, verantwortliche und transparente Risikoübernahme, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung, Wasserbewirtschaftung und Entsorgung gefährlicher Abfälle.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Geschäftsethik; Chemikaliensicherheit, Beziehungen im Gemeinwesen, umstrittene Beschaffung, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität, verantwortungsbewusste Werbung, Etikettierung und Marketing und Menschenrechte.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigte der Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB China ESG Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („NB“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analyistenteam für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergriffen hat, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Darüber hinaus bemühte sich der Manager, konstruktiven Dialogen bei Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating Vorrang einzuräumen, um zu beurteilen, ob Bedenken angemessen berücksichtigt wurden.

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

| Bezugszeitraum           | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|--------------------------|--------|---------|-----------------------|
| <b>NB-ESG-Quotient</b>   | 65     | 1-100   | 96 %                  |
| <b>Daten von Dritten</b> | 6,7    | 0-10    |                       |

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums wurde mit Climate Value-at-Risk („**CVaR**“) das Ausmaß der Risiken und Chancen des Übergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmensemittenten gemessen.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts einer Emission oder eines Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

|  |        |
|--|--------|
| Der CVaR prognostizierte, dass ein Szenario der Klimaerwärmung beim verwalteten Vermögen im Bezugszeitraum zu folgendem Wertverlust führen könnte. | -3,4 % |
| CVaR-Abdeckung im Bezugszeitraum.  | 21 %   |

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

## 3. ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman

Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy und die sonstigen spezifischen Ausschlüsse identifiziert wurden, die im SFDR-Anhang des Portfolios angegeben sind, oder nicht mit diesen vereinbar waren. Zudem investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („UNGC-Grundsätze“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („OECD-Leitsätze“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („UNGPs“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („ILO-Normen“) verstießen.

Bei der Anwendung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik auf das Portfolio verwendete der Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten, die gegen die oben dargelegte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik verstoßen. Wo möglich versuchte der Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

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

Ausnahmsweise wurden für den Bezugszeitraum 2022 die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgte (sie umfassen die Veröffentlichung der SFDR-Vorlagen für vorvertragliche Informationen).

1. NB-ESG-Quotient

|                            | <b>NB-ESG-Quotient-Rating</b> | <b>Rating der Daten durch externe Anbieter</b> | <b>Kombinierte Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| <b>Bereich</b>             | 1-100                         | 0-10   | 0-100 %                      |
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 66                            | 6,5  | 94 %                         |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 65                            | 6,8  | 97 %                         |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 65                            | 6,7  | 96 %                         |

2. CVaR

|                            | <b>CVaR</b> | <b>Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------|------------------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | -5,0 %      | 17 %             |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | -5,4 %      | 21 %             |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | -3,4 %      | 21 %             |

### 3. Ausschlüsse

|                     | Gesamtzahl der Verstöße |
|---------------------|-------------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | 0                       |
| Bezugszeitraum 2023 | 0                       |
| Bezugszeitraum 2024 | 0                       |

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Manager nicht in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*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 EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

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

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



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

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager) berücksichtigt.

Der Manager berücksichtigte in Bezug auf die Nachhaltigkeitsfaktoren die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 1 der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind, für Unternehmensemittenten (die „**PAIs für Unternehmensemittenten**“), und die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 2 der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind, für staatliche Emittenten (die „**staatliche PAIs**“) (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“):

| Teil 1 – PAIs für Unternehmensemittenten |   |
|--|---|
| Thema                                    | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen   |
| <i>Treibhausgasemissionen</i>            | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind                   |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i>        | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen<br>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen |

|                                 |   |
|---------------------------------|---|
|                                 | PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |
| <b>Teil 2 – staatliche PAIs</b> |   |
| <i>Umwelt</i>                   | PAI 15 – THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird   |
| <i>Soziales</i>                 | PAI 16 - Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen                               |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbar Daten begrenzt. Der Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel, die vom Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



### Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager hat den Bloomberg Industry Classification Standard („BICS“) verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2024 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2024 – 31. Dezember 2024

| Größte Investitionen                            | Sektor       | In % der Vermögenswerte | Land                  |
|---|--------------|-------------------------|-----------------------|
| NYKREDIT REALKREDIT AS /DKK/ REGD REG S SER 01E | FINANZWERTEN | 2,0                     | DÄNEMARK              |
| EUROPEAN UNION /EUR/ REGD REG S EMTN SER NGEU   | STAATLICH    | 1,8                     | BELGIEN               |
| NYKREDIT REALKREDIT AS /DKK/ REGD REG S SER 01E | FINANZWERTEN | 1,6                     | DÄNEMARK              |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND /EUR/ REGD REG S       | STAATLICH    | 1,4                     | DEUTSCHLAND           |
| EUROPEAN UNION /EUR/ REGD REG S EMTN SER NGEU   | STAATLICH    | 1,2                     | BELGIEN               |
| KFW /EUR/ REGD MTN SER GMTN                     | FINANZWERTEN | 1,2                     | DEUTSCHLAND           |
| CZECH REPUBLIC /CZK/ REGD SER 151               | STAATLICH    | 1,2                     | TSCHECHISCHE REPUBLIK |
| KFW /EUR/ REGD REG S EMTN                       | FINANZWERTEN | 1,1                     | DEUTSCHLAND           |
| BANK GOSPODARSTWA KRAJOW /EUR/ REGD REG S EMTN  | FINANZWERTEN | 1,1                     | POLEN                 |
| NYKREDIT REALKREDIT AS /DKK/ REGD REG S SER 01E | FINANZWERTEN | 1,1                     | DÄNEMARK              |
| ROMANIA /EUR/ REGD REG S EMTN                   | STAATLICH    | 1,1                     | RUMÄNIEN              |
| HELLENIC REPUBLIC /EUR/ REGD                    | STAATLICH    | 1,1                     | GRIECHENLAND          |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO /EUR/ REGD             | STAATLICH    | 1,0                     | SPANIEN               |
| POLAND GOVERNMENT BOND /PLN/ REGD SER 0729      | STAATLICH    | 1,0                     | POLEN                 |
| CANADIAN IMPERIAL BANK /EUR/ REGD REG S EMTN    | FINANZWERTEN | 0,9                     | KANADA                |

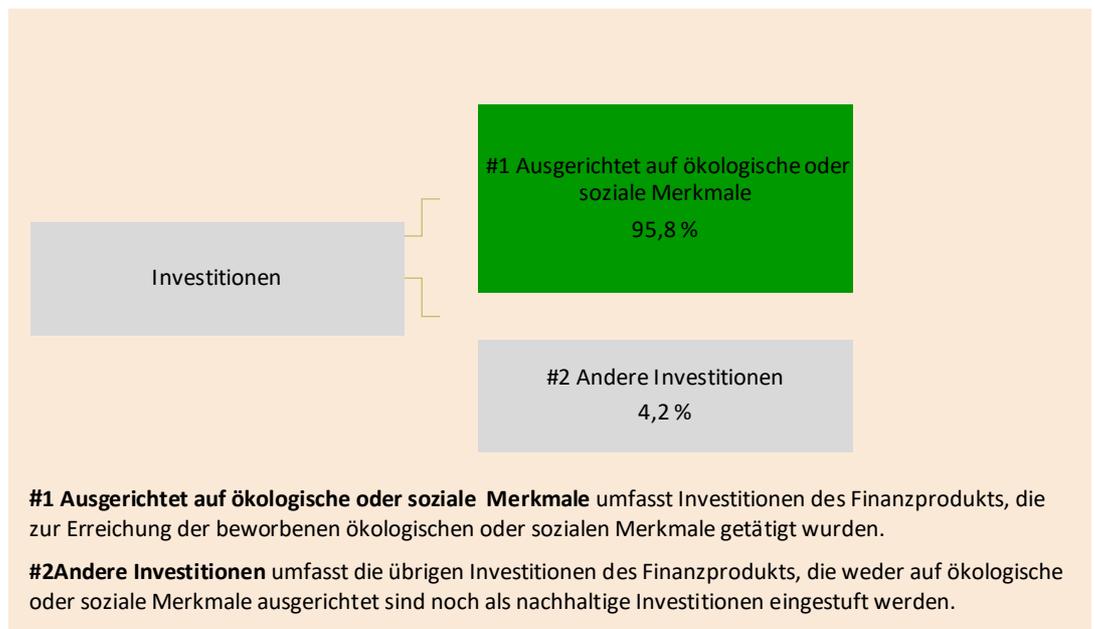


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Vermögensallokation des Portfolios im Bezugszeitraum wird in nachstehender Grafik dargestellt. Der Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen.



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

| <b>Wirtschaftssektoren - BICS</b>               | <b>In % der Vermögenswerte</b> |
|---|--------------------------------|
| STAATLICH                                       | 39,3                           |
| FINANZWERTEN                                    | 37,7                           |
| VERSORGUNG                                      | 5,3                            |
| ZYKLISCHE KONSUMGÜTER                           | 4,8                            |
| NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER                     | 4,2                            |
| GRUNDSTOFFE                                     | 2,0                            |
| KEINE   | 1,9                            |
| INDUSTRIE                                       | 1,5                            |
| KOMMUNIKATION                                   | 1,4                            |
| ENERGIE   | 0,9                            |
| HYPOTHEKARISCH BESICHERTE WERTPAPIERE           | 0,6                            |
| FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE (ABS-ANLEIHEN) | 0,3                            |
| TECHNOLOGIE                                     | 0,1                            |

|



## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

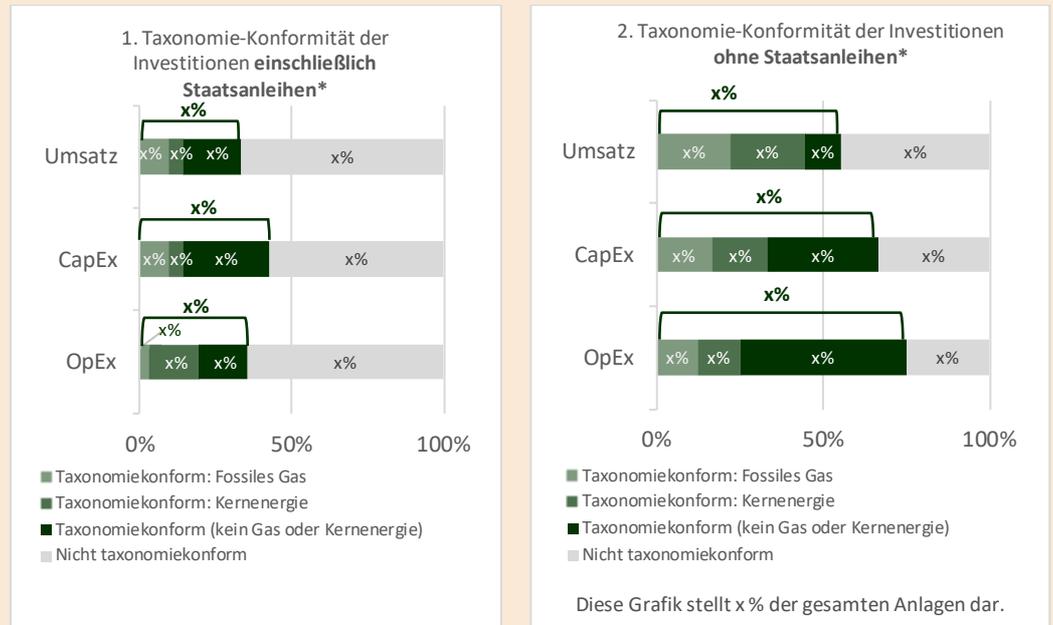
- Ja:  
 In fossiles Gas  In Kernenergie
- Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten 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 Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität 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.



\* 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?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



### **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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

„Andere Investitionen“ umfasst die übrigen Investitionen des Portfolios, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren noch als nachhaltige Investitionen eingestuft wurden.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder zur Gewährleistung einer adäquaten Liquidität, Absicherung und Besicherung.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Emittentenanalysen durch die Investmentteams des Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten sowie Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in seine internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

### II. Mitwirkung:

Der Manager arbeitete mit den Emittenten über ein solides ESG-Dialogprogramm zusammen. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung der Mitwirkung verfolgt.

### III. ESG-Sektor-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



### **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***  
k.A.
- ***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?***  
k.A.
- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***  
k.A.
- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***  
k.A.

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

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten.**

Name des Produkts: Neuberger Berman European High Yield Bond Fund (das „Portfolio“)

Unternehmenskennung: 549300Z7RL5FC5H5DB41

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser 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?

**Ja**

**Nein**

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

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht 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: \_\_\_%

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 18,8\* % 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**

\*Das Portfolio führte während des Bezugszeitraums eine Mindestverpflichtung zu nachhaltigen Investitionen von 10 % ein. Die Angaben zu nachhaltigen Investitionen in dieser periodischen Berichtsvorlage wurden daher auf Grundlage des Durchschnitts aus den Werten zum Ende des dritten und vierten Quartals 2024 (als die einzigen Quartalsenden nach Einführung der Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen) erstellt. Die Zahlen zu den nachhaltigen Investitionen sind, bedingt durch die uneinheitlichen Bezugszeiträume, nicht in der Tabelle zur Vermögensallokation enthalten.

\*\*Weitere Einzelheiten zur Vermögensallokation des Portfolios (einschließlich des Engagements in nachhaltige Investitionen) finden Sie unter der Frage „Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?“

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Sofem in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, THG-Emissionen, Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung, Wasserbewirtschaftung und Entsorgung gefährlicher Abfälle.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Geschäftsethik; Chemikaliensicherheit, Beziehungen im Gemeinwesen, umstrittene Beschaffung, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität, verantwortungsbewusste Werbung, Etikettierung und Marketing und Menschenrechte.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB China ESG Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**NB**“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentrierte, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen. Jedes Sektorkriterium wurde unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analyistentams für das Portfolio genutzt wurde.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existierte kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergriffen hat, wurden mit größerer

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

Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Des Weiteren war der Sub-Investment-Manager bestrebt, eine konstruktive Zusammenarbeit mit den Unternehmensemittenten zu priorisieren.

| Bezugszeitraum    | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|--------|---------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient   | 59     | 1-100   | 98 %                  |
| Daten von Dritten | 6,1    | 0-10    |                       |

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 das niedrigste und 100 das höchste Rating darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums wurde mit Climate Value-at-Risk („**CVaR**“) das Ausmaß der Risiken und Chancen des Übergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmensemittenten gemessen.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts einer Emission oder eines Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

|  |        |
|--|--------|
| Der CVaR prognostizierte, dass ein Szenario der Klimaerwärmung beim verwalteten Vermögen im Bezugszeitraum zu folgendem Wertverlust führen könnte. | -8,5 % |
| CVaR-Abdeckung im Bezugszeitraum.  | 36 %   |

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

### 3. ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy, die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy und die sonstigen spezifischen Ausschlüsse identifiziert wurden, die im SFDR-Anhang des Portfolios angegeben sind, oder nicht mit diesen vereinbar waren. Zudem investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

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

Ausnahmsweise wurden für den Bezugszeitraum 2022 die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgte (sie umfassen die Veröffentlichung der SFDR-Vorlagen für vorvertragliche Informationen).

#### 1. NB-ESG-Quotient

|                            | <b>NB-ESG-Quotient-Rating</b> | <b>Rating der Daten durch externe Anbieter</b> | <b>Kombinierte Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| <b>Bereich</b>             | 1-100                         | 0-10   | 0-100 %                      |
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 59                            | 5,5  | 98 %                         |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 60                            | 6,1  | 99 %                         |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 59                            | 6,1  | 98 %                         |

#### 2. CVaR

|                            | <b>CVaR</b> | <b>Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------|------------------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | -8,7 %      | 34 %             |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | -10,1 %     | 36 %             |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | -8,5 %      | 36 %             |

### 3. Ausschlüsse

|                            | Gesamtzahl der Verstöße |
|----------------------------|-------------------------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 0                       |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 0                       |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 0                       |

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

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckte sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Anlage zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Anlage eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat (wie nachstehend erläutert) und (iii) auf eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die gute Unternehmensführung eines Emittenten, um festzustellen, ob der Emittent einer derartigen Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griff der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die Wirtschaftstätigkeit eines Emittenten auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren.

Der Sub-Investment-Manager überprüfte die Emittenten auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Emittenten diese Prüfung bestanden haben, hat der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag des Emittenten zur Wirtschaft gemessen.

Der Sub-Investment-Manager erfasste dies auf drei Arten:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden);
- Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs und
- Untermehensemittenten in Sektoren mit großen Auswirkungen, die sich auf der Grundlage des NB Net-Zero Alignment Indicator auf einen Netto-Null-Kurs umstellen.

Die Beurteilung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs wurde durch die Verfügbarkeit von angemessenen, verfügbaren und überprüfbaren Daten eingeschränkt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griff der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Proxydaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des Rahmens für nachhaltige Investitionen von NB zurück.

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

Der Sub-Investment-Manager wandte seinen Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigen. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachtete der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele waren, die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (die „PAIs“):

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.

| PAIs                              |   |
|-----------------------------------|---|
| Thema                             | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen   |
| <i>Treibhausgasemissionen</i>     | <p>PAI 1 - THG-Emissionen</p> <p>PAI 2 - CO<sub>2</sub>-Fußabdruck</p> <p>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird</p> <p>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind</p> <p>PAI 5 - Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen</p> <p>PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren</p>   |
| <i>Biodiversität</i>              | PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken  |
| <i>Wasser</i>                     | PAI 8 - Emissionen in Wasser  |
| <i>Abfall</i>                     | PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle  |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | <p>PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen</p> <p>PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen</p> <p>PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle</p> <p>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen</p> |

|  |   |
|--|---|
|  | PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |
|--|---|

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte ferner Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen und investierte nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

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

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, dass die ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen des Portfolios nicht erheblich beeinträchtigt wurden, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Emittenten, die quantitative und qualitative Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI festgelegt wurden, unterschreiten;
- Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Emittenten, wenn sie unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

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

Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*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 EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



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

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

1. Wie oben unter „Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?“ erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele führten, alle PAIs berücksichtigt.
2. Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die **„PAIs auf Produktebene“**):

| <b>PAIs auf Produktebene</b>  |   |
|-------------------------------|---|
| <b>Thema</b>                  | <b>Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen</b>  |
| <i>Treibhausgasemissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |

|                                   |   |
|-----------------------------------|---|
| <b>Soziales und Beschäftigung</b> | <p>PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen</p> <p>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen</p> <p>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)</p> |
|-----------------------------------|---|

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



### Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat den Bloomberg Industry Classification Standard („**BICS**“) verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2024 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2024 – 31. Dezember 2024

| Größte Investitionen                               | Sektor                         | In % der Vermögenswerte | Land             |
|--|--------------------------------|-------------------------|------------------|
| ELECTRICITE DE FRANCE SA /EUR/ REGD V/R /PERP/ REG | VERSORGUNG                     | 2,5                     | FRANKREICH       |
| TELEFONICA EUROPE BV /EUR/ REGD V/R /PERP/ REG S   | KOMMUNIKATION                  | 2,0                     | NIEDERLANDE      |
| LORCA TELECOM BONDCO /EUR/ REGD REG S              | KOMMUNIKATION                  | 1,4                     | SPANIEN          |
| TECHEM VERWALTUNGSGES /EUR/ REGD REG S             | NICHT-ZYKLISCHE<br>KONSUMGÜTER | 1,1                     | DEUTSCHLAND      |
| BIRKENSTOCK FINANC SARL /EUR/ REGD REG S           | ZYKLISCHE<br>KONSUMGÜTER       | 1,1                     | LUXEMBURG        |
| TK ELEVATOR MIDCO GMBH /EUR/ REGD REG S            | INDUSTRIE                      | 1,0                     | DEUTSCHLAND      |
| ZIGGO BOND CO BV /EUR/ REGD REG S                  | KOMMUNIKATION                  | 1,0                     | NIEDERLANDE      |
| CASTELLUM AB /EUR/ REGD V/R /PERP/ REG S SER       | FINANZWERTEN<br>ZYKLISCHE      | 0,9                     | SCHWEDEN         |
| EROSKI S COOP /EUR/ REGD REG S                     | KONSUMGÜTER                    | 0,9                     | SPANIEN          |
| ORSTED A /EUR/ REGD V/R REG S                      | VERSORGUNG                     | 0,8                     | DÄNEMARK         |
| UGI INTERNATIONAL LLC /EUR/ REGD REG S             | VERSORGUNG                     | 0,8                     | USA              |
| EPHIOS SUBCO SARL /EUR/ REGD REG S                 | NICHT-ZYKLISCHE<br>KONSUMGÜTER | 0,8                     | LUXEMBURG        |
| PEU FIN LTD /EUR/ REGD REG S                       | ZYKLISCHE<br>KONSUMGÜTER       | 0,8                     | GROSS-BRITANNIEN |

TEVA PHARM FNC NL II /EUR/ REGD

CLARIOS GLOBAL LP/US FIN /EUR/ REGD REG S

NICHT-ZYKLISCHE  
KONSUMGÜTER  
ZYKLISCHE  
KONSUMGÜTER

0,8 NIEDERLANDE

0,7 USA

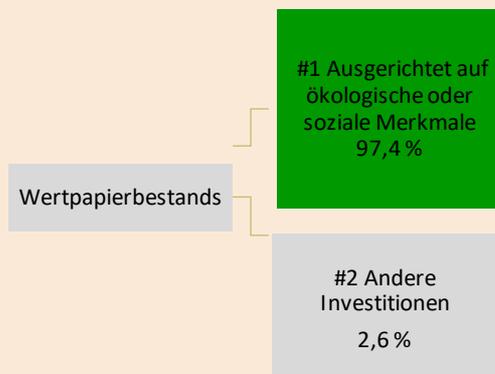


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Vermögensallokation des Portfolios im Bezugszeitraum wird in nachstehender Grafik dargestellt. Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen.



**#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.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige** Investitionen umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Der prozentuale Anteil der nachhaltigen Investitionen als Durchschnitt des dritten und vierten Quartals 2024 betrug 18,8 %. Darin enthalten sind 12,9 % an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, und 5,9 % an sozial nachhaltigen Investitionen. Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

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

| Wirtschaftssektoren - BICS                      | In % der Vermögenswerte |
|---|-------------------------|
| ZYKLISCHE KONSUMGÜTER                           | 25,0                    |
| NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER                     | 23,4                    |
| KOMMUNIKATION                                   | 18,1                    |
| INDUSTRIE                                       | 10,1                    |
| VERSORGUNG                                      | 7,1                     |
| FINANZWERTEN                                    | 6,7                     |
| GRUNDSTOFFE                                     | 6,6                     |
| DIVERSIFIZIERT                                  | 1,1                     |
| FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE (ABS-ANLEIHEN) | 1,0                     |
| ENERGIE   | 0,5                     |
| TECHNOLOGIE                                     | 0,4                     |



## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

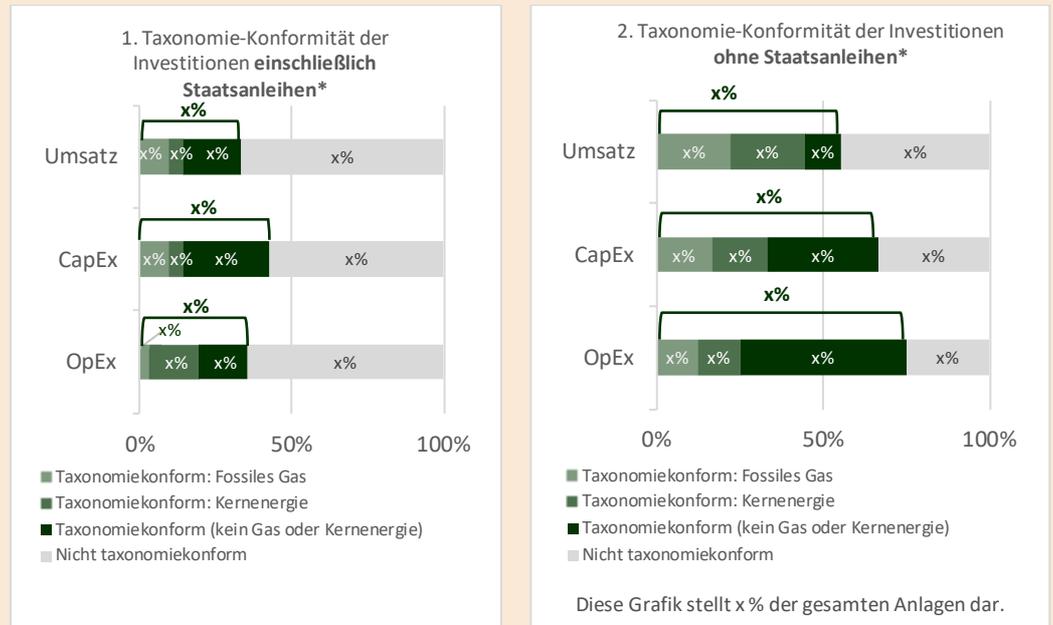
- Ja:  
 In fossiles Gas  In Kernenergie
- Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten 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 Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. 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.



\* 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?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



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 nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Dies ist in der Grafik zur Vermögensallokation unter der Frage „Wie sah die Vermögensallokation aus?“ oben angegeben.



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

Dies ist in der Grafik zur Vermögensallokation unter der Frage „Wie sah die Vermögensallokation aus?“ oben angegeben.



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

„Andere Investitionen“ umfasst die übrigen Investitionen des Portfolios, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren noch als nachhaltige Investitionen eingestuft wurden.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhindern und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Emittenteanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten sowie Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

### II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### III. ESG-Sektor-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

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?**  
k.A.
- **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?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k.A.

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman European Sustainable Equity Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300K7Y3HBTEX71857

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser 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?

**Ja**

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

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht 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 57.0 %\* 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**

\*Weitere Einzelheiten zur Vermögensallokation des Portfolios (einschließlich des Engagements in nachhaltige Investitionen) finden Sie unter der Frage „Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?“

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Sofem in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Klimarisiken, Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Abfallentsorgung, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Wasserbewirtschaftung, Management des Produktlebenszyklus, Materialbeschaffung und Chemikaliensicherheit.
- **Soziale Merkmale:** Betriebssicherheit und Krisenvorsorge, Zugang zu Finanzmitteln, Zugang zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen im Gemeinwesen, Datenschutz und -sicherheit, Gesundheit und Ernährung, Preistransparenz, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Vielfalt und Integration in der Belegschaft, Geschäftsethik, Produktsicherheit, -qualität und -integrität, Management systemischer Risiken, Management des Rechts- und Regulierungsumfelds und Lieferkettenmanagement.

Das Portfolio zielt auf Konformität mit einem Netto-Null-Ziel ab, wie im SFDR-Anhang und im Abschnitt „Nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten“ im Prospekt ausführlicher beschrieben.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten und Daten von Drittanbietern gemessen und wird im Folgenden in aggregierter Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

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

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigte der Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „NB-ESG-Quotient“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB China ESG Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („NB“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sekorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteten ESG-Daten erstellt. Ergänzend kamen interne qualitative Analysen hinzu, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Unternehmen wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss. Dementsprechend trat der Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes NB-ESG-Quotient- oder externes Rating aufweisen, um im Laufe der Zeit eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachen) zu erreichen.

| Bezugszeitraum    | Rating          | Bereich           | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|-----------------|-------------------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient   | ES: B<br>G: 3,1 | ES: A-D<br>G: 1-4 | 100 %                 |
| Daten von Dritten | 8,1             | 0-10              |                       |

Im Hinblick auf das NB-ESG-Quotient-Rating für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale („ES“) werden die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance („G“) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jedes im Portfolio gehaltene Unternehmen erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums erfasste Climate Value-at-Risk („CVaR“) das Ausmaß der Risiken und der Chancen des Klimaübergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmen.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

|  |        |
|--|--------|
| Der CVaR prognostizierte, dass ein Szenario der Klimaerwärmung beim verwalteten Vermögen im Bezugszeitraum zu folgendem Wertverlust führen könnte. | -4,1 % |
| CVaR-Abdeckung im Bezugszeitraum   | 97 %   |

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

### 3. ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy, die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy, Ausschlüsse gemäß dem Paris-abgestimmten EU-Referenzwert („EU-PAB“), wie im Rahmen der Neuberger Berman EU Climate Benchmark Standard Exclusions Policy vorgesehen, und die sonstigen spezifischen Ausschlüsse identifiziert wurden, die im SFDR-Anhang des Portfolios angegeben sind, oder nicht mit diesen vereinbar waren.

Zudem investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik auf das Portfolio verwendete der Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik verstoßen. Wo möglich versuchte der Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

#### Sonstiges

Im Bezugszeitraum brachte das Portfolio die Neuberger Berman Enhanced Sustainable Exclusion Policy nicht zur Anwendung.

Im Bezugszeitraum führte das Portfolio die EU-PAB-Ausschlüsse ein, wie im Rahmen der Neuberger Berman EU Climate Benchmark Standard Exclusions Policy vorgesehen. Die Neuberger Berman EU Climate Benchmark Standard Exclusions Policy wurde vom Manager erstellt zur Ausrichtung auf die Leitlinien der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde zu Fondsamen, die ESG- oder nachhaltigkeitsbezogene Begriffe verwenden.

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

Ausnahmsweise wurden für den Bezugszeitraum 2022 die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgte (sie umfassen die Veröffentlichung der SFDR-Vorlagen für vorvertragliche Informationen).

#### 1. NB-ESG-Quotient

|                            | <b>NB-ESG-Quotient-Rating</b> | <b>Rating der Daten durch externe Anbieter</b> | <b>Kombinierte Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| <b>Bereich</b>             | ES: A-D<br>G: 1-4             | 0-10   | 0-100 %                      |
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | ES: B<br>G: 2,5               | 7,9  | 100 %                        |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | ES: B<br>G: 3,0               | 7,9  | 99 %                         |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | ES: B<br>G: 3,1               | 8,1  | 100 %                        |

## 2. CVaR

|                            | CVaR   | Abdeckung |
|----------------------------|--------|-----------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | -6,2 % | 99 %      |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | -5,7 % | 99 %      |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | -4,1 % | 97 %      |

## 3. Ausschlüsse

|                            | Gesamtzahl der Verstöße |
|----------------------------|-------------------------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 0                       |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 0                       |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 0                       |

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

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckte sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Anlage zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Anlage eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat, wie nachstehend erläutert, und (iii) auf eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die gute Unternehmensführung eines Unternehmens, um festzustellen, ob das Unternehmen einer derartigen Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griff der Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die Wirtschaftstätigkeit eines Unternehmens auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren.

Der Manager überprüfte die Unternehmen auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Unternehmen dieser Prüfung standhielten, quantifizierte der Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag der Unternehmen zur Wirtschaft.

Der Manager erfasste dies auf drei Arten:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden);
- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDGs“) und
- Unternehmen aus Sektoren mit großen Auswirkungen, die sich auf der Grundlage des NB Net-Zero Alignment Indicator auf einen Netto-Null-Kurs umstellen.

Im Bezugszeitraum aktualisierte der Manager den SFDR-Anhang des Portfolios, um dem Umstand Rechnung zu tragen, dass der Manager bei der Ermittlung nachhaltiger Investitionen Unternehmen aus Sektoren mit großen Auswirkungen berücksichtigt, die sich auf der Grundlage des NB Net-Zero Alignment Indicator auf einen Netto-Null-Kurs umstellen.

Die Beurteilung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs wurde durch die Verfügbarkeit von angemessenen, verfügbaren und überprüfbaren Daten eingeschränkt. Um Fälle mit einer

unzureichenden Datenlage abzumildern, griff der Manager auf Daten von Drittanbietern und Proxydaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des Rahmens für nachhaltige Investitionen von NB zurück.

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

Der Manager wendete seinen Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigen. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachtete der Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und auf Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Manager berücksichtigte bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele waren, die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (die „**PAIs**“):

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.

| PAIs                              |   |
|-----------------------------------|---|
| Thema                             | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen   |
| <i>Treibhausgasemissionen</i>     | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind<br>PAI 5 - Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen<br>PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren  |
| <i>Biodiversität</i>              | PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken  |
| <i>Wasser</i>                     | PAI 8 - Emissionen in Wasser  |
| <i>Abfall</i>                     | PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle  |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen<br>PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen<br>PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle<br>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen<br>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Manager hat auch Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen berücksichtigt. Der Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

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

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Manager bei der Feststellung, dass die ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen des Portfolios nicht erheblich beeinträchtigt wurden, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Unternehmen, die unter die vom Manager für jede PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen;
- Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Unternehmen, wenn sie unter die vom Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

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

Der Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*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 EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

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

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



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

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Unternehmen durch den Manager) berücksichtigt.

Der Manager berücksichtigte PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

1. Wie oben unter „*Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?*“ erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele führten, alle PAIs berücksichtigt.
2. Der Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

| PAIs auf Produktebene             |  |
|-----------------------------------|--|
| Thema                             | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen  |
| <i>Treibhausgasemissionen</i>     | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind  |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen<br>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen<br>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;

- Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel, die vom Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager hat den Bloomberg Industry Classification Standard („BICS“) verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2024 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2024 – 31. Dezember 2024

| Größte Investitionen            | Sektor                      | In % der Vermögenswerte | Land            |
|---------------------------------|-----------------------------|-------------------------|-----------------|
| NOVO NORDISK A/S-B /DKK/        | NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 6,5                     | DÄNEMARK        |
| ASML HOLDING NV /EUR/           | TECHNOLOGIE                 | 6,4                     | NIEDERLANDE     |
| 3I GROUP PLC /GBP/              | FINANZWERTEN                | 5,7                     | GROSSBRITANNIEN |
| SCHNEIDER ELEC SA /EUR/         | INDUSTRIE                   | 5,4                     | FRANKREICH      |
| LONDON STOCK EXCHANGE GR /GBP/  | FINANZWERTEN                | 4,9                     | GROSSBRITANNIEN |
| NESTLE SA-REG /CHF/             | NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 4,7                     | SCHWEIZ         |
| EURONEXT NV /EUR/               | FINANZWERTEN                | 4,6                     | NIEDERLANDE     |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG /CHF/ | FINANZWERTEN                | 4,2                     | SCHWEIZ         |
| RELX PLC /EUR/                  | NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 3,8                     | GROSSBRITANNIEN |
| L'OREAL /EUR/                   | NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 3,8                     | FRANKREICH      |
| ASSA ABLOY AB-B /SEK/           | INDUSTRIE                   | 3,7                     | SCHWEDEN        |
| SCOUT24 SE /EUR/                | KOMMUNIKATION               | 3,0                     | DEUTSCHLAND     |
| BAKKA Frost P/F /NOK/           | NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 3,0                     | FAROE ISLANDS   |
| ESSILORLUXOTTICA /EUR/          | NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 2,9                     | FRANKREICH      |
| STRAUMANN HOLDING AG-REG /CHF/  | NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 2,8                     | SCHWEIZ         |

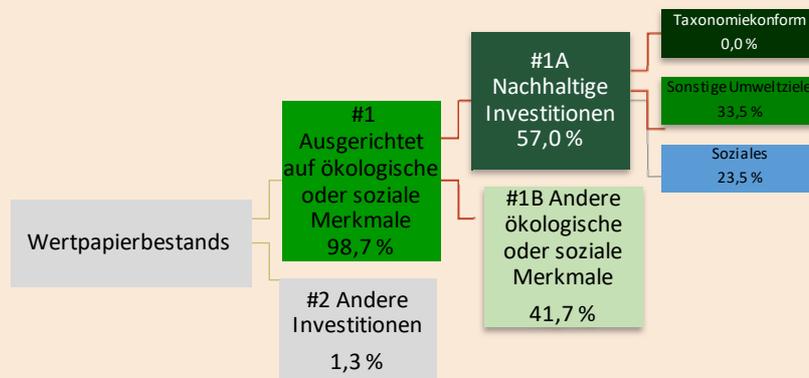


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Vermögensallokation des Portfolios im Bezugszeitraum wird in nachstehender Grafik dargestellt. Der Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder externen Anbietern beruhen.



**#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.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige** Investitionen umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

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

| Wirtschaftssektoren - BICS  | In % der Vermögenswerte |
|-----------------------------|-------------------------|
| NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 41,6                    |
| FINANZWERTEN                | 19,3                    |
| INDUSTRIE                   | 14,4                    |
| TECHNOLOGIE                 | 11,5                    |
| ZYKLISCHE KONSUMGÜTER       | 8,3                     |
| KOMMUNIKATION               | 4,7                     |
| ENERGIE                     | 0,2                     |



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Bei-trag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

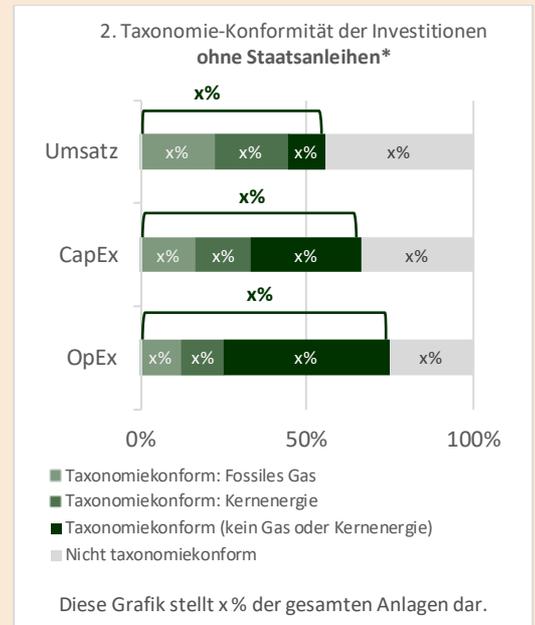
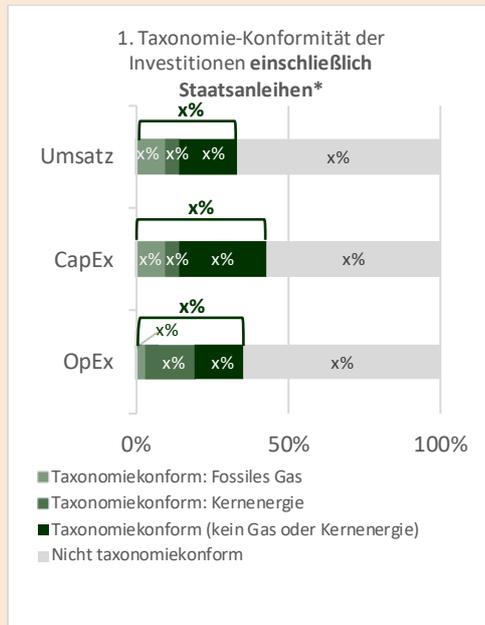
- Ja:  
 In fossiles Gas  In Kernenergie  
 Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten 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 Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität 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.



\* 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?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



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 nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Dies ist in der Grafik zur Vermögensallokation unter der Frage „Wie sah die Vermögensallokation aus?“ oben angegeben.



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

Dies ist in der Grafik zur Vermögensallokation unter der Frage „Wie sah die Vermögensallokation aus?“ oben angegeben.



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

„Andere Investitionen“ umfasst die übrigen Investitionen des Portfolios, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren noch als nachhaltige Investitionen eingestuft wurden.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder zur Gewährleistung einer adäquaten Liquidität, Absicherung und Besicherung.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Schutzstandards wie den UNGC-Grundsätzen, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten sowie Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das externe oder NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung besser zu erkennen.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die Gesamtbetrachtung der Unternehmen bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

### II. Mitwirkung:

Der Manager arbeitete mit den Unternehmen über ein solides ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung der Mitwirkung verfolgt.

### III. ESG-Sektor-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k.A.
- **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?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k.A.

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

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Global Bond Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300RDJHEJZZ6XVX05

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser 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?

**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**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Sofem in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, verantwortliche und transparente Risikoübernahme, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung, Wasserbewirtschaftung und Entsorgung gefährlicher Abfälle.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Geschäftsethik; Chemikaliensicherheit, Beziehungen im Gemeinwesen, umstrittene Beschaffung, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität, verantwortungsbewusste Werbung, Etikettierung und Marketing und Menschenrechte.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses haben der Manager und der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB China ESG Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („NB“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analyistenteam für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Manager und Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergriff, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Darüber hinaus bemühten sich der Manager und der Sub-Investment-Manager einem konstruktiven Dialog mit Emittenten mit einer schlechten Bewertung des NB-ESG-Quotienten Vorrang einzuräumen, um zu beurteilen, ob Bedenken angemessen berücksichtigt wurden.

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

| Bezugszeitraum    | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|--------|---------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient   | 67     | 1-100   | 67 %*                 |
| Daten von Dritten | 6,6    | 0-10    |                       |

\*Die kombinierte Abdeckung schließt das Engagement in verbrieften Schuldtiteln (z. B. CMBS, CMO und MBS) aus. Manche Engagements in verbrieften Schuldtiteln gelten als auf die mit dem Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet, wie in der Grafik zur Vermögensallokation ausgewiesen.

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums wurde mit Climate Value-at-Risk („**CVaR**“) das Ausmaß der Risiken und Chancen des Übergangs und der physischen Klimarisiken für Untermehensemittenten gemessen.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts einer Emission oder eines Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

|  |        |
|--|--------|
| Der CVaR prognostizierte, dass ein Szenario der Klimaerwärmung beim verwalteten Vermögen im Bezugszeitraum zu folgendem Wertverlust führen könnte. | -2,2 % |
| CVaR-Abdeckung im Bezugszeitraum.  | 15 %   |

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Managers und des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Manager und der Sub-Investment-Manager der Teilstrategie über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

### 3. ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy und die sonstigen spezifischen Ausschlüsse identifiziert wurden, die im SFDR-Anhang des Portfolios angegeben sind, oder nicht mit diesen vereinbar waren. Zudem investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („UNGC-Grundsätze“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („OECD-Leitsätze“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („UNGPs“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („ILO-Normen“) verstießen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik auf das Portfolio haben der Manager und der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik verstoßen. Wo möglich haben der Manager und der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise ihrer Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager erörterten und diskutierten die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund ihres eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

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

Ausnahmsweise wurden für den Bezugszeitraum 2022 die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgte (sie umfassen die Veröffentlichung der SFDR-Vorlagen für vorvertragliche Informationen).

### 1. NB-ESG-Quotient

|                            | <b>NB-ESG-<br/>Quotient-Rating</b> | <b>Rating der Daten<br/>durch externe<br/>Anbieter</b> | <b>Kombinierte Abdeckung</b> |
|----------------------------|------------------------------------|--|------------------------------|
| <b>Bereich</b>             | 1-100                              | 0-10   | 0-100 %                      |
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 68                                 | 6,5  | 77 %                         |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 66                                 | 6,6  | 67 %                         |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 67                                 | 6,6  | 67 %                         |

## 2. CvaR

|                            | <b>CVaR</b> | <b>Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------|------------------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | -1,7 %      | 24 %             |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | -1,6 %      | 19 %             |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | -2,2 %      | 15 %             |

## 3. Ausschlüsse

|                            | <b>Gesamtzahl der Verstöße</b> |
|----------------------------|--------------------------------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 0                              |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 0                              |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 0                              |

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten. Dessen ungeachtet waren der Manager und der Sub-Investment-Manager nicht in

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.

Emittenten investiert, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*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 EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

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

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



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

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager und den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigten in Bezug auf die Nachhaltigkeitsfaktoren die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 1 der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind, für Unternehmensemittenten (die „**PAIs für Unternehmensemittenten**“), und die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 2 der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind, für staatliche Emittenten (die „**staatliche PAIs**“) (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“):

| Teil 1 – PAIs für Unternehmensemittenten |   |
|--|---|
| Thema                                    | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen   |
| Treibhausgasemissionen                   | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |

|                                   |  |
|-----------------------------------|--|
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen<br>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen<br>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |
| <b>Teil 2 – staatliche PAIs</b>   |  |
| <i>Umwelt</i>                     | PAI 15 – THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird  |
| <i>Soziales</i>                   | PAI 16 - Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen  |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager und den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager und der Sub-Investment-Manager haben den Bloomberg Industry Classification Standard („BICS“) verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2024 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2024 – 31. Dezember 2024

| Größte Investitionen                              | Sektor    | In % der Vermögenswerte | Land        |
|---|-----------|-------------------------|-------------|
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND /EUR/ REGD REG S SER 10Y | STAATLICH | 2,0                     | DEUTSCHLAND |
| JAPAN (10 YEAR ISSUE) /JPY/ REGD SER 370          | STAATLICH | 1,3                     | JAPAN       |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO /EUR/ REGD               | STAATLICH | 1,1                     | SPANIEN     |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO /EUR/ REGD               | STAATLICH | 1,0                     | SPANIEN     |
| REPUBLIC OF ESTONIA /EUR/ REGD REG S EMTN         | STAATLICH | 1,0                     | ESTLAND     |
| BUNDES OBLIGATION /EUR/ REGD REG S SER 189        | STAATLICH | 1,0                     | DEUTSCHLAND |
| OBRIGACOES DO TESOURO /EUR/ REGD SER 11Y          | STAATLICH | 0,9                     | PORTUGAL    |

|   |  |     |                  |
|---|--|-----|------------------|
| UNITED KINGDOM GILT /GBP/ REGD REG S  | STAATLICH  | 0,9 | GROSS-BRITANNIEN |
| FREDDIE MAC STACR REMIC TRUST 2022-HQA1 SER 2022-H  | HYPOTHEKARISCH<br>BESICHERTE<br>WERTPAPIERE              | 0,9 | USA              |
| FRANCE (GOVT OF) /EUR/ REGD REG S SER OAT BUONI POLIENNALI DEL TES /EUR/ REGD REG S SER 10Y | STAATLICH  | 0,9 | FRANKREICH       |
| JAPAN (30 YEAR ISSUE) /JPY/ REGD SER 61   | STAATLICH  | 0,8 | ITALIEN          |
| KINGDOM OF SWEDEN REGD REG S EMTN   | STAATLICH  | 0,8 | JAPAN            |
| FANNIE MAE POOL UMBS P#MA4868   | STAATLICH<br>HYPOTHEKARISCH<br>BESICHERTE<br>WERTPAPIERE | 0,8 | SCHWEDEN         |
| JAPAN (20 YEAR ISSUE) /JPY/ REGD SER 178  | BESICHERTE<br>WERTPAPIERE                                | 0,7 | USA              |
|   | STAATLICH  | 0,7 | JAPAN            |

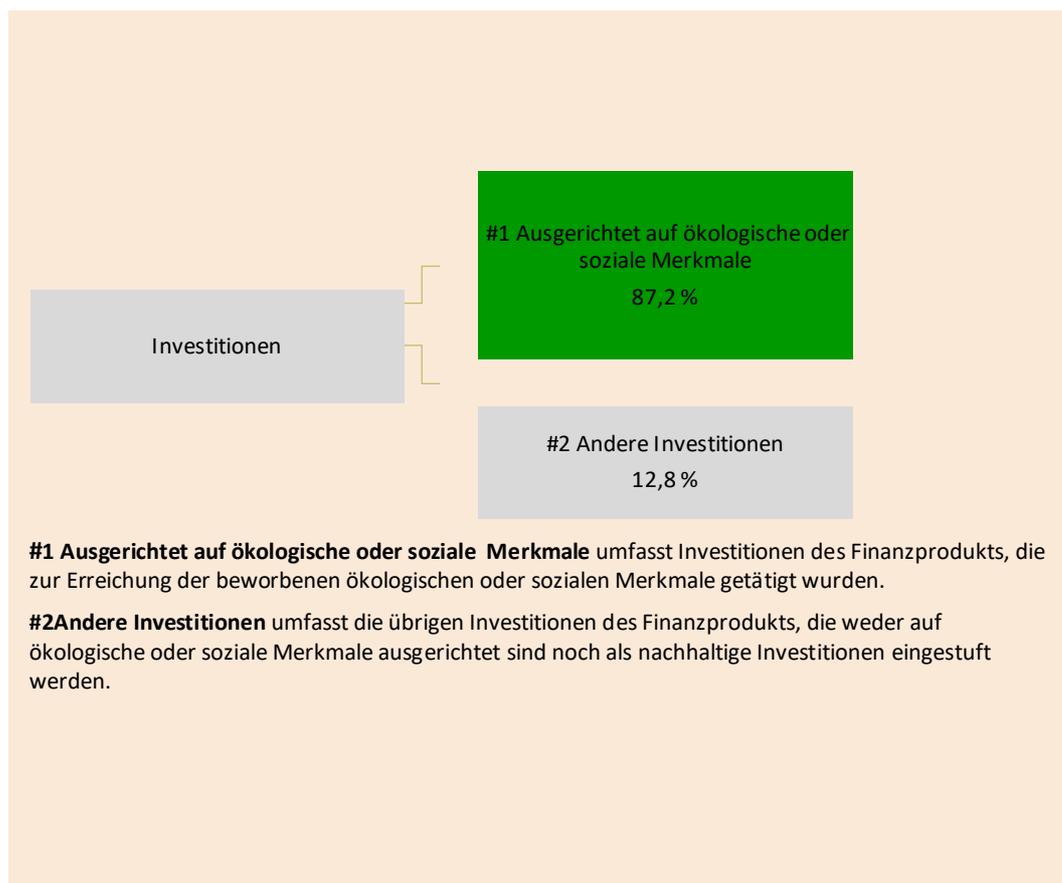


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### ● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Die Vermögensallokation des Portfolios im Bezugszeitraum wird in nachstehender Grafik dargestellt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager berechneten den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager und der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatten. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen.



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

| Wirtschaftssektoren - BICS                      | In % der Vermögenswerte |
|---|-------------------------|
| STAATLICH                                       | 38,0                    |
| HYPOTHEKARISCH BESICHERTE WERTPAPIERE           | 30,0                    |
| FINANZWERTEN                                    | 12,1                    |
| NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER                     | 4,3                     |
| ENERGIE   | 3,0                     |
| VERSORGUNG                                      | 2,8                     |
| TECHNOLOGIE                                     | 2,2                     |
| KOMMUNIKATION                                   | 2,1                     |
| ZYKLISCHE KONSUMGÜTER                           | 1,6                     |
| INDUSTRIE                                       | 1,5                     |
| FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE (ABS-ANLEIHEN) | 0,8                     |
| STAATSNAH                                       | 0,8                     |
| GRUNDSTOFFE                                     | 0,5                     |
| KOMMUNAL  | 0,3                     |



## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager können bestätigen, dass das Portfolio in Investitionen investiert hat, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Manager und der Sub-Investment-Manager werden das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

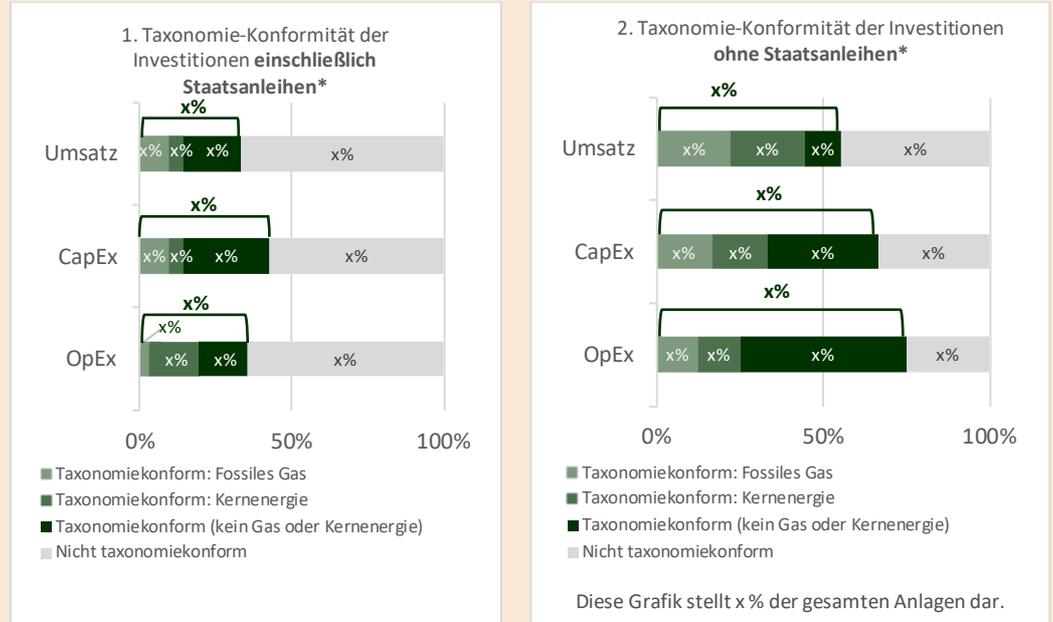
- Ja:
- In fossiles Gas  In Kernenergie
- Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten 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 Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. 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.



\* 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?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



### Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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

„Andere Investitionen“ umfasst die übrigen Investitionen des Portfolios, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren noch als nachhaltige Investitionen eingestuft wurden.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager und der Sub-Investment-Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachteten, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen, verhinderten und sie sicherstellen, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager wendeten bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager verstehen unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Managers und des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Managers und des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten sowie Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotienten herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Manager und vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in seine internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

### II. Mitwirkung:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager engagierten sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Er strebte danach, konstruktiven Dialogen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachtete. Der Manager und der Sub-Investment-Manager betrachteten diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil ihres Anlageprozesses. Die Fortschritte bei der Einbindung wurden vom Manager und dem Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### III. ESG-Sektor-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen

Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



### **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k.A.
- **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?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k.A.

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

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Global Equity Megatrends Fund (das „Portfolio“)  
**Unternehmenskennung:** 549300NOKC884YXB6S20

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser 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?

| ●● <input type="checkbox"/> Ja  | ●○ <input checked="" type="checkbox"/> Nein  |
|---|--|
| <p><input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel</b> getätigt: ___%</p> <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> </ul> <p><input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel</b> getätigt: ___%</p> | <p><input type="checkbox"/> Es wurden <b>damit ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen.</p> <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel</li> </ul> <p><input checked="" type="checkbox"/> Es wurden <b>damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt</b></p> |

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie hier.

Sofem in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Klimarisiken, THG-Emissionen, Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Wasserbewirtschaftung, Energiemanagement, Abfallentsorgung, Kraftstoffeffizienz, Gelegenheiten für saubere Technologien, Management des Produktlebenszyklus, Materialbeschaffung und Chemikaliensicherheit.
- **Soziale Merkmale:** Betriebssicherheit und Krisenvorsorge, Zugang zu Finanzmitteln, Zugang zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen im Gemeinwesen, Datenschutz und -sicherheit, Gesundheit und Ernährung, Preistransparenz, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Vielfalt und Integration in der Belegschaft, Geschäftsethik, Produktsicherheit, -qualität und -integrität, Management systemischer Risiken, Management des Rechts- und Regulierungsumfelds und Lieferkettenmanagement. .

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und werden im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

### ● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB China ESG Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**NB**“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Unternehmen wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss. Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes NB-ESG-Quotient- oder externes Rating aufweisen, um im Laufe der Zeit eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachten) zu erreichen.

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

| Bezugszeitraum    | Rating          | Bereich           | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|-----------------|-------------------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient   | ES: C<br>G: 2,5 | ES: A-D<br>G: 1-4 | 100 %                 |
| Daten von Dritten | 5,7             | 0-10              |                       |

Im Hinblick auf die NB-ESG-Quotient-Ratings der Aktienemittenten werden für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale (ES) die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance („G“) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jedes im Portfolio gehaltene Unternehmen erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Bewertung der Daten Dritter reichen von 0–10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums erfasste Climate Value-at-Risk („**CVaR**“) das Ausmaß der Risiken und der Chancen des Klimaübergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmen.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

|  |         |
|--|---------|
| Der CVaR prognostizierte, dass ein Szenario der Klimaerwärmung beim verwalteten Vermögen im Bezugszeitraum zu folgendem Wertverlust führen könnte. | -32,4 % |
| CVaR-Abdeckung im Bezugszeitraum.  | 89 %    |

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

### 3. ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy und die sonstigen spezifischen Ausschlüsse identifiziert wurden, die im SFDR-Anhang des Portfolios angegeben sind, oder nicht mit diesen vereinbar waren. Zudem investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

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

Ausnahmsweise wurden für den Bezugszeitraum 2022 die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgte (sie umfassen die Veröffentlichung der SFDR-Vorlagen für vorvertragliche Informationen).

##### 1. NB-ESG-Quotient

|                            | <b>NB-ESG-Quotient-Rating</b> | <b>Rating der Daten durch externe Anbieter</b> | <b>Kombinierte Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| <b>Bereich</b>             | ES: A-D<br>G: 1-4             | 0-10   | 0-100 %                      |
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | ES: C<br>G: 2,5               | 5,4  | 92 %                         |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | ES: C<br>G: 2,6               | 5,6  | 96 %                         |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | ES: C<br>G: 2,5               | 5,7  | 100 %                        |

##### 2. CVaR

|                            | <b>CVaR</b> | <b>Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------|------------------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | -27,9 %     | 94 %             |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | -34,2 %     | 92 %             |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | -32,4 %     | 89 %             |

### 3. Ausschlüsse

|                     | Gesamtzahl der Verstöße |
|---------------------|-------------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | 0                       |
| Bezugszeitraum 2023 | 0                       |
| Bezugszeitraum 2024 | 0                       |

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?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.

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

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

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

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten. Dessen ungeachtet war der Sub-Investment-Manager nicht in Unternehmen investiert, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die ILO-Grundsätze, die UNGC-Grundsätze, die UNGC-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*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 EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

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

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



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

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Unternehmen durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

| <b>PAIs auf Produktebene</b>      |  |
|-----------------------------------|--|
| <b>Thema</b>                      | <b>Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen</b>   |
| <i>Treibhausgasemissionen</i>     | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind  |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen<br>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen<br>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2024 – 31. Dezember 2024

Der Sub-Investment-Manager hat den Bloomberg Industry Classification Standard („**BICS**“) verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2024 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

| Größte Investitionen         | Sektor                      | In % der Vermögenswerte | Land            |
|------------------------------|-----------------------------|-------------------------|-----------------|
| CRITEO SA-SPON ADR           | KOMMUNIKATION               | 6,5                     | FRANKREICH      |
| ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR | KOMMUNIKATION               | 6,1                     | CHINA           |
| EXPEDIA GROUP INC            | KOMMUNIKATION               | 5,6                     | USA             |
| PERRIGO COMPANY PLC          | NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 5,6                     | IRLAND          |
| PETS AT HOME GROUP PLC /GBP/ | ZYKLISCHE KONSUMGÜTER       | 5,6                     | GROSSBRITANNIEN |
| AMDOCS LTD                   | TECHNOLOGIE                 | 5,4                     | USA             |
| DELTA AIR LINES INC          | ZYKLISCHE KONSUMGÜTER       | 5,1                     | USA             |
| DESPEGAR.COM CORP            | KOMMUNIKATION               | 4,7                     | ARGENTINIEN     |
| CORNING INC                  | KOMMUNIKATION               | 4,5                     | USA             |
| VISTRA CORP                  | VERSORGUNG                  | 4,5                     | USA             |
| NICE LTD - SPON ADR          | TECHNOLOGIE                 | 4,3                     | ISRAEL          |
| ZETA GLOBAL HOLDINGS CORP-A  | TECHNOLOGIE                 | 4,1                     | USA             |
| ALPHABET INC-CL A            | KOMMUNIKATION               | 4,0                     | USA             |
| GEN DIGITAL INC              | KOMMUNIKATION               | 4,0                     | USA             |
| UBER TECHNOLOGIES INC        | KOMMUNIKATION               | 4,0                     | USA             |



## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

### ● Wie sah die Vermögensallokation aus?

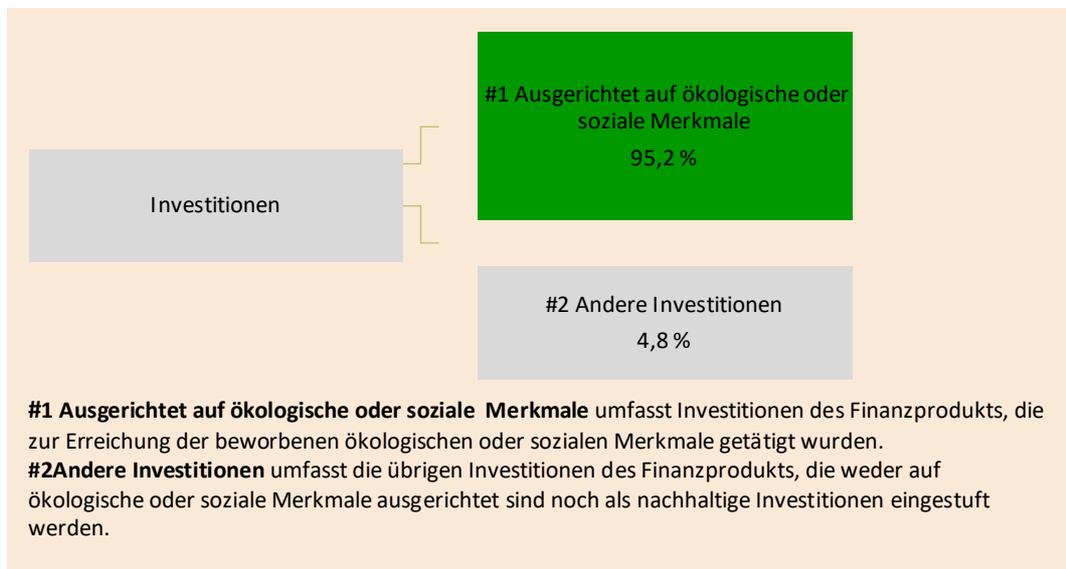
Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

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

**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Die Vermögensallokation des Portfolios im Bezugszeitraum wird in nachstehender Grafik dargestellt. Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder externen Anbietern beruhen.



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

| Wirtschaftssektoren - BICS  | In % der Vermögenswerte |
|-----------------------------|-------------------------|
| KOMMUNIKATION               | 44,2                    |
| TECHNOLOGIE                 | 13,9                    |
| NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 11,8                    |
| ZYKLISCHE KONSUMGÜTER       | 10,6                    |
| INDUSTRIE                   | 8,8                     |
| GRUNDSTOFFE                 | 6,2                     |
| VERSORGUNG                  | 4,5                     |



## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten 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 Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

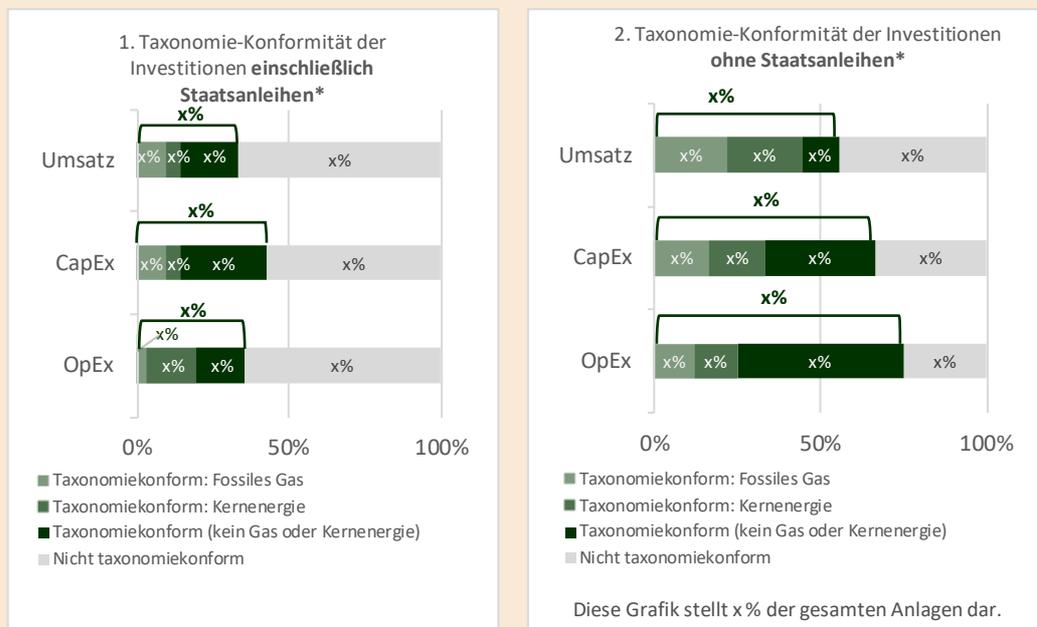
Nein



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

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. 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.



\* 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?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



**Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.



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

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.



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

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

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### **I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:**

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten sowie Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das externe oder NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung eines Unternehmens besser zu erkennen, wobei darauf hingewiesen wird, dass sich der Schwerpunkt des Portfolios

auf Investitionen in Unternehmen konzentrierte, die globalen langfristigen Themen ausgesetzt sind.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die thematische Beurteilung und die Gesamtbeurteilung des Unternehmens bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager arbeitete mit den Unternehmen mit einem soliden ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung der Mitwirkung verfolgt.

III. ESG-Sektor-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

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

k.A.

● **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?**

k.A.

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

k.A.

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

k.A.

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Global Flexible Credit Income Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 5493004BPE0UFYX6FZ81

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser 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?

**Ja**

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

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht 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**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Sofem in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, THG-Emissionen, Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, verantwortliche und transparente Risikoübernahme, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung, Wasserbewirtschaftung und Entsorgung gefährlicher Abfälle.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Geschäftsethik; Chemikaliensicherheit, Beziehungen im Gemeinwesen, umstrittene Beschaffung, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität, verantwortungsbewusste Werbung, Etikettierung und Marketing und Menschenrechte.

Das Portfolio zielt auf Konformität mit einem Netto-Null-Ziel ab, wie im SFDR-Anhang und im Abschnitt „Nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten“ im Prospekt ausführlicher beschrieben.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB China ESG Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („NB“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analyistenteam für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Emittenten ein, die einen schlechten NB-ESG-Quotienten aufweisen, um im Laufe der Zeit eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachen) zu erreichen.

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

| Bezugszeitraum    | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|--------|---------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient   | 58     | 1-100   | 94 %                  |
| Daten von Dritten | 5,5    | 0-10    |                       |

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums wurde mit Climate Value-at-Risk („**CVaR**“) das Ausmaß der Risiken und Chancen des Übergangs und der physischen Klimarisiken für Unterehmenten gemessen.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts einer Emission oder eines Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

|  |         |
|--|---------|
| Der CVaR prognostizierte, dass ein Szenario der Klimaerwärmung beim verwalteten Vermögen im Bezugszeitraum zu folgendem Wertverlust führen könnte. | -13,0 % |
| CVaR-Abdeckung im Bezugszeitraum.  | 33 %    |

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

## 3. ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement

Policy, Ausschlüsse gemäß dem EU-Referenzwert für klimabedingten Wandel (der „**EU-CTB**“), wie im Rahmen der Neuberger Berman EU Climate Benchmark Standard Exclusions Policy vorgesehen, und die sonstigen spezifischen Ausschlüsse identifiziert wurden, die im SFDR-Anhang des Portfolios angegeben sind, oder nicht mit diesen vereinbar waren. Zudem investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstößend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

Sonstiges

Im Bezugszeitraum führte das Portfolio die EU-CTB-Ausschlüsse ein, wie im Rahmen der Neuberger Berman EU Climate Benchmark Standard Exclusions Policy vorgesehen. Die Neuberger Berman EU Climate Benchmark Standard Exclusions Policy wurde vom Manager erstellt zur Ausrichtung auf die Leitlinien der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde zu Fondsnamen, die ESG- oder nachhaltigkeitsbezogene Begriffe verwenden.

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

Ausnahmsweise wurden für den Bezugszeitraum 2022 die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgte (sie umfassen die Veröffentlichung der SFDR-Vorlagen für vorvertragliche Informationen).

1. NB-ESG-Quotient

|                            | <b>NB-ESG-Quotient-Rating</b> | <b>Rating der Daten durch externe Anbieter</b> | <b>Kombinierte Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| <b>Bereich</b>             | 1-100                         | 0-10   | 0-100 %                      |
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 62                            | 5,1  | 93 %                         |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 63                            | 5,5  | 93 %                         |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 58                            | 5,5  | 94 %                         |

2. CVaR

|                            | <b>CVaR</b> | <b>Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------|------------------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | -12,9 %     | 48 %             |

|                            |         |      |
|----------------------------|---------|------|
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | -12,3 % | 42 % |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | -13,0 % | 33 % |

### 3. Ausschlüsse

|                            | <b>Gesamtzahl der Verstöße</b> |
|----------------------------|--------------------------------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 0                              |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 0                              |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 0                              |

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager nicht in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst 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.

*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 EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

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

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



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

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

| <b>PAIs auf Produktebene</b>      |  |
|-----------------------------------|--|
| <b>Thema</b>                      | <b>Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen</b>   |
| <i>Treibhausgasemissionen</i>     | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind  |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen<br>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen<br>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat den Bloomberg Industry Classification Standard („**BICS**“) verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2024 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2024 – 31. Dezember 2024

| Größte Investitionen                               | Sektor  | In % der Vermögenswerte | Land         |
|--|---|-------------------------|--------------|
| MCAFEE PIK PREFEQUITY                              | TECHNOLOGIE                                     | 1,5                     | USA          |
| VISTRA CORP REGD V/R /PERP/ 144A P/P               | VERSORGUNG                                      | 0,6                     | USA          |
| UKG INC REGD 144A P/P                              | TECHNOLOGIE                                     | 0,5                     | USA          |
| XPO INC REGD 144A P/P                              | INDUSTRIE                                       | 0,5                     | USA          |
| FORD MOTOR CREDIT CO LLC REGD                      | ZYKLISCHE KONSUMGÜTER                           | 0,5                     | USA          |
| CQP HOLDCO LP/BIP-V CHIN REGD P/P                  | ENERGIE   | 0,5                     | USA          |
| AGL CLO 19 LTD SER 2022-19X CL E V/R REGD REG S    | FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE (ABS-ANLEIHEN) | 0,5                     | JERSEY       |
| ELECTRICITE DE FRANCE SA /EUR/ REGD V/R /PERP/ REG | VERSORGUNG                                      | 0,5                     | FRANKREICH   |
| ASCENT RESOURCES/ARU FIN REGD 144A P/P             | ENERGIE   | 0,5                     | USA          |
| GOLDENTREE LOAN MANAGEMENT US CLO 9 LTD SER 2021-9 | FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE (ABS-ANLEIHEN) | 0,5                     | KAIMANINSELN |
| MEDLINE BORROWER LP REGD 144A P/P                  | NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER                     | 0,5                     | USA          |
| COMSTOCK RESOURCES INC REGD 144A P/P               | ENERGIE   | 0,5                     | USA          |
| WINDSOR HOLDINGS III LLC REGD 144A P/P             | ZYKLISCHE KONSUMGÜTER                           | 0,5                     | USA          |
| ALLIANT HOLD / CO-ISSUER REGD 144A P/P             | FINANZWERTEN                                    | 0,5                     | USA          |
| AIMCO CLO 16 LTD SER 2021-16X CL D1R V/R REGD REG  | FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE (ABS-ANLEIHEN) | 0,5                     | KAIMANINSELN |

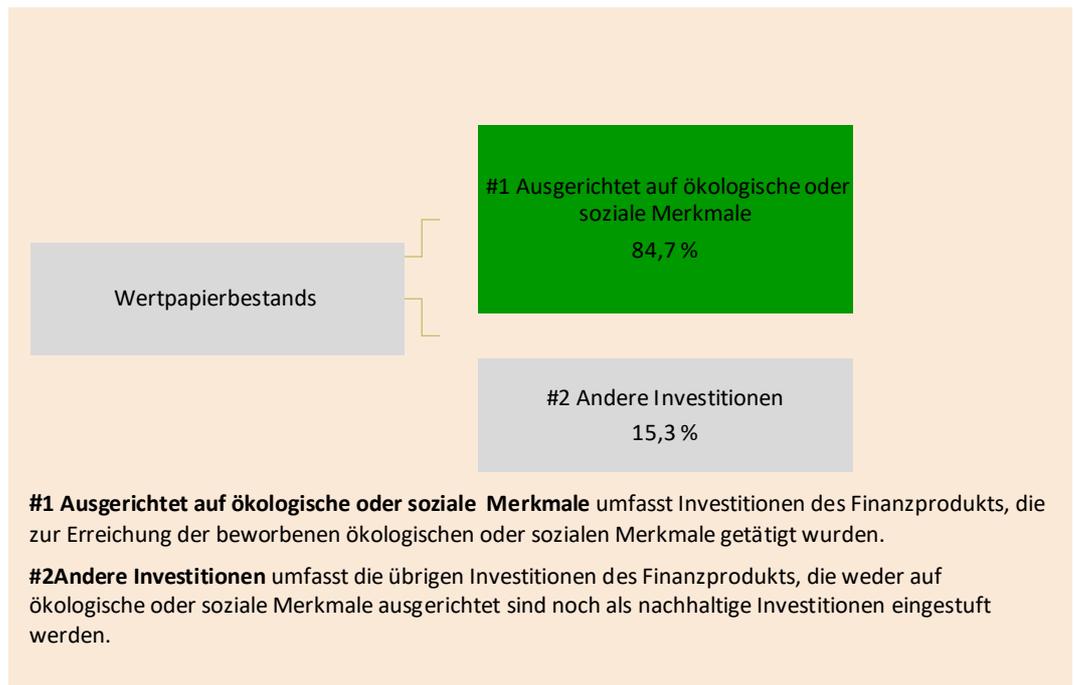


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Die Vermögensallokation des Portfolios im Bezugszeitraum wird in nachstehender Grafik dargestellt. Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen.



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

| Wirtschaftssektoren - BICS                      | In % der Vermögenswerte |
|---|-------------------------|
| FINANZWERTEN                                    | 14,8                    |
| ZYKLISCHE KONSUMGÜTER                           | 14,7                    |
| NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER                     | 11,1                    |
| ENERGIE   | 9,1                     |
| INDUSTRIE                                       | 9,0                     |
| FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE (ABS-ANLEIHEN) | 8,9                     |
| KOMMUNIKATION                                   | 7,7                     |
| TECHNOLOGIE                                     | 5,1                     |
| GRUNDSTOFFE                                     | 5,0                     |
| VERSORGUNG                                      | 4,5                     |
| HYPOTHEKARISCH BESICHERTE WERTPAPIERE           | 4,4                     |
| STAATLICH                                       | 2,8                     |
| KREDIT  | 2,3                     |
| DIVERSIFIZIERT                                  | 0,6                     |



## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

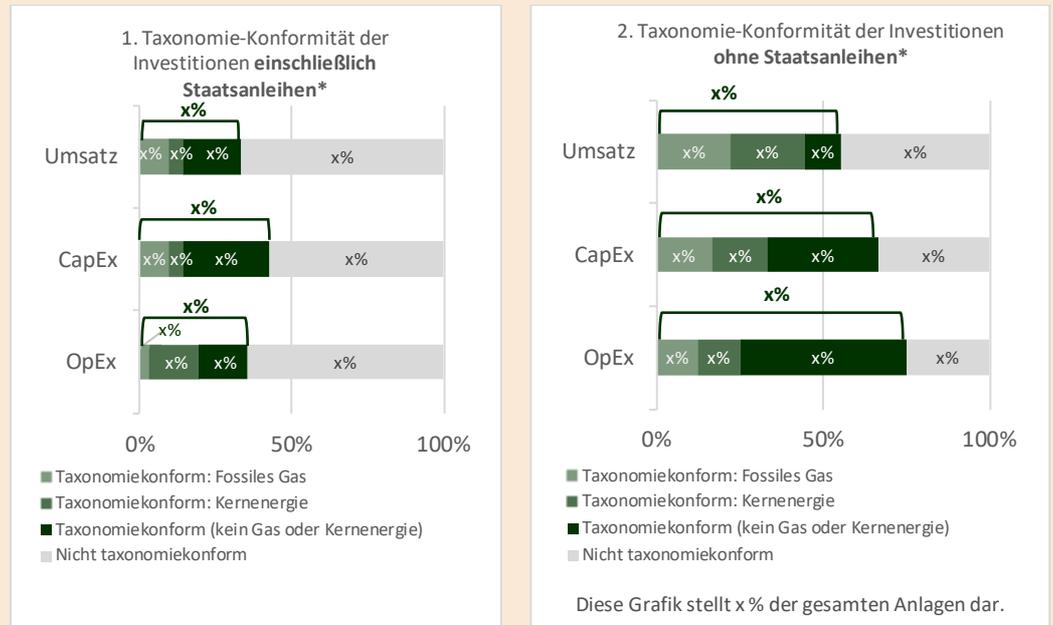
Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten 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 Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* 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?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



### **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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

„Andere Investitionen“ umfasst die übrigen Investitionen des Portfolios, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren noch als nachhaltige Investitionen eingestuft wurden.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Emittenteanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten sowie Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in seine internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

### II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Er strebte danach, konstruktiven Dialogen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### III. ESG-Sektor-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



### **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend – das Portfolio verwendet keinen Referenzwert.

- ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***  
k.A.
- ***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?***  
k.A.
- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***  
k.A.
- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***  
k.A.

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

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Global High Yield Engagement Fund\* (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300YE6BLJU5JCD113

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser 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?

**Ja**

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

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht 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 21,0 % 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**

\*Im Bezugszeitraum wurde der Neuberger Berman Global High Yield SDG Engagement Fund in Neuberger Berman Global High Yield Engagement Fund umbenannt.

\*\*Weitere Einzelheiten zur Vermögensallokation des Portfolios (einschließlich des Engagements bei nachhaltigen Investitionen) finden Sie nachfolgend unter der Frage „Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?“.

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Sofem in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen,

die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

Das Portfolio bewarb die UN-Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDGs“), indem es sich zum Ziel setzt, mit 100 % der Unternehmensemittenten direkt in Kontakt zu treten (innerhalb von 12 Monaten im Anschluss an den Kauf der von dem Unternehmensemittenten begebenen Wertpapiere). Der Sub-Investment-Manager hat Leistungskennzahlen („KPIs“) für Unternehmensemittenten festgelegt, die auf die SDGs ausgerichtet waren und sich auf die Produkte, Dienstleistungen, betriebliche Tätigkeiten oder Prozesse der Emittenten bezogen, mit dem Ziel, ein positives Ergebnis für die Umwelt und/oder die Gesellschaft zu erzielen. Der Sub-Investment-Manager legte in erster Linie in Emittenten von Unternehmen an, die in der Lage und bereit waren, sich mit ihm über spezifische, auf die SDGs ausgerichtete KPIs auszutauschen.

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung, Wasserbewirtschaftung und Entsorgung gefährlicher Abfälle.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Geschäftsethik; Chemikaliensicherheit, Beziehungen im Gemeinwesen, umstrittene Beschaffung, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität, verantwortungsbewusste Werbung, Etikettierung und Marketing und Menschenrechte.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

## Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB China ESG Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**NB**“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentrierte, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen. Jedes Sektorkriterium wurde unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analyistentams für das Portfolio genutzt wurde.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten

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

mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergriff, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Des Weiteren war der Sub-Investment-Manager bestrebt, einen konstruktiven Dialog mit 100 % der Unternhensemittenten Vorrang zu priorisieren.

| Bezugszeitraum    | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|--------|---------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient   | 58     | 1-100   | 100 %                 |
| Daten von Dritten | 5,8    | 0-10    |                       |

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 das niedrigste und 100 das höchste Rating darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Berichterstattung über die Zusammenarbeit:

Wie oben erwähnt, trug der Sub-Investment-Manager zur Erreichung der SDGs bei, indem er sich bemühte, mit 100 % der Unternhensemittenten in Kontakt zu treten (innerhalb von 12 Monaten im Anschluss an den Kauf der von dem Unternhensemittenten begebenen Wertpapiere).

Im Bezugszeitraum gab es Mitwirkung bei 97 % der Unternhensemittenten.

Der Sub-Investment-Manager hat nachfolgend eine Zusammenfassung seiner Bemühungen zur Einflussnahme während des Bezugszeitraums beigefügt.

|   |
|---|
| Der Sub-Investment-Manager trat während des Bezugszeitraums mit 338 im Portfolio gehaltenen Unternhemen in Kontakt.   |
| 46 % dieser Dialoge des Sub-Investment-Managers waren direkte Einzelgespräche (entweder per Fernzugriff oder als persönliches Gespräch).  |
| 57 % der Gespräche des Sub-Investment-Managers fanden mit Mitarbeitern und Mitarbeiterinnen der CEO-/CFO-Ebene statt.   |
| 15 der insgesamt 17 UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung (Sustainable Development Goals, „SDG“) wurden vom Sub-Investment-Manager während seiner Zusammenarbeit mit den Unternhemen abgedeckt. |
| Zum 31. Dezember 2024 haben die Unternhemen 23 % der Mitwirkungsziele entweder vollständig erreicht oder teilweise Maßnahmen zu ihrer Erreichung ergriffen.                                     |

Weitere Informationen über die Einflussnahme durch den Sub-Investment-Manager finden sich in der Bericht des Portfolios über die Zusammenarbeit [hier](#).

Weitere Einzelheiten finden Sie in der Neuberger Berman Stewardship and Engagement Policy [here](#).

3. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums wurde mit Climate Value-at-Risk („**CVaR**“) das Ausmaß der Risiken und Chancen des Übergangs und der physischen Klimarisiken für Untermehensemittenten gemessen.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts einer Emission oder eines Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

|  |         |
|--|---------|
| Der CVaR prognostizierte, dass ein Szenario der Klimaerwärmung beim verwalteten Vermögen im Bezugszeitraum zu folgendem Wertverlust führen könnte. | -13,8 % |
| CVaR-Abdeckung im Bezugszeitraum.  | 48 %    |

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

4. ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy, Ausschlüsse gemäß dem EU-Referenzwert für klimabedingten Wandel (der „**EU-CTB**“), wie im Rahmen der Neuberger Berman EU Climate Benchmark Standard Exclusions Policy vorgesehen, und die sonstigen spezifischen Ausschlüsse identifiziert wurden, die im SFDR-Anhang des Portfolios angegeben sind, oder nicht mit diesen vereinbar waren. Des Weiteren investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

### Sonstiges

Im Bezugszeitraum führte das Portfolio die EU-CTB-Ausschlüsse ein, wie im Rahmen der Neuberger Berman EU Climate Benchmark Standard Exclusions Policy vorgesehen. Die Neuberger Berman EU Climate Benchmark Standard Exclusions Policy wurde vom Sub-Investment-Manager erstellt zur Ausrichtung auf die Leitlinien der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde zu Fondsnamen, die ESG- oder nachhaltigkeitsbezogene Begriffe verwenden.

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

Ausnahmsweise wurden für den Bezugszeitraum 2022 die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgte (sie umfassen die Veröffentlichung der SFDR-Vorlagen für vorvertragliche Informationen).

#### 1. Der NB-ESG-Quotient

|                            | <b>NB-ESG-Quotient-Rating</b> | <b>Rating der Daten durch externe Anbieter</b> | <b>Kombinierte Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| <b>Bereich</b>             | <b>1-100</b>                  | <b>0-10</b>                                    | <b>0-100 %</b>               |
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 68                            | 5,6  | 100 %                        |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 58                            | 5,7  | 100 %                        |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 58                            | 5,8  | 100 %                        |

#### 2. Berichterstattung über die Zusammenarbeit

|                            | Unternehmen, mit denen zusammen-gearbeitet wurde | % der Dialoge waren direkte Einzelgespräche (entweder per Fernzugriff oder als persönliches Gespräch) | % der Dialoge erfolgten mit Mitarbeiter/innen auf CEO/CFO-Ebene | Anzahl der abgedeckten SDGs (von 17) | % der Unternehmen, mit denen zusammen-gearbeitet wurde, haben das Ziel dieser Mitwirkung entweder vollständig erreicht oder teilweise Maßnahmen zur Erreichung ihres Ziels ergriffen. |
|----------------------------|--|---|---|--------------------------------------|---|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 207  | 61 %  | 50 %  | 15                                   | 20 %  |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 296  | 55 %  | 51 %  | 15                                   | 26 %  |

|                            |     |      |      |    |      |
|----------------------------|-----|------|------|----|------|
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 338 | 46 % | 57 % | 15 | 23 % |
|----------------------------|-----|------|------|----|------|

### 3. CVaR

|                            | <b>CVaR</b> | <b>Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------|------------------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | -9,1 %      | 53 %             |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | -11,9 %     | 54 %             |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | -13,8 %     | 48 %             |

### 4. Ausschlüsse

|                            | <b>Gesamtzahl der Verstöße</b> |
|----------------------------|--------------------------------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 0                              |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 0                              |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 0                              |

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

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es während des Bezugszeitraums kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckte sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Anlage zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Anlage eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat (wie nachstehend erläutert) und (iii) auf eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die gute Unternehmensführung eines Emittenten, um festzustellen, ob der Emittent einer derartigen Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griff der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die Wirtschaftstätigkeit eines Emittenten auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren.

Der Sub-Investment-Manager überprüfte die Emittenten auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Emittenten diese Prüfung bestanden haben, hat der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag des Emittenten zur Wirtschaft gemessen.

Der Sub-Investment-Manager erfasste dies auf drei Arten:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden);
- Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs und
- Untermehensemittenten in Sektoren mit großen Auswirkungen, die sich auf der Grundlage des NB Net-Zero Alignment Indicator auf einen Netto-Null-Kurs umstellen.

Im Bezugszeitraum aktualisierte der Sub-Investment Manager den SFDR-Anhang des Portfolios, um dem Umstand Rechnung zu tragen, dass der Sub-Investment Manager bei der Ermittlung nachhaltiger Investitionen Emittenten aus Sektoren mit großen Auswirkungen berücksichtigt, die sich auf der Grundlage des NB Net-Zero Alignment Indicator auf einen Netto-Null-Kurs umstellen.

Die Beurteilung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs wurde durch die Verfügbarkeit von angemessenen, verfügbaren und überprüfbaren Daten eingeschränkt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griff der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Proxydaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

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

Der Sub-Investment-Manager wandte seinen Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigten. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachtete der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele waren, die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (die „PAIs“):

| PAIs                          |  |
|-------------------------------|--|
| Thema                         | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen  |
| <i>Treibhausgasemissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind<br>PAI 5 - Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen<br>PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren |
| <i>Biodiversität</i>          | PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken   |
| <i>Wasser</i>                 | PAI 8 - Emissionen in Wasser   |
| <i>Abfall</i>                 | PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle   |

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.

|                                   |  |
|-----------------------------------|--|
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | <p>PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen</p> <p>PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen</p> <p>PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle</p> <p>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen</p> <p>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)</p> |
|-----------------------------------|--|

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte ferner Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen und investierte nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

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

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, dass die ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen des Portfolios nicht erheblich beeinträchtigt wurden, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Emittenten, die quantitative und qualitative Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI festgelegt wurden, unterschreiten;
- Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Emittenten, wenn sie unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

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

Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*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 EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



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

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

1. Wie oben unter „*Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?*“ erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele führten, alle PAIs berücksichtigt.
2. Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

| <b>PAIs auf Produktebene</b>  |   |
|-------------------------------|---|
| <b>Thema</b>                  | <b>Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen</b>  |
| <i>Treibhausgasemissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |

|                            |   |
|----------------------------|---|
| Soziales und Beschäftigung | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen |
|                            | PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen  |
|                            | PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die o. g. PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat den Bloomberg Industry Classification Standard („BICS“) verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2024 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2024 – 31. Dezember 2024

| Größte Investitionen                                 | Sektor                      | In % der Vermögenswerte | Land        |
|--|-----------------------------|-------------------------|-------------|
| MEDLINE BORROWER LP REGD 144A P/P                    | NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 0,8                     | USA         |
| TELEFONICA EUROPE BV /EUR/ REGD V/R /PERP/ REG S     | KOMMUNIKATION               | 0,8                     | NIEDERLANDE |
| ELECTRICITE DE FRANCE SA /EUR/ REGD V/R /PERP/ REG S | VERSORGUNG                  | 0,7                     | FRANKREICH  |
| CCO HLDGS LLC/CAP CORP REGD 144A P/P                 | KOMMUNIKATION               | 0,5                     | USA         |
| ATHENAHEALTH GROUP INC REGD 144A P/P                 | TECHNOLOGIE                 | 0,5                     | USA         |
| LORCA TELECOM BOND CO /EUR/ REGD REG S               | KOMMUNIKATION               | 0,5                     | SPANIEN     |
| BOOST NEWCO BORROWER LLC REGD 144A P/P               | NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 0,4                     | USA         |
| VISTRA OPERATIONS CO LLC REGD 144A P/P               | VERSORGUNG                  | 0,4                     | USA         |
| ALLIANT HOLD / CO-ISSUER REGD 144A P/P               | FINANZWERTEN                | 0,4                     | USA         |
| XPO INC REGD 144A P/P                                | INDUSTRIE                   | 0,4                     | USA         |
| TELECOM ITALIA SPA /EUR/ REGD REG S                  | KOMMUNIKATION               | 0,4                     | ITALIEN     |
| ILIAD HOLDING SAS /EUR/ REGD REG S                   | KOMMUNIKATION               | 0,4                     | FRANKREICH  |
| UKG INC REGD 144A P/P                                | TECHNOLOGIE                 | 0,4                     | USA         |
| VIRGIN MEDIA VENDOR FIN /GBP/ REGD                   | KOMMUNIKATION               | 0,4                     | IRLAND      |
| VM CONSOLIDATED INC REGD 144A P/P                    | NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 0,4                     | USA         |

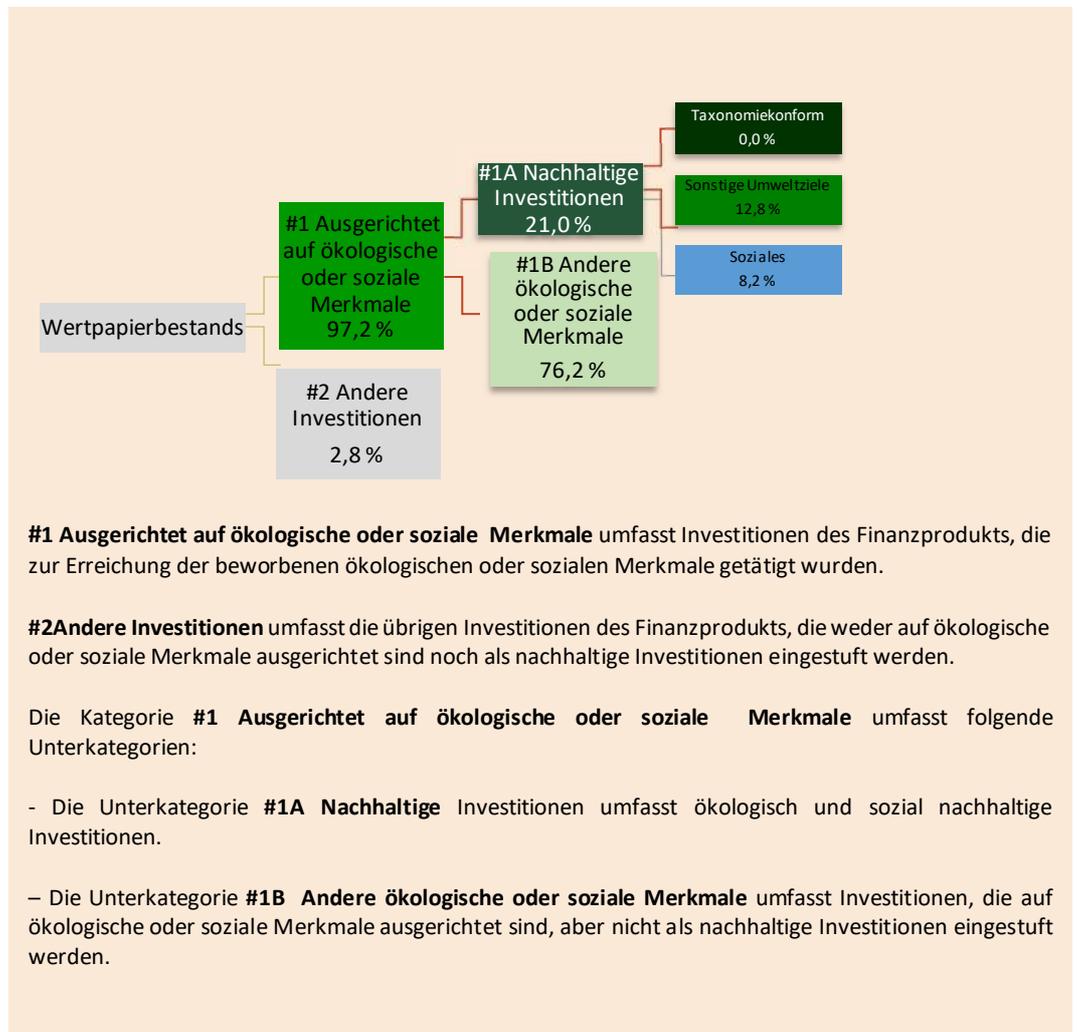


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### ● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Die Vermögensallokation des Portfolios im Bezugszeitraum wird in nachstehender Grafik dargestellt. Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen.



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

| <b>Wirtschaftssektoren - BICS</b> | <b>In % der Vermögenswerte</b> |
|-----------------------------------|--------------------------------|
| NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER       | 17,1                           |
| ZYKLISCHE KONSUMGÜTER             | 17,0                           |
| KOMMUNIKATION                     | 13,9                           |
| INDUSTRIE                         | 13,0                           |
| FINANZWERTEN                      | 10,9                           |
| ENERGIE                           | 10,1                           |
| GRUNDSTOFFE                       | 9,8                            |
| VERSORGUNG                        | 4,3                            |
| TECHNOLOGIE                       | 3,3                            |
| KREDIT                            | 0,3                            |
| DIVERSIFIZIERT                    | 0,3                            |



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

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

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

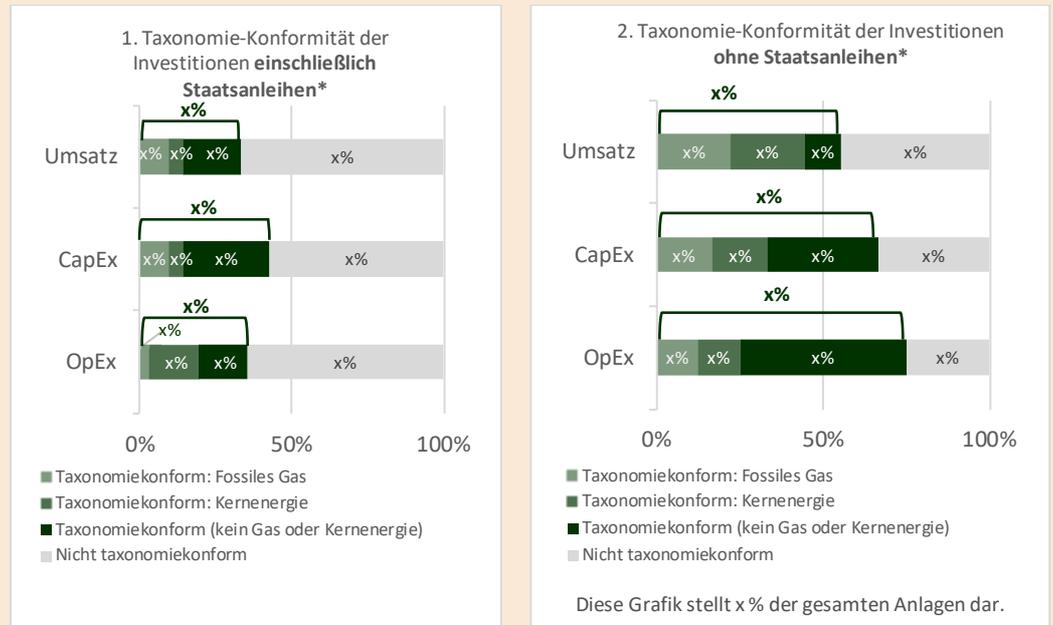
Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten 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 Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität 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.



\* 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?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



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 nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Dies ist in der Grafik zur Vermögensallokation unter der Frage „Wie sah die Vermögensallokation aus?“ oben angegeben.



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

Dies ist in der Grafik zur Vermögensallokation unter der Frage „Wie sah die Vermögensallokation aus?“ oben angegeben.



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

„Andere Investitionen“ umfasst die übrigen Investitionen des Portfolios, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren noch als nachhaltige Investitionen eingestuft wurden.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager war der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Emittenteanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten sowie Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

### II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses.

Dieses Programm konzentrierte sich auf persönliche Treffen und Telefonkonferenzen, um die ESG-Risiken und -Chancen zu verstehen und die gute Unternehmensführung der Emittenten zu bewerten. Im Rahmen der direkten Zusammenarbeit hat der Sub-Investment-Manager Ziele festgelegt, welche Ziele die Emittenten erreichen sollten. Diese Ziele sowie die Fortschritte der Emittenten im Hinblick auf diese Ziele wurden vom Sub-Investment-Manager mit Hilfe eines internen Systems von NB zur Nachverfolgung der Mitwirkung erfasst und überwacht (weitere Einzelheiten sind dem obigen Abschnitt über die Mitwirkung zu entnehmen).

Das Portfolio bewarb ökologische und soziale Merkmale. Zugleich leistete es einen Beitrag zur Erreichung der SDGs, indem darauf abgezielt wurde, direkt mit allen Unternehmensemittenten (innerhalb von zwölf Monaten nach Kauf der durch den Unternehmensemittenten begebenen Wertpapiere) zusammenzuarbeiten. Die Mitwirkung erfolgte in erster Linie über persönliche Treffen und Gespräche sowie durch Festlegung von wesentlichen Leistungsindikatoren (KPIs), die auf die SDGs ausgerichtet sind und auf die Produkte, Dienstleistungen, den Geschäftsbetrieb oder die Prozesse der Emittenten Bezug nahmen. Damit sollte ein positives Ergebnis bezogen auf die Umwelt und/oder Gesellschaft erzielt werden. Der Sub-Investment-Manager legte in erster Linie in Emittenten von Unternehmen an, die in der Lage und bereit waren, sich mit ihm über spezifische, auf die SDGs ausgerichtete KPIs auszutauschen. Der Sub-Investment-Manager beurteilte vierteljährlich die Fortschritte der im Portfolio vertretenen Emittenten gegenüber den festgelegten KPIs. Diese direkte Mitwirkung bei Unternehmensemittenten war wesentlicher Bestandteil des Anlageprozesses und ausschlaggebend für den Portfoliobeitrag zur Erreichung der SDGs.

Der Sub-Investment-Manager nutzte ein hausinternes Instrument, um im Vorfeld einer Anlage die Wahrscheinlichkeit auf Erfolg bei der Mitwirkung gegenüber einem Emittenten festzustellen (der „**Mitwirkungspotenzial-Indikator**“). Der Mitwirkungspotenzial-Indikator bietet auf einer Skala von 1–5 eine Bewertung der Bereitschaft und Fähigkeit eines Emittenten, mit dem Sub-Investment-Manager zu den SDGs zusammenzuarbeiten. Ein Emittent, der beispielsweise als nicht bereit oder fähig zur Zusammenarbeit eingestuft wurde, erhielt einen Mitwirkungspotenzial-Indikator von „1“, während ein Emittent, der zur Zusammenarbeit bereit war, um ein Vorreiter bei der Unterstützung der SDGs zu werden, mit einem Mitwirkungspotenzial-Indikator von „5“ bewertet wurde. Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Emittenten mit einem Mitwirkungspotenzial-Indikator von weniger als „2“. Mit dem Mitwirkungspotenzial-Indikator wurden neben den finanziellen Beschränkungen für den Emittenten verschiedene Faktoren berücksichtigt, darunter die Bedeutung der SDGs im Geschäftsbetrieb des Emittenten, die Offenlegungspraktiken des Emittenten und die Beziehung des Sub-Investment-Managers zum Emittenten.

### III. ESG-Sektor-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.

## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

### ● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

k.A.

### ● **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?**

k.A.

### ● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

k.A.



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 im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k.A.

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Global Investment Grade Credit Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300TIVE0UW3FSBE51

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser 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?

**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**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Sofem in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, verantwortliche und transparente Risikoübernahme, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung, Wasserbewirtschaftung und Entsorgung gefährlicher Abfälle.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Geschäftsethik; Chemikaliensicherheit, Beziehungen im Gemeinwesen, umstrittene Beschaffung, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität, verantwortungsbewusste Werbung, Etikettierung und Marketing und Menschenrechte.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB China ESG Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („NB“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sekorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analyistenteam für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Emittenten ein, die einen schlechten NB-ESG-Quotienten aufweisen, um im Laufe der Zeit eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachen) zu erreichen.

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

| Bezugszeitraum    | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|--------|---------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient   | 62     | 1-100   | 100 %                 |
| Daten von Dritten | 6,7    | 0-10    |                       |

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums wurde mit Climate Value-at-Risk („**CVaR**“) das Ausmaß der Risiken und Chancen des Übergangs und der physischen Klimarisiken für Unterehnehmensemittenten gemessen.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts einer Emission oder eines Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

|  |        |
|--|--------|
| Der CVaR prognostizierte, dass ein Szenario der Klimaerwärmung beim verwalteten Vermögen im Bezugszeitraum zu folgendem Wertverlust führen könnte. | -1,4 % |
| CVaR-Abdeckung im Bezugszeitraum.  | 62 %   |

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy und die sonstigen spezifischen Ausschlüsse identifiziert wurden, die im SFDR-Anhang des Portfolios angegeben sind, oder nicht mit diesen vereinbar waren. Zudem investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als

gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („UNGC-Grundsätze“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

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

Ausnahmsweise wurden für den Bezugszeitraum 2022 die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgte (sie umfassen die Veröffentlichung der SFDR-Vorlagen für vorvertragliche Informationen).

1. NB-ESG-Quotient

|                            | <b>NB-ESG-Quotient-Rating</b> | <b>Rating der Daten durch externe Anbieter</b> | <b>Kombinierte Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| <b>Bereich</b>             | 1-100                         | 0-10   | 0-100 %                      |
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 62                            | 6,7  | 100 %                        |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 61                            | 6,8  | 100 %                        |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 62                            | 6,7  | 100 %                        |

2. CVaR

|                            | <b>CVaR</b> | <b>Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------|------------------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | -3,4 %      | 71 %             |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | -3,3 %      | 68 %             |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | -1,4 %      | 62 %             |

3. Ausschlüsse

|                            | <b>Gesamtzahl der Verstöße</b> |
|----------------------------|--------------------------------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 0                              |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 0                              |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 0                              |

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager nicht in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*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 EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

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

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

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 bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

| PAIs auf Produktebene             |  |
|-----------------------------------|--|
| Thema                             | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen  |
| <i>Treibhausgasemissionen</i>     | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind  |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen<br>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen<br>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat den Bloomberg Industry Classification Standard („BICS“) verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2024 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2024 – 31. Dezember 2024

| Größte Investitionen                           | Sektor                      | In % der Vermögenswerte | Land            |
|--|-----------------------------|-------------------------|-----------------|
| UNITED AIR 2020-1 A PTT REGD SER 20-1          | ZYKLISCHE KONSUMGÜTER       | 1,0                     | USA             |
| SOUTHERN CO /EUR/ REGD V/R                     | VERSORGUNG                  | 0,9                     | USA             |
| AA BOND CO LTD /GBP/ REGD REG S EMTN           | NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 0,8                     | JERSEY          |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC REGD V/R               | FINANZWERTEN                | 0,8                     | USA             |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV WOR REGD                  | NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 0,7                     | USA             |
| HEIMSTADEN BOSTAD TRESRY /EUR/ REGD REG S EMTN | FINANZWERTEN                | 0,7                     | NIEDERLANDE     |
| AMGEN INC REGD                                 | NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 0,6                     | USA             |
| NATIONWIDE BLDG SOCIETY REGD V/R REG S         | FINANZWERTEN                | 0,6                     | GROSSBRITANNIEN |
| WARNERMEDIA HOLDINGS INC /EUR/ REGD            | ZYKLISCHE KONSUMGÜTER       | 0,6                     | USA             |
| GRAND CITY PROP FINANCE /EUR/ REGD V/R /PERP/  | FINANZWERTEN                | 0,6                     | LUXEMBURG       |
| FISERV INC REGD                                | TECHNOLOGIE                 | 0,6                     | USA             |
| NATWEST GROUP PLC REGD V/R                     | FINANZWERTEN                | 0,6                     | GROSSBRITANNIEN |
| DOMINION ENERGY INC REGD                       | VERSORGUNG                  | 0,6                     | USA             |
| TRATON FINANCE LUX SA /GBP/ REGD REG S EMTN    | ZYKLISCHE KONSUMGÜTER       | 0,6                     | LUXEMBURG       |
| OSB GROUP PLC /GBP/ REGD V/R REG S EMTN        | FINANZWERTEN                | 0,6                     | GROSSBRITANNIEN |

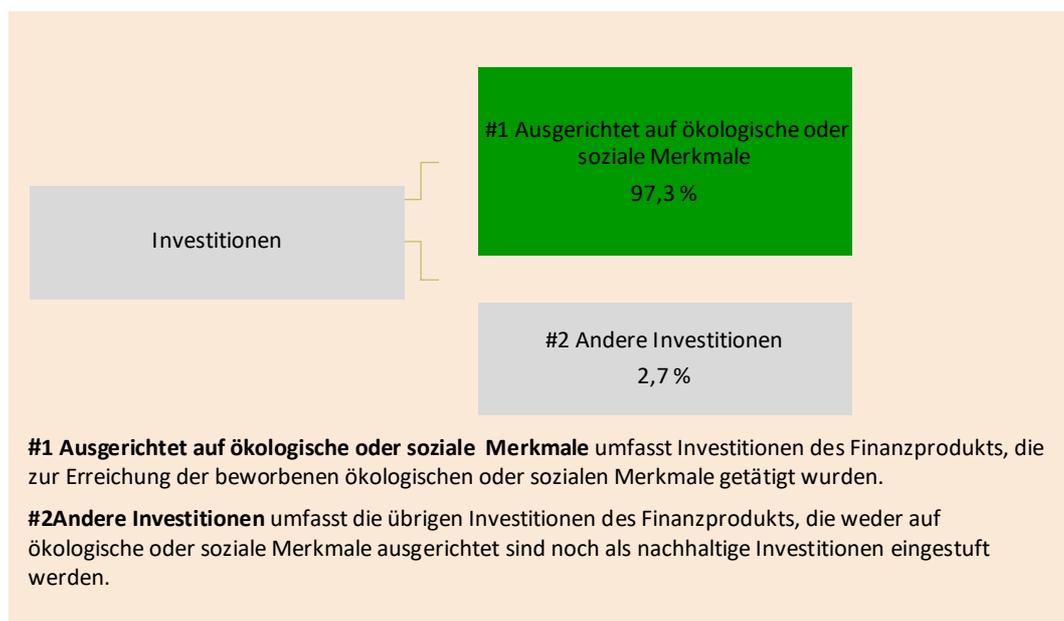


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Vermögensallokation des Portfolios im Bezugszeitraum wird in nachstehender Grafik dargestellt. Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen.



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

| Wirtschaftssektoren - BICS  | In % der Vermögenswerte |
|-----------------------------|-------------------------|
| FINANZWERTEN                | 40,8                    |
| VERSORGUNG                  | 13,8                    |
| NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 12,7                    |
| KOMMUNIKATION               | 9,7                     |
| ZYKLISCHE KONSUMGÜTER       | 7,7                     |
| TECHNOLOGIE                 | 5,4                     |
| INDUSTRIE                   | 4,5                     |
| ENERGIE                     | 4,1                     |
| GRUNDSTOFFE                 | 0,9                     |
| STAATLICH                   | 0,4                     |



**Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?**

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

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

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

Nein

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Bei-trag zu den Umweltzielen leisten.

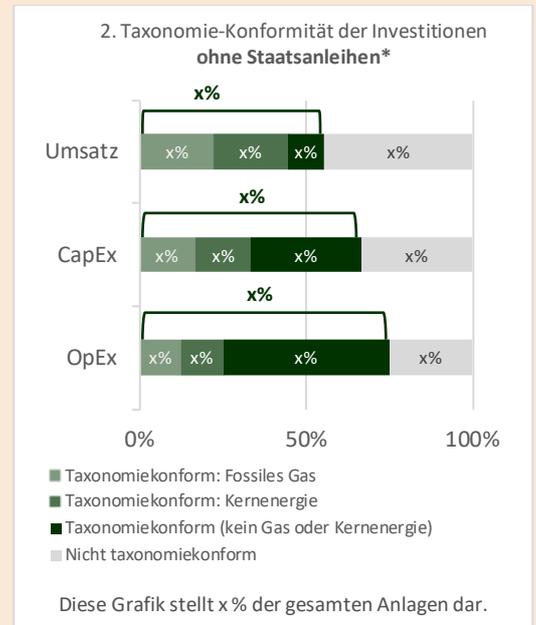
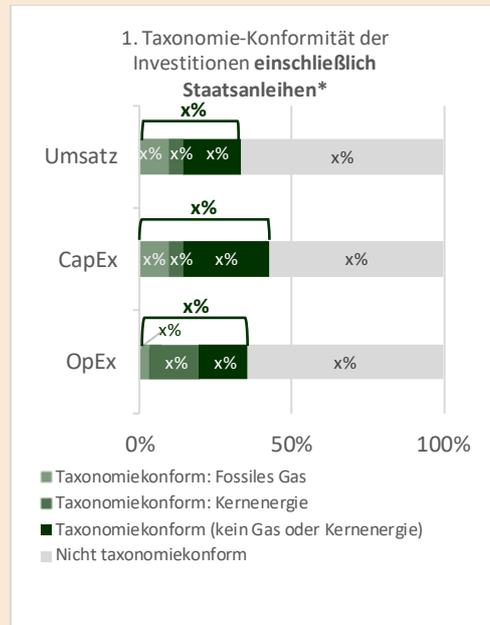
- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten 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 Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* 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?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



### Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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

„Andere Investitionen“ umfasst die übrigen Investitionen des Portfolios, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren noch als nachhaltige Investitionen eingestuft wurden.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Emittenteanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten sowie Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in seine internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

### II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### III. ESG-Sektor-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



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

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k.A.
- **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?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k.A.

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

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300ZNNZZYDVTNRE14

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser 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?

**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**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Sofem in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, verantwortliche und transparente Risikoübernahme, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung, Wasserbewirtschaftung und Entsorgung gefährlicher Abfälle.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Geschäftsethik; Chemikaliensicherheit, Beziehungen im Gemeinwesen, umstrittene Beschaffung, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität, verantwortungsbewusste Werbung, Etikettierung und Marketing und Menschenrechte.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

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

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses haben der Manager und der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB China ESG Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („NB“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analyistenteam für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Manager und Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergriff, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Darüber hinaus bemühten sich der Manager und der Sub-Investment-Manager einem konstruktiven Dialog mit Emittenten mit einer schlechten Bewertung des NB-ESG-Quotienten Vorrang einzuräumen, um zu beurteilen, ob Bedenken angemessen berücksichtigt wurden.

| Bezugszeitraum    | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|--------|---------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient   | 61     | 1-100   | 77 %*                 |
| Daten von Dritten | 5,9    | 0-10    |                       |

\*Die kombinierte Abdeckung schließt das Engagement in verbrieften Schuldtiteln (z. B. CMBS, CMO und MBS) aus. Manche Engagements in verbrieften Schuldtiteln gelten als auf die mit dem Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet, wie in der Grafik zur Vermögensallokation ausgewiesen.

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums wurde mit Climate Value-at-Risk („**CVaR**“) das Ausmaß der Risiken und Chancen des Übergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmensemittenten gemessen.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts einer Emission oder eines Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

|  |        |
|--|--------|
| Der CVaR prognostizierte, dass ein Szenario der Klimaerwärmung beim verwalteten Vermögen im Bezugszeitraum zu folgendem Wertverlust führen könnte. | -4,4 % |
| CVaR-Abdeckung im Bezugszeitraum.  | 19 %   |

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Managers und des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Manager und der Sub-Investment-Manager der Teilstrategie über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

### 3. ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy und die sonstigen spezifischen Ausschlüsse identifiziert wurden, die im SFDR-Anhang des Portfolios angegeben sind, oder nicht mit diesen vereinbar waren. Zudem investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit dieser vereinbar waren), wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („UNGC-Grundsätze“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik auf das Portfolio haben der Manager und der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik verstoßen. Wo möglich haben der Manager und der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise ihrer Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager erörterten und diskutierten die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund ihres eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

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

Ausnahmsweise wurden für den Bezugszeitraum 2022 die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgte (sie umfassen die Veröffentlichung der SFDR-Vorlagen für vorvertragliche Informationen).

#### 1. NB-ESG-Quotient

|                            | <b>NB-ESG-Quotient-Rating</b> | <b>Rating der Daten durch externe Anbieter</b> | <b>Kombinierte Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| <b>Bereich</b>             | 1-100                         | 0-10   | 0-100 %                      |
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 61                            | 5,7  | 80 %                         |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 62                            | 6,2  | 73 %                         |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 61                            | 5,9  | 77 %                         |

## 2. CVaR

|                            | CVaR   | Abdeckung |
|----------------------------|--------|-----------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | -4,2 % | 24 %      |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | -4,5 % | 23 %      |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | -4,4 % | 19 %      |

## 3. Ausschlüsse

|                            | Gesamtzahl der Verstöße |
|----------------------------|-------------------------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 0                       |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 0                       |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 0                       |

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten. Dessen ungeachtet waren der Manager und der Sub-Investment-Manager nicht in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst 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.

*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 EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

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

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



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

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager und den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigten in Bezug auf die Nachhaltigkeitsfaktoren die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 1 der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind, für Unternehmensemittenten (die „**PAIs für Unternehmensemittenten**“), und die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 2 der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind, für staatliche Emittenten (die „**staatliche PAIs**“) (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“):

| <b>Teil 1 – PAIs für Unternehmensemittenten</b> |  |
|---|--|
| <b>Thema</b>                                    | <b>Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen</b>   |
| <i>Treibhausgasemissionen</i>                   | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind  |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i>               | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen<br>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen<br>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

| Teil 2 – staatliche PAIs |   |
|--------------------------|---|
| Umwelt                   | PAI 15 – THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird               |
| Soziales                 | PAI 16 - Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager und den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;

Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und

- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager und der Sub-Investment-Manager haben den Bloomberg Industry Classification Standard („BICS“) verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2024 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2024 – 31. Dezember 2024

| Größte Investitionen                             | Sektor     | In % der Vermögenswerte | Land                  |
|--|------------|-------------------------|-----------------------|
| MEX BONOS DESARR FIX RT /MXN/ REGD SER M         | STAATLICH  | 2,5                     | MEXIKO                |
| NEW ZEALAND GOVERNMENT /NZD/ REGD REG S SER 0433 | STAATLICH  | 1,4                     | NEUSEELAND            |
| CHINA GOVERNMENT BOND /CNY/ REGD SER INBK        | STAATLICH  | 1,4                     | CHINA                 |
| INDONESIA GOVERNMENT /IDR/ REGD SER FR96         | STAATLICH  | 1,3                     | INDONESIEN            |
| CZECH REPUBLIC /CZK/ REGD SER 151                | STAATLICH  | 1,3                     | TSCHECHISCHE REPUBLIK |
| MEX BONOS DESARR FIX RT /MXN/ REGD SER M         | STAATLICH  | 1,2                     | MEXIKO                |
| NGG FINANCE PLC /GBP/ REGD V/R REG S SER GBP     | VERSORGUNG | 1,1                     | GROSSBRITANN IEN      |
| BUNDESobligation /EUR/ REGD REG S SER 189        | STAATLICH  | 1,0                     | DEUTSCHLAND           |
| CHINA GOVERNMENT BOND /CNY/ REGD SER INBK        | STAATLICH  | 0,9                     | CHINA                 |
| JAPAN (10 YEAR ISSUE) /JPY/ REGD SER 374         | STAATLICH  | 0,9                     | JAPAN                 |

|  |   |     |            |
|--|---|-----|------------|
| MEXBONOS DESARR FIX RT /MXN/ REGD SER M            | STAATLICH   | 0,9 | MEXIKO     |
| INDONESIA GOVERNMENT /IDR/ REGD SER 100            | STAATLICH   | 0,8 | INDONESIEN |
| ELECTRICITE DE FRANCE SA /EUR/ REGD V/R /PERP/ REG | VERSORGUNG<br>HYPOTHEKARISCH<br>BESICHERTE<br>WERTPAPIERE | 0,8 | FRANKREICH |
| FREDDIE MAC POOL UMBS P#SD8325                     | WERTPAPIERE   | 0,8 | USA        |
| HUNGARY GOVERNMENT BOND /HUF/ REGD SER 35/A        | STAATLICH   | 0,7 | UNGARN     |



## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### ● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Die Vermögensallokation des Portfolios im Bezugszeitraum wird in nachstehender Grafik dargestellt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager berechneten den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager und der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatten. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen.



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

**#2Andere 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?***

| <b>Wirtschaftssektoren - BICS</b>               | <b>In % der Vermögenswerte</b> |
|---|--------------------------------|
| STAATLICH                                       | 34,7                           |
| HYPOTHEKARISCH BESICHERTE WERTPAPIERE           | 21,7                           |
| FINANZWERTEN                                    | 9,6                            |
| NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER                     | 8,0                            |
| ZYKLISCHE KONSUMGÜTER                           | 7,8                            |
| KOMMUNIKATION                                   | 6,1                            |
| VERSORGUNG                                      | 5,1                            |
| INDUSTRIE                                       | 2,5                            |
| GRUNDSTOFFE                                     | 2,0                            |
| ENERGIE   | 1,6                            |
| TECHNOLOGIE                                     | 0,5                            |
| DIVERSIFIZIERT                                  | 0,3                            |
| FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE (ABS-ANLEIHEN) | 0,1                            |



## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager können bestätigen, dass das Portfolio in Investitionen investiert hat, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Manager und der Sub-Investment-Manager werden das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

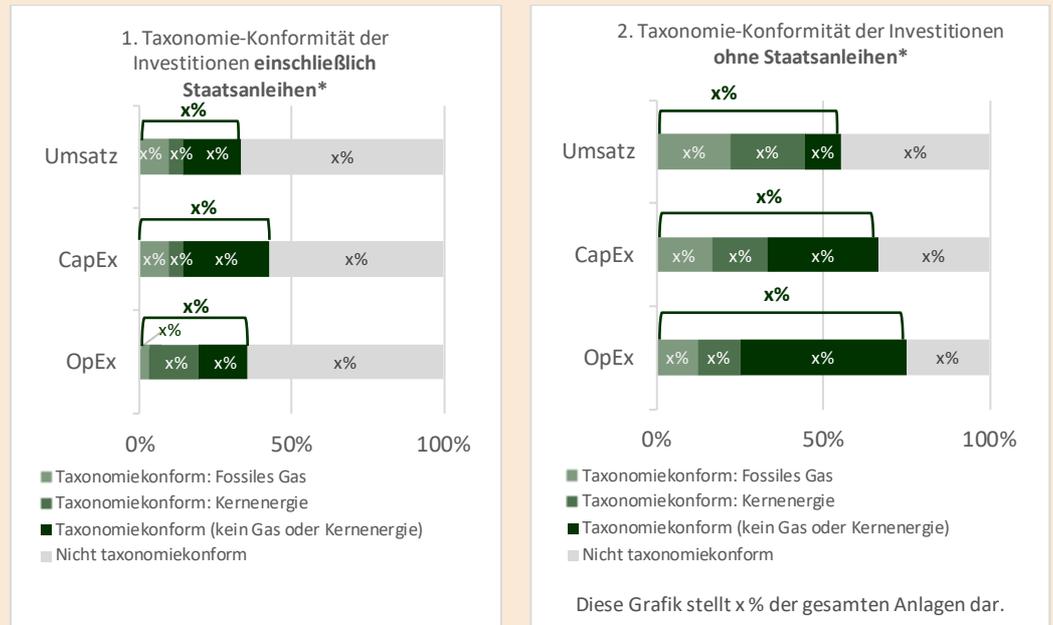
- Ja:
- In fossiles Gas  In Kernenergie
- Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten 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 Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* 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?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



### Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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

„Andere Investitionen“ umfasst die übrigen Investitionen des Portfolios, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren noch als nachhaltige Investitionen eingestuft wurden.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager und der Sub-Investment-Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachteten, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen, verhinderten und sie sicherstellen, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager wendeten bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager verstehen unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Managers und des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Managers und des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten sowie Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotienten herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Manager und vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in seine internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

### II. Mitwirkung:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager engagierten sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager betrachteten diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil ihres Anlageprozesses. Die Fortschritte bei der Einbindung wurden vom Manager und dem Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### III. ESG-Sektor-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



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

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k.A.
- **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?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k.A.

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

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Global Sustainable Equity Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300XRT8BVEN8P0A74

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser 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?

**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 61.9 %\* 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**

\*Weitere Einzelheiten zur Vermögensallokation des Portfolios (einschließlich des Engagements in nachhaltigen Investitionen) finden Sie nachfolgend unter der Frage „*Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?*“.

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Sofem in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Klimarisiken, THG-Emissionen, Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Wasserbewirtschaftung, Energiemanagement, Abfallentsorgung, Kraftstoffeffizienz, Gelegenheiten für saubere Technologien, Management des Produktlebenszyklus, Materialbeschaffung und Chemikaliensicherheit.
- **Soziale Merkmale:** Betriebssicherheit und Krisenvorsorge, Zugang zu Finanzmitteln, Zugang zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen im Gemeinwesen, Datenschutz und -sicherheit, Gesundheit und Ernährung, Preistransparenz, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Vielfalt und Integration in der Belegschaft, Geschäftsethik, Produktsicherheit, -qualität und -integrität, Management systemischer Risiken, Management des Rechts- und Regulierungsumfelds und Lieferkettenmanagement.

Das Portfolio zielt auf Konformität mit einem Netto-Null-Ziel ab, wie im SFDR-Anhang und im Abschnitt „Nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten“ im Prospekt ausführlicher beschrieben.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten und Daten von Drittanbietern gemessen und wird im Folgenden in aggregierter Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

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

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigte der Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB China ESG Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**NB**“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteten ESG-Daten erstellt. Ergänzend kamen interne qualitative Analysen hinzu, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Unternehmen wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss. Dementsprechend trat der Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes NB-ESG-Quotient- oder externes Rating aufweisen, um im Laufe der Zeit eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachten) zu erreichen.

| Bezugszeitraum    | Rating          | Bereich           | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|-----------------|-------------------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient   | ES: B<br>G: 2,4 | ES: A-D<br>G: 1-4 |                       |
| Daten von Dritten | 7,1             | 0-10              | 100 %                 |

Im Hinblick auf das NB-ESG-Quotient-Rating für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale („ES“) werden die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance („G“) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jedes im Portfolio gehaltene Unternehmen erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums erfasste Climate Value-at-Risk („**CVaR**“) das Ausmaß der Risiken und der Chancen des Klimaübergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmen.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

|  |        |
|--|--------|
| Der CVaR prognostizierte, dass ein Szenario der Klimaerwärmung beim verwalteten Vermögen im Bezugszeitraum zu folgendem Wertverlust führen könnte. | -3,7 % |
| CVaR-Abdeckung im Bezugszeitraum.  | 97 %   |

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

### 3. ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy, die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy, Ausschlüsse gemäß dem Paris-abgestimmten EU-Referenzwert (der „EU-PAB“), wie im Rahmen der Neuberger Berman EU Climate Benchmark Standard Exclusions Policy vorgesehen, und die sonstigen spezifischen Ausschlüsse identifiziert wurden, die im SFDR-Anhang des Portfolios angegeben sind, oder nicht mit diesen vereinbar waren.

Zudem investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik auf das Portfolio verwendete der Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik verstoßen. Wo möglich versuchte der Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

#### Sonstiges

Im Bezugszeitraum brachte das Portfolio die Neuberger Berman Enhanced Sustainable Exclusion Policy nicht zur Anwendung.

Im Bezugszeitraum führte das Portfolio die **EU-PAB**-Ausschlüsse ein, wie im Rahmen der Neuberger Berman EU Climate Benchmark Standard Exclusions Policy vorgesehen. Die Neuberger Berman EU Climate Benchmark Standard Exclusions Policy wurde vom Manager erstellt zur Ausrichtung auf die Leitlinien der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde zu Fondsnamen, die ESG- oder nachhaltigkeitsbezogene Begriffe verwenden.

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

Ausnahmsweise wurden für den Bezugszeitraum 2022 die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgte (sie umfassen die Veröffentlichung der SFDR-Vorlagen für vorvertragliche Informationen).

#### 1. NB-ESG-Quotient

|                            | <b>NB-ESG-Quotient-Rating</b> | <b>Rating der Daten durch externe Anbieter</b> | <b>Kombinierte Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| <b>Bereich</b>             | ES: A-D<br>G: 1-4             | 0-10   | 0-100 %                      |
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | ES: B<br>G: 2,2               | 7,2  | 100 %                        |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | ES: B<br>G: 2,4               | 7,4  | 99 %                         |

|                            |                 |     |       |
|----------------------------|-----------------|-----|-------|
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | ES: B<br>G: 2,4 | 7,1 | 100 % |
|----------------------------|-----------------|-----|-------|

## 2. CVaR

|                            | <b>CVaR</b> | <b>Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------|------------------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | -5,0 %      | 99 %             |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | -5,0 %      | 99 %             |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | -3,7 %      | 97 %             |

## 3. Ausschlüsse

|                            | <b>Gesamtzahl der Verstöße</b> |
|----------------------------|--------------------------------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 0                              |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 0                              |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 0                              |

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

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckte sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Anlage zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Anlage eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat, wie nachstehend erläutert, und (iii) auf eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die gute Unternehmensführung eines Unternehmens, um festzustellen, ob das Unternehmen einer derartigen Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griff der Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die Wirtschaftstätigkeit eines Unternehmens auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren.

Der Manager überprüfte die Unternehmen auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Unternehmen dieser Prüfung standhielten, quantifizierte der Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag der Unternehmen zur Wirtschaft.

Der Manager erfasste dies auf drei Arten:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden);
- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDGs“) und

- Unternehmen in Sektoren mit großen Auswirkungen, die sich auf der Grundlage des NB Net-Zero Alignment Indicator auf einen Netto-Null-Kurs umstellen.

Im Bezugszeitraum aktualisierte der Manager den SFDR-Anhang des Portfolios, um dem Umstand Rechnung zu tragen, dass der Manager bei der Ermittlung nachhaltiger Investitionen Unternehmen aus Sektoren mit großen Auswirkungen berücksichtigt, die sich auf der Grundlage des NB Net-Zero Alignment Indicator auf einen Netto-Null-Kurs umstellen.

Die Beurteilung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs wurde durch die Verfügbarkeit von angemessenen, verfügbaren und überprüfbaren Daten eingeschränkt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griff der Manager auf Daten von Drittanbietern und Proxydaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des Rahmens für nachhaltige Investitionen von NB zurück.

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

Der Manager wendete seinen Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigen. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachtete der Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und auf Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Manager berücksichtigte bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele waren, die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (die „PAIs“):

| PAIs                          |  |
|-------------------------------|--|
| Thema                         | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen  |
| <i>Treibhausgasemissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind<br>PAI 5 - Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen<br>PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren |
| <i>Biodiversität</i>          | PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken   |
| <i>Wasser</i>                 | PAI 8 - Emissionen in Wasser   |
| <i>Abfall</i>                 | PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle   |

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.

|                                   |  |
|-----------------------------------|--|
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | <p>PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen</p> <p>PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen</p> <p>PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle</p> <p>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen</p> <p>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)</p> |
|-----------------------------------|--|

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Manager hat auch Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen berücksichtigt. Der Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

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

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Manager bei der Feststellung, dass die ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen des Portfolios nicht erheblich beeinträchtigt wurden, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Unternehmen, die unter die vom Manager für jede PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen;
- Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Unternehmen, wenn sie unter die vom Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

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

Der Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*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 EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



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

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Unternehmen durch den Manager) berücksichtigt.

Der Manager berücksichtigte PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

1. Wie oben unter „*Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?*“ erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele führten, alle PAIs berücksichtigt.
2. Der Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

| PAIs auf Produktebene  |   |
|------------------------|---|
| Thema                  | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen   |
| Treibhausgasemissionen | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |

|                                   |   |
|-----------------------------------|---|
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen |
|                                   | PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen  |
|                                   | PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel, die vom Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager hat den Bloomberg Industry Classification Standard („BICS“) verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2024 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2024 – 31. Dezember 2024

| Größte Investitionen         | Sektor                         | In % der Vermö-<br>genswerte | Land            |
|------------------------------|--------------------------------|------------------------------|-----------------|
| MICROSOFT CORP               | TECHNOLOGIE                    | 8,9                          | USA             |
| ALPHABET INC-CL A            | KOMMUNIKATION                  | 6,0                          | USA             |
| AMAZON.COM INC               | KOMMUNIKATION                  | 5,8                          | USA             |
| NVIDIA CORP                  | TECHNOLOGIE                    | 3,8                          | USA             |
| NETFLIX INC                  | KOMMUNIKATION                  | 3,6                          | USA             |
| ASML HOLDING NV /EUR/        | TECHNOLOGIE                    | 3,2                          | NIEDERLANDE     |
| 3I GROUP PLC /GBP/           | FINANZWERTEN                   | 2,9                          | GROSSBRITANNIEN |
| NASDAQ INC                   | FINANZWERTEN                   | 2,6                          | USA             |
| NESTLE SA-REG /CHF/          | NICHT-ZYKLISCHE<br>KONSUMGÜTER | 2,5                          | SCHWEIZ         |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | NICHT-ZYKLISCHE<br>KONSUMGÜTER | 2,5                          | USA             |
| UNITEDHEALTH GROUP INC       | NICHT-ZYKLISCHE<br>KONSUMGÜTER | 2,5                          | USA             |
| BAKKA Frost P/F /NOK/        | NICHT-ZYKLISCHE<br>KONSUMGÜTER | 2,4                          | FARÖER INSELN   |
| BROWN & BROWN INC            | FINANZWERTEN                   | 2,3                          | USA             |
| BROADCOM INC                 | TECHNOLOGIE                    | 2,3                          | USA             |
| SCHNEIDER ELEC SA /EUR/      | INDUSTRIE                      | 2,1                          | FRANKREICH      |

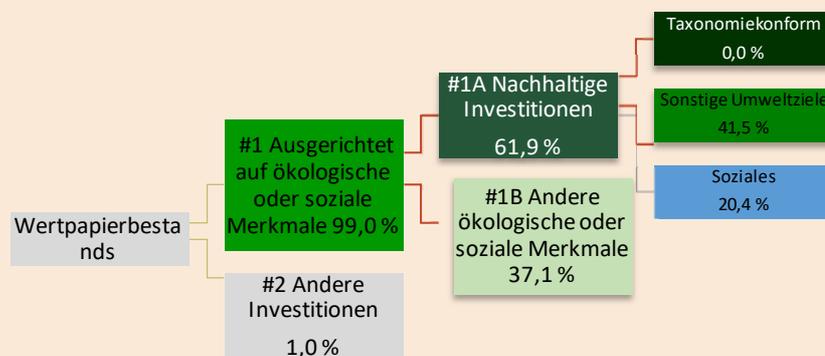


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Vermögensallokation des Portfolios im Bezugszeitraum wird in nachstehender Grafik dargestellt. Der Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder externen Anbietern beruhen.



**#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.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige** Investitionen umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.

- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

### In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

| Wirtschaftssektoren - BICS  | In % der Vermögenswerte |
|-----------------------------|-------------------------|
| NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 30,1                    |
| TECHNOLOGIE                 | 24,3                    |
| KOMMUNIKATION               | 17,3                    |
| FINANZWERTEN                | 15,8                    |

|                       |     |
|-----------------------|-----|
| INDUSTRIE             | 6,5 |
| ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 5,8 |
| ENERGIE               | 0,2 |



### Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

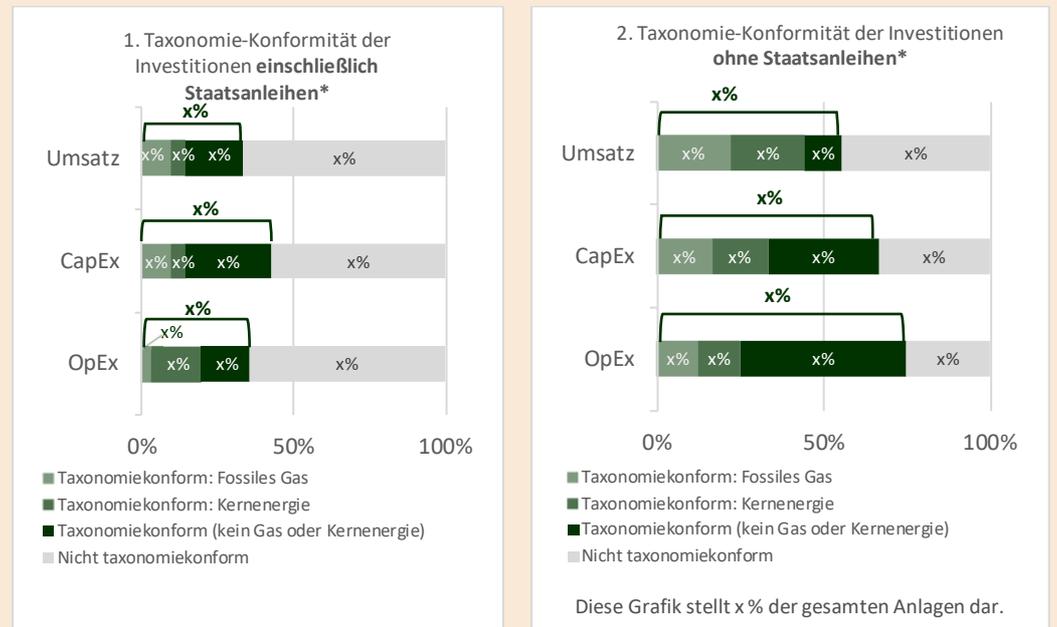
● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?**

- Ja:  
 In fossiles Gas     In Kernenergie  
 Nein

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten 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 Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

*Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.*



\* 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?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

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

**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

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

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



**Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Dies ist in der Grafik zur Vermögensallokation unter der Frage „Wie sah die Vermögensallokation aus?“ oben angegeben.



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

Dies ist in der Grafik zur Vermögensallokation unter der Frage „Wie sah die Vermögensallokation aus?“ oben angegeben.



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

„Andere Investitionen“ umfasst die übrigen Investitionen des Portfolios, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren noch als nachhaltige Investitionen eingestuft wurden.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder zur Gewährleistung einer adäquaten Liquidität, Absicherung und Besicherung.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Schutzstandards wie den UNGC-Grundsätzen, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten sowie Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das externe oder NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung besser zu erkennen. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die Gesamtbetrachtung der Unternehmen bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

### II. Mitwirkung:

Der Manager arbeitete mit den Unternehmen über ein solides ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung der Mitwirkung verfolgt.

### III. ESG-Sektor-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k.A.
- **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?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k.A.

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

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Global Value Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300VLTCS1K4EA7H66

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser 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?

**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 36,8 %\* 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**

Im Bezugszeitraum wurde der Neuberger Berman Global Sustainable Value Fund in Neuberger Berman Global Value Fund umbenannt und verringerte seine Verpflichtung, nachhaltige Investitionen zu halten, von 50 % auf 25 %.

\*Weitere Einzelheiten zur Vermögensallokation des Portfolios (einschließlich des Engagements in nachhaltigen Investitionen) finden Sie nachfolgend unter der Frage „*Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?*“.

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben zudem die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung dieser ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, THG-Emissionen, Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzmitteln und zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen im Gemeinwesen, Datenschutz und -sicherheit, Anreize für Mitarbeiter und Risikobereitschaft, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsnormen in der Lieferkette, Vielfalt und Integration der Belegschaft, Preistransparenz und verantwortungsvolles Marketing.

Das Portfolio zielt auf Konformität mit einem Netto-Null-Ziel ab, wie im SFDR-Anhang und im Abschnitt „Nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten“ im Prospekt ausführlicher beschrieben.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem Composite-ESG-Rating gemessen und wird im Folgenden in aggregierter Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### I. Das Composite-ESG-Rating:

Die vorstehend aufgeführten ökologischen und sozialen Merkmale wurden anhand einer Mischung aus ökologischen und sozialen Merkmalen abgeleitet und beurteilt, die aus dem hausinternen Neuberger Berman ESG-Ratingsystem (der „**NB-ESG-Quotient**“) und einem themenbasierten ESG-Ratingsystem („**NB-ESG-Themen**“), (zusammen das „**Composite-ESG-Rating**“) stammen.

Der NB- ESG-Quotient basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und ergab ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem er diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet. Grundlage des NB China ESG Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**NB**“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentrierte, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Das Ratingsystem in Bezug auf NB-ESG-Themen basiert auf dem Konzept sektorspezifischer ESG-Themen (bereitgestellt von Drittanbietern), die individuell gewichtet wurden und ein unternehmensspezifisches Gesamtrating in Bezug auf NB-ESG-Themen ergaben. Die sektorspezifischen NB-ESG-Themen erstreckten sich auf einzelne wesentliche ESG-Belange bzw. -Merkmale oder aggregierten wesentliche ESG-Belange bzw. -Merkmale, die ihrerseits ein ESG-Thema

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

bilden. Die betreffenden ökologischen und sozialen Merkmale sind vorstehend aufgeführt und Teil der übergeordneten ESG-Themen.

Unternehmen mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden Composite-ESG-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Unternehmen mit einem schlechten Composite-ESG-Rating, insbesondere dann, wenn ein Unternehmen diesbezüglich keine Maßnahmen ergriff, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Das Composite-ESG-Rating von Unternehmen wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein Composite-ESG-Mindestrating, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss.

| Bezugszeitraum       | Rating | Bereich   | Kombinierte Abdeckung |
|----------------------|--------|-----------|-----------------------|
| Composite-ESG-Rating | 0,5    | -1 bis +1 | 100 %                 |
| Daten von Dritten    | 7,1    | 0-10      |                       |

Für das Composite-ESG-Rating wird ein Wert zwischen -1 und +1 verwendet, wobei -1 das niedrigste und +1 das höchste Rating darstellt.

Das durchschnittliche Composite-ESG-Rating ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jedes im Portfolio gehaltene Unternehmen erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

## II. ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy, die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy und die sonstigen spezifischen Ausschlüsse identifiziert wurden, die im SFDR-Anhang des Portfolios angegeben sind, oder nicht mit diesen vereinbar waren. Zudem investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit dieser vereinbar waren), wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischen Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem Composite-ESG-Rating und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

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

Ausnahmsweise wurden für den Bezugszeitraum 2022 die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgte (sie umfassen die Veröffentlichung der SFDR-Vorlagen für vorvertragliche Informationen).

1. Composite-ESG-Rating

|                            | <b>Composite-ESG-Rating</b> | <b>Rating der Daten durch externe Anbieter</b> | <b>Kombinierte Abdeckung</b> |
|----------------------------|-----------------------------|--|------------------------------|
| <b>Bereich</b>             | -1 bis +1                   | 0-10   | 0-100 %                      |
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 0,6                         | 7,3  | 100 %                        |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 0,6                         | 7,3  | 100 %                        |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 0,5                         | 7,1  | 100 %                        |

2. Ausschlüsse

|                            | <b>Gesamtzahl der Verstöße</b> |
|----------------------------|--------------------------------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 0                              |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 0                              |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 0                              |

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

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckte sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Anlage zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Anlage eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat, wie nachstehend erläutert, und (iii) auf eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die gute Unternehmensführung eines Unternehmens, um festzustellen, ob das Unternehmen einer derartigen Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griff der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die Wirtschaftstätigkeit eines Unternehmens auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren.

Der Sub-Investment-Manager überprüfte die Unternehmen auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Unternehmen dieser Prüfung standhielten, quantifizierte der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag der Unternehmen zur Wirtschaft.

Der Sub-Investment-Manager erfasste dies auf drei Arten:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden);
- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDGs“) und

- Unternehmen aus Sektoren mit großen Auswirkungen, die sich auf der Grundlage des NB Net-Zero Alignment Indicator auf einen Netto-Null-Kurs umstellen.

Im Bezugszeitraum aktualisierte der Sub-Investment Manager den SFDR-Anhang des Portfolios, um dem Umstand Rechnung zu tragen, dass der Sub-Investment Manager bei der Ermittlung nachhaltiger Investitionen Unternehmen aus Sektoren mit großen Auswirkungen berücksichtigt, die sich auf der Grundlage des NB Net-Zero Alignment Indicator auf einen Netto-Null-Kurs umstellen.

Die Beurteilung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs wurde durch die Verfügbarkeit von angemessenen, verfügbaren und überprüfbaren Daten eingeschränkt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griff der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Proxydaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des Rahmens für nachhaltige Investitionen von NB zurück.

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

Der Sub-Investment-Manager wandte seinen Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigten. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachtete der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele waren, die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (die „PAIs“):

| PAIs                              |  |
|-----------------------------------|--|
| Thema                             | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen  |
| <i>Treibhausgasemissionen</i>     | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind<br>PAI 5 - Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen<br>PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren |
| <i>Biodiversität</i>              | PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken   |
| <i>Wasser</i>                     | PAI 8 - Emissionen in Wasser   |
| <i>Abfall</i>                     | PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle   |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen  |

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.

PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen

PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle

PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen

PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Sub-Investment-Manager hat auch Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen berücksichtigt. Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

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

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, dass die ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen des Portfolios nicht erheblich beeinträchtigt wurden, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Unternehmen, die unter die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen;
- Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Unternehmen, die unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

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

Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die ILO-Grundsätze, die UNGC-Grundsätze und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*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 EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

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

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



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

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Unternehmen durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

1. Wie oben unter „*Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?*“ erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele führten, alle PAIs berücksichtigt.
2. Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

| PAIs auf Produktebene  |   |
|------------------------|---|
| Thema                  | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen   |
| Treibhausgasemissionen | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |

|                                   |  |
|-----------------------------------|--|
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen<br>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen<br>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |
|-----------------------------------|--|

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



### Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat den Bloomberg Industry Classification Standard („**BICS**“) verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2024 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2024 – 31. Dezember 2024

| Größte Investitionen          | Sektor                      | In % der Vermögenswerte | Land            |
|-------------------------------|-----------------------------|-------------------------|-----------------|
| APPLE INC                     | TECHNOLOGIE                 | 2,7                     | USA             |
| ALPHABET INC-CL A             | KOMMUNIKATION               | 1,8                     | USA             |
| CATERPILLAR INC               | INDUSTRIE                   | 1,7                     | USA             |
| ABBVIE INC                    | NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 1,6                     | USA             |
| SHELL PLC-NEW /GBP/           | ENERGIE                     | 1,6                     | GROSSBRITANNIEN |
| JOHNSON & JOHNSON             | NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 1,4                     | USA             |
| COMCAST CORP-CLASS A          | KOMMUNIKATION               | 1,4                     | USA             |
| APPLIED MATERIALS INC         | TECHNOLOGIE                 | 1,3                     | USA             |
| MANULIFE FINANCIAL CORP /CAD/ | FINANZWERTEN                | 1,3                     | KANADA          |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC      | FINANZWERTEN                | 1,3                     | USA             |
| TOTALENERGIES SE /EUR/        | ENERGIE                     | 1,3                     | FRANKREICH      |
| QUALCOMM INC                  | TECHNOLOGIE                 | 1,2                     | USA             |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP   | FINANZWERTEN                | 1,2                     | USA             |
| NOVARTIS AG-REG /CHF/         | NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 1,2                     | SCHWEIZ         |
| SIMON PROPERTY GROUP INC      | FINANZWERTEN                | 1,2                     | USA             |

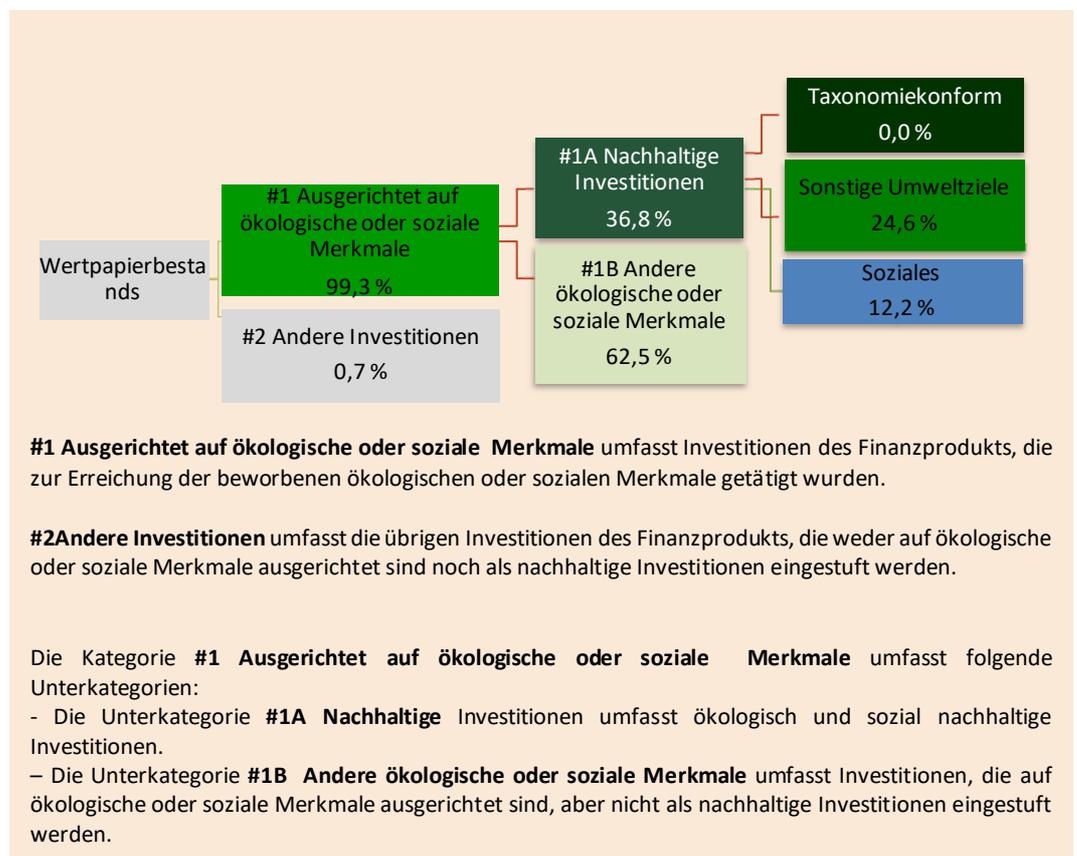


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögens-

### ● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein ESG-Composite-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte, und seine Berechnungen können auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Dritten basieren. Die Berechnung beruhte auf einer Marktbewertung des Portfolios.



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

| Wirtschaftssektoren - BICS  | In % der Vermögenswerte |
|-----------------------------|-------------------------|
| FINANZWERTEN                | 23,8                    |
| NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 18,6                    |
| TECHNOLOGIE                 | 15,0                    |
| KOMMUNIKATION               | 12,3                    |
| INDUSTRIE                   | 8,5                     |
| ZYKLISCHE KONSUMGÜTER       | 8,5                     |

|                |     |
|----------------|-----|
| ENERGIE        | 7,6 |
| GRUNDSTOFFE    | 3,5 |
| VERSORGUNG     | 2,1 |
| DIVERSIFIZIERT | 0,1 |

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.



## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, ob das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

- Ja:
- In fossiles Gas     In Kernenergie
- Nein

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Bei-trag zu den Umweltzielen leisten.

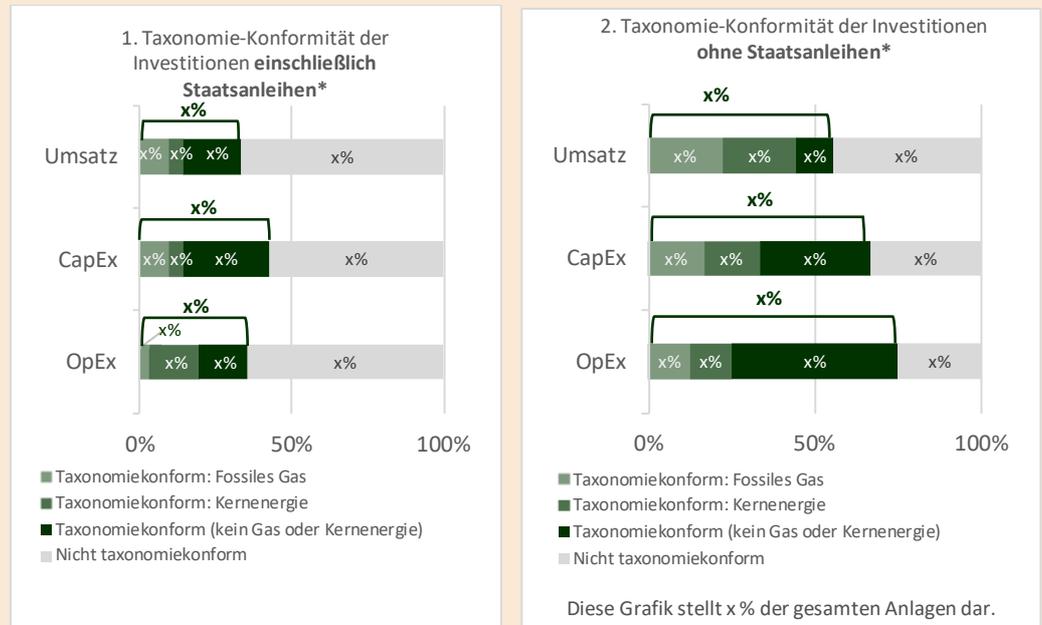
- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten 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 Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. 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.



\* 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?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



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 nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Dies ist in der Grafik zur Vermögensallokation unter der Frage „Wie sah die Vermögensallokation aus?“ oben angegeben.



### Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Dies ist in der Grafik zur Vermögensallokation unter der Frage „Wie sah die Vermögensallokation aus?“ oben angegeben.



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

„Andere Investitionen“ umfasst die übrigen Investitionen des Portfolios, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren noch als nachhaltige Investitionen eingestuft wurden.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Ausrichtung der Investitionen auf die mit dem Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale, indem es (wie jeweils anwendbar) das Composite-ESG-Rating sowie Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das ESG-Composite-Rating (wie vorstehend erläutert) wurde verwendet, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu messen. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (das ESG-Composite-Rating) in die Gesamtbetrachtung der Unternehmen bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

### II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager nutzte die von NB intern geführten Dialoge mit den Managementteams der Unternehmen. Dies wurde durch ein robustes ESG-Dialogprogramm erreicht, das auf Ebene der NB-Einheiten und nicht auf Portfolioebene stattfand. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen intern geführten Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung der Mitwirkung verfolgt.

### III. ESG-Sektor-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wendete das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



### **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

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?***  
k.A.
- ***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?***  
k.A.
- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***  
k.A.
- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***  
k.A.

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman High Yield Bond Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300IJY8N43QRUU802

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser 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?

**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**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Sofem in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung, Wasserbewirtschaftung und Entsorgung gefährlicher Abfälle.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Geschäftsethik; Chemikaliensicherheit, Beziehungen im Gemeinwesen, umstrittene Beschaffung, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität, verantwortungsbewusste Werbung, Etikettierung und Marketing und Menschenrechte. .

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB China ESG Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**NB**“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentrierte, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen. Jedes Sektorkriterium wurde unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analyistentams für das Portfolio genutzt wurde.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergriffen hat, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Des Weiteren war der Sub-Investment-Manager bestrebt, eine konstruktive Zusammenarbeit mit den Unternehmensemittenten zu priorisieren.

| Bezugszeitraum           | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|--------------------------|--------|---------|-----------------------|
| <b>NB-ESG-Quotient</b>   | 58     | 1-100   | 100 %                 |
| <b>Daten von Dritten</b> | 5,5    | 0-10    |                       |

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

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums wurde mit Climate Value-at-Risk („**CVaR**“) das Ausmaß der Risiken und Chancen des Übergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmensemittenten gemessen.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts einer Emission oder eines Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

|  |         |
|--|---------|
| Der CVaR prognostizierte, dass ein Szenario der Klimaerwärmung beim verwalteten Vermögen im Bezugszeitraum zu folgendem Wertverlust führen könnte. | -10,8 % |
| CVaR-Abdeckung im Bezugszeitraum.  | 48 %    |

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

## 3. ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy und die sonstigen spezifischen Ausschlüsse identifiziert wurden, die im SFDR-Anhang des Portfolios angegeben sind, oder nicht mit diesen vereinbar waren. Außerdem investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen

(„UNGC-Grundsätze“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („OECD-Leitsätze“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („UNGP“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („ILO-Normen“) verstießen.

Bei der Anwendung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

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

Ausnahmsweise wurden für den Bezugszeitraum 2022 die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgte (sie umfassen die Veröffentlichung der SFDR-Vorlagen für vorvertragliche Informationen).

1. NB-ESG-Quotient

|                            | <b>NB-ESG-Quotient-Rating</b> | <b>Rating der Daten durch externe Anbieter</b> | <b>Kombinierte Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| <b>Bereich</b>             | 1-100                         | 0-10   | 0-100 %                      |
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 57                            | 5,0  | 99 %                         |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 57                            | 5,3  | 99 %                         |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 58                            | 5,5  | 100 %                        |

2. CVaR

|                            | <b>CVaR</b> | <b>Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------|------------------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | -12,0 %     | 57 %             |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | -12,3 %     | 51 %             |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | -10,8       | 48 %             |

### 3. Ausschlüsse

|                     | Gesamtzahl der Verstöße |
|---------------------|-------------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | 0                       |
| Bezugszeitraum 2023 | 0                       |
| Bezugszeitraum 2024 | 0                       |

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

k.A.

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

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager nicht in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst 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.

*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 EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

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

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



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

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

| <b>PAIs auf Produktebene</b>      |  |
|-----------------------------------|--|
| <b>Thema</b>                      | <b>Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen</b>   |
| <i>Treibhausgasemissionen</i>     | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind  |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen<br>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen<br>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



### Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat den Bloomberg Industry Classification Standard („BICS“) verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2024 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2024 – 31. Dezember 2024

| Größte Investitionen   | Sektor                           | In % der Vermögenswerte | Land    |
|--|----------------------------------|-------------------------|---------|
| MEDLINE BORROWER LP REGD 144A P/P  | NICHT-ZYKLISCHE<br>KONSUMGÜTER   | 1,0                     | USA     |
| TRANSDIGM INC REGD 144A P/P  | INDUSTRIE<br>ZYKLISCHE           | 0,6                     | USA     |
| CARNIVAL HLDGS BM LTD REGD 144A P/P<br>ATHENAHEALTH GROUP INC REGD 144A P/P      | KONSUMGÜTER                      | 0,6                     | BERMUDA |
| XPO INC REGD 144A P/P  | TECHNOLOGIE                      | 0,5                     | USA     |
| CCO HLDGS LLC/CAP CORP REGD 144A P/P<br>BOOST NEWCO BORROWER LLC REGD 144A P/P   | INDUSTRIE                        | 0,5                     | USA     |
| UKG INC REGD 144A P/P<br>MAUSER PACKAGING SOLUT REGD 144A P/P                    | KOMMUNIKATION<br>NICHT-ZYKLISCHE | 0,5                     | USA     |
| VM CONSOLIDATED INC REGD 144A P/P  | KONSUMGÜTER                      | 0,5                     | USA     |
| UNITED AIRLINES INC REGD 144A P/P  | INDUSTRIE                        | 0,4                     | USA     |
| ALLIANT HOLD / CO-ISSUER REGD 144A P/P<br>SC GAMES HOLDIN/US FINCO REGD 144A P/P | NICHT-ZYKLISCHE<br>KONSUMGÜTER   | 0,4                     | USA     |
| NRG ENERGY INC REGD V/R /PERP/ 144A P/P  | TECHNOLOGIE                      | 0,4                     | USA     |
| FRONTIER COMMUNICATIONS REGD   | INDUSTRIE<br>NICHT-ZYKLISCHE     | 0,4                     | USA     |
|  | KONSUMGÜTER                      | 0,4                     | USA     |
|  | FINANZWERTEN<br>ZYKLISCHE        | 0,4                     | USA     |
|  | KONSUMGÜTER                      | 0,4                     | USA     |
|  | VERSORGUNG                       | 0,4                     | USA     |
|  | KOMMUNIKATION                    | 0,4                     | USA     |

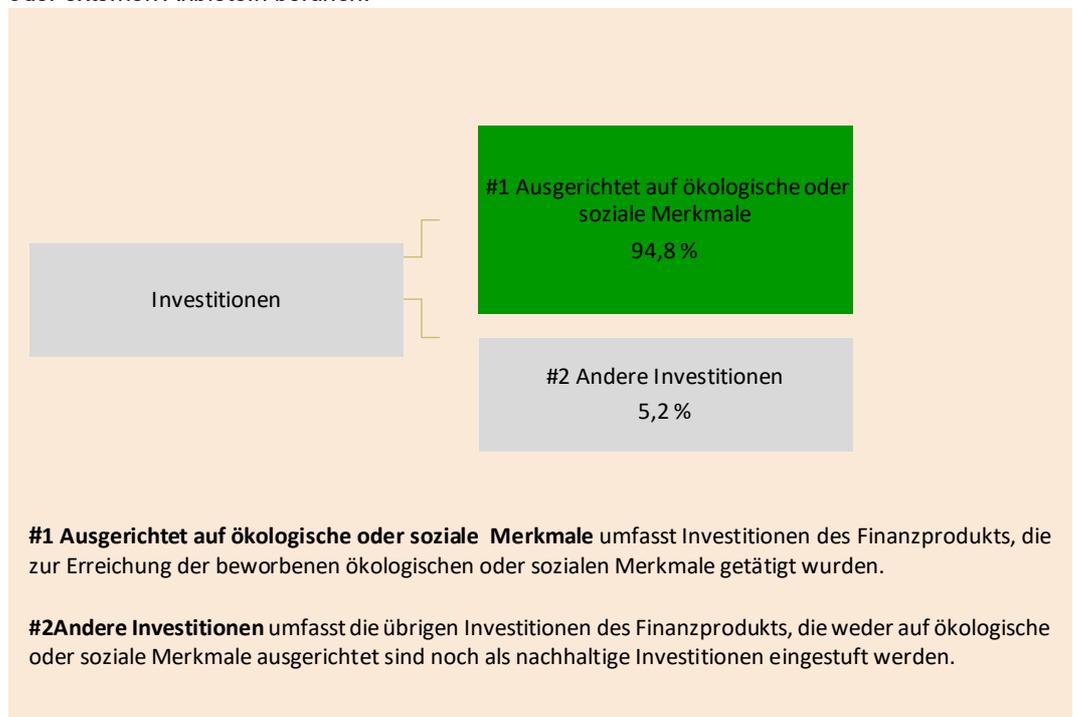


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### ● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Die Vermögensallokation des Portfolios im Bezugszeitraum wird in nachstehender Grafik dargestellt. Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen.



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

| <b>Wirtschaftssektoren - BICS</b>               | <b>In % der Vermögenswerte</b> |
|---|--------------------------------|
| ZYKLISCHE KONSUMGÜTER                           | 18,8                           |
| NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER                     | 15,2                           |
| INDUSTRIE                                       | 14,0                           |
| KOMMUNIKATION                                   | 12,7                           |
| ENERGIE   | 11,3                           |
| FINANZWERTEN                                    | 10,1                           |
| GRUNDSTOFFE                                     | 7,6                            |
| TECHNOLOGIE                                     | 4,0                            |
| VERSORGUNG                                      | 3,6                            |
| FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE (ABS-ANLEIHEN) | 1,6                            |
| KREDIT  | 0,9                            |
| DIVERSIFIZIERT                                  | 0,2                            |



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

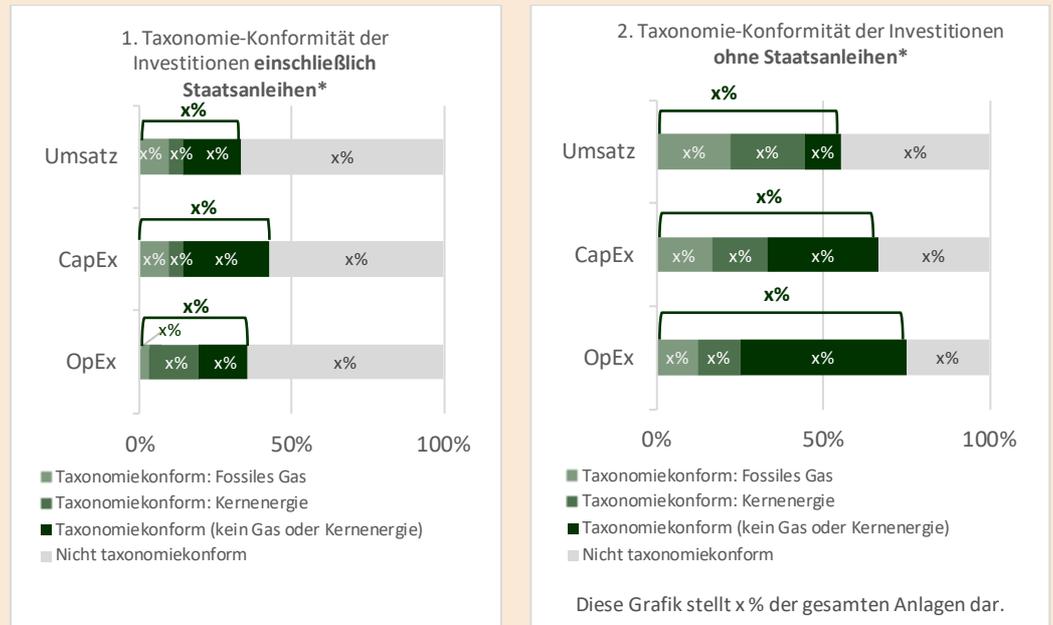
- Ja:  
 In fossiles Gas  In Kernenergie
- Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten 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 Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. 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.



\* 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?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



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 nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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

„Andere Investitionen“ umfasst die übrigen Investitionen des Portfolios, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren noch als nachhaltige Investitionen eingestuft wurden.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager war der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Emittenteanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten sowie Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

### II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### III. ESG-Sektor-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

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?**  
k.A.
- **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?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k.A.

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman InnovAsia (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300VMISY5R7FEHX25

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser 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?

**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 28,1 %\* 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**

\*Im Bezugszeitraum wurde der Neuberger Berman InnovAsia 5G Fund in Neuberger Berman InnovAsia Fund umbenannt.

\*\*Weitere Einzelheiten zur Vermögensallokation des Portfolios (einschließlich des Engagements in nachhaltige Investitionen) finden Sie unter der Frage „Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?“

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Sofem in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die

Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Klimarisiken, THG-Emissionen, Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Wasserbewirtschaftung, Energiemanagement, Abfallentsorgung, Kraftstoffeffizienz, Gelegenheiten für saubere Technologien, Management des Produktlebenszyklus, Materialbeschaffung und Chemikaliensicherheit.
- **Soziale Merkmale:** Betriebssicherheit und Krisenvorsorge, Zugang zu Finanzmitteln, Zugang zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen im Gemeinwesen, Datenschutz und -sicherheit, Gesundheit und Ernährung, Preistransparenz, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Vielfalt und Integration in der Belegschaft, Geschäftsethik, Produktsicherheit, -qualität und -integrität, Management systemischer Risiken, Management des Rechts- und Regulierungsumfelds und Lieferkettenmanagement.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

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

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB China ESG Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**NB**“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analyistenteam für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Unternehmen wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss. Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes NB-ESG-Quotient- oder externes Rating aufwiesen, um im Laufe der Zeit eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachten) zu erreichen.

| Bezugszeitraum    | Rating         | Bereich           | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|----------------|-------------------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient   | ES: C<br>G:2.5 | ES: A-D<br>G: 1-4 | 98 %                  |
| Daten von Dritten | 5,3            | 1-10              |                       |

Im Hinblick auf das NB-ESG-Quotient-Rating für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale („ES“) werden die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance („G“) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jedes im Portfolio gehaltene Unternehmen erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums erfasste Climate Value-at-Risk („CVaR“) das Ausmaß der Risiken und der Chancen des Klimaübergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmen.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

|  |        |
|--|--------|
| Der CVaR prognostizierte, dass ein Szenario der Klimaerwärmung beim verwalteten Vermögen im Bezugszeitraum zu folgendem Wertverlust führen könnte. | -7,7 % |
| CVaR-Abdeckung im Bezugszeitraum.  | 89 %   |

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

### 3. ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy, die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy und die sonstigen spezifischen Ausschlüsse identifiziert wurden, die im SFDR-Anhang des Portfolios angegeben sind, oder nicht mit diesen vereinbar waren. Zudem investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit dieser vereinbar waren), wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischen Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

#### Sonstiges

Im Bezugszeitraum brachte das Portfolio die Neuberger Berman Enhanced Sustainable Exclusion Policy nicht zur Anwendung.

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

Ausnahmsweise wurden für den Bezugszeitraum 2022 die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgte (sie umfassen die Veröffentlichung der SFDR-Vorlagen für vorvertragliche Informationen).

### 1. NB-ESG-Quotient

|                            | <b>NB-ESG-Quotient-Rating</b> | <b>Rating der Daten durch externe Anbieter</b> | <b>Kombinierte Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| <b>Bereich</b>             | ES: A-D<br>G: 1-4             | 0-10   | 0-100 %                      |
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | ES: C<br>G: 2,2               | 4,3  | 86 %                         |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | ES: C<br>G: 2,5               | 4,7  | 96 %                         |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | ES: C<br>G: 2,5               | 5,3  | 98 %                         |

## 2. CVaR

|                            | CVaR   | Abdeckung |
|----------------------------|--------|-----------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | -5,3 % | 87 %      |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | -8,0 % | 89 %      |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | -7,7 % | 89 %      |

## 3. Ausschlüsse

|                            | Gesamtzahl der Verstöße |
|----------------------------|-------------------------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 0                       |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 0                       |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 0                       |

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

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckte sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Anlage zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Anlage eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat, wie nachstehend erläutert, und (iii) auf eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die gute Unternehmensführung eines Unternehmens, um festzustellen, ob das Unternehmen einer derartigen Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griff der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die Wirtschaftstätigkeit eines Unternehmens auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren.

Der Sub-Investment-Manager überprüfte die Unternehmen auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Unternehmen dieser Prüfung standhielten, quantifizierte der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag der Unternehmen zur Wirtschaft.

Der Sub-Investment-Manager erfasste dies auf drei Arten:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden);
- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDGs“) und
- Unternehmen aus Sektoren mit großen Auswirkungen, die sich auf der Grundlage des NB Net-Zero Alignment Indicator auf einen Netto-Null-Kurs umstellen.

Im Bezugszeitraum aktualisierte der Sub-Investment Manager den SFDR-Anhang des Portfolios, um dem Umstand Rechnung zu tragen, dass der Sub-Investment Manager bei der Ermittlung nachhaltiger Investitionen Unternehmen aus Sektoren mit großen Auswirkungen berücksichtigt, die sich auf der Grundlage des NB Net-Zero Alignment Indicator auf einen Netto-Null-Kurs umstellen.

Die Beurteilung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs wurde durch die Verfügbarkeit von angemessenen, verfügbaren und überprüfbaren Daten eingeschränkt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griff der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Proxydaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

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

Der Sub-Investment-Manager wandte seinen Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigten. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachtete der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachhaltigen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele waren, die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Indikatoren für die wichtigsten nachhaltigen Auswirkungen (die „PAIs“):

| PAIs                              |  |
|-----------------------------------|--|
| Thema                             | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen  |
| <i>Treibhausgasemissionen</i>     | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind<br>PAI 5 - Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen<br>PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren   |
| <i>Biodiversität</i>              | PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken   |
| <i>Wasser</i>                     | PAI 8 - Emissionen in Wasser   |
| <i>Abfall</i>                     | PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle   |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen<br>PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen<br>PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle<br>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen |

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

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Sub-Investment-Manager hat auch Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen berücksichtigt. Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

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

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, dass die ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen des Portfolios nicht erheblich beeinträchtigt wurden, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Unternehmen, die unter die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen;
- Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Unternehmen, die unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

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

Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*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 EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

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

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



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

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Unternehmen durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

1. Wie oben unter „*Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?*“ erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele führten, alle PAIs berücksichtigt.
2. Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

| PAIs auf Produktebene             |  |
|-----------------------------------|--|
| Thema                             | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen  |
| <i>Treibhausgasemissionen</i>     | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind  |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen<br>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen<br>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat den Bloomberg Industry Classification Standard („**BICS**“) verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2024 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2024 – 31. Dezember 2024

| Größte Investitionen           | Sektor        | In % der Vermögenswerte | Land    |
|--------------------------------|---------------|-------------------------|---------|
| TAIWAN SEMICONDUCTOR MAN /TWD/ | TECHNOLOGIE   | 5,2                     | TAIWAN  |
| BHARTI AIRTEL LTD /INR/        | KOMMUNIKATION | 3,4                     | INDIEN  |
| FPT CORP /VND/                 | TECHNOLOGIE   | 3,4                     | VIETNAM |
| EMEMORY TECHNOLOGY INC /TWD/   | TECHNOLOGIE   | 3,2                     | TAIWAN  |
| SHIBAURA MECHATRONICS CO /JPY/ | INDUSTRIE     | 3,2                     | JAPAN   |
| SK HYNIX INC /KRW/             | TECHNOLOGIE   | 3,1                     | KOREA   |
| ZOMATO LTD /INR/               | KOMMUNIKATION | 2,7                     | INDIEN  |

|                                |                          |     |        |
|--------------------------------|--------------------------|-----|--------|
| MARUWA CO LTD /JPY/            | INDUSTRIE                | 2,7 | JAPAN  |
| NITTO BOSEKI CO LTD /JPY/      | ZYKLISCHE<br>KONSUMGÜTER | 2,6 | JAPAN  |
| DISCO CORP /JPY/               | TECHNOLOGIE              | 2,5 | JAPAN  |
| TOWA CORP /JPY/                | INDUSTRIE                | 2,5 | JAPAN  |
| ACCTON TECHNOLOGY CORP /TWD/   | KOMMUNIKATION            | 2,4 | TAIWAN |
| TECHWING INC /KRW/             | TECHNOLOGIE              | 2,4 | KOREA  |
| JENTECH PRECISION INDUST /TWD/ | INDUSTRIE                | 2,4 | TAIWAN |
| HD HYUNDAI ELECTRIC CO L /KRW/ | INDUSTRIE                | 2,3 | KOREA  |

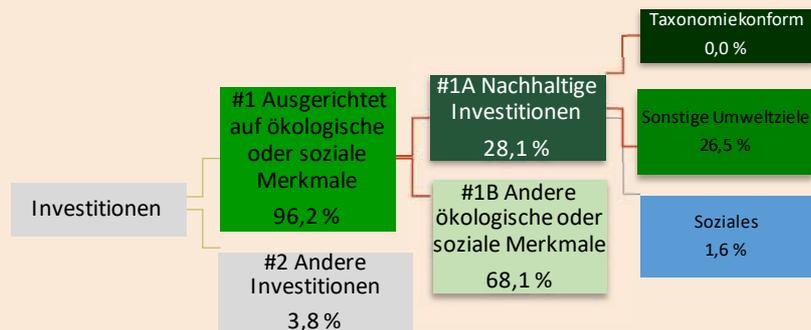


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### ● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Die Vermögensallokation des Portfolios im Bezugszeitraum wird in nachstehender Grafik dargestellt. Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder externen Anbietern beruhen.



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

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

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige** Investitionen umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.

- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

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

| Wirtschaftssektoren - BICS  | In % der Vermögenswerte |
|-----------------------------|-------------------------|
| TECHNOLOGIE                 | 45,9                    |
| INDUSTRIE                   | 31,9                    |
| KOMMUNIKATION               | 11,6                    |
| ZYKLISCHE KONSUMGÜTER       | 5,8                     |
| NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 4,0                     |
| VERSORGUNG                  | 0,6                     |
| GRUNDSTOFFE                 | 0,2                     |



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

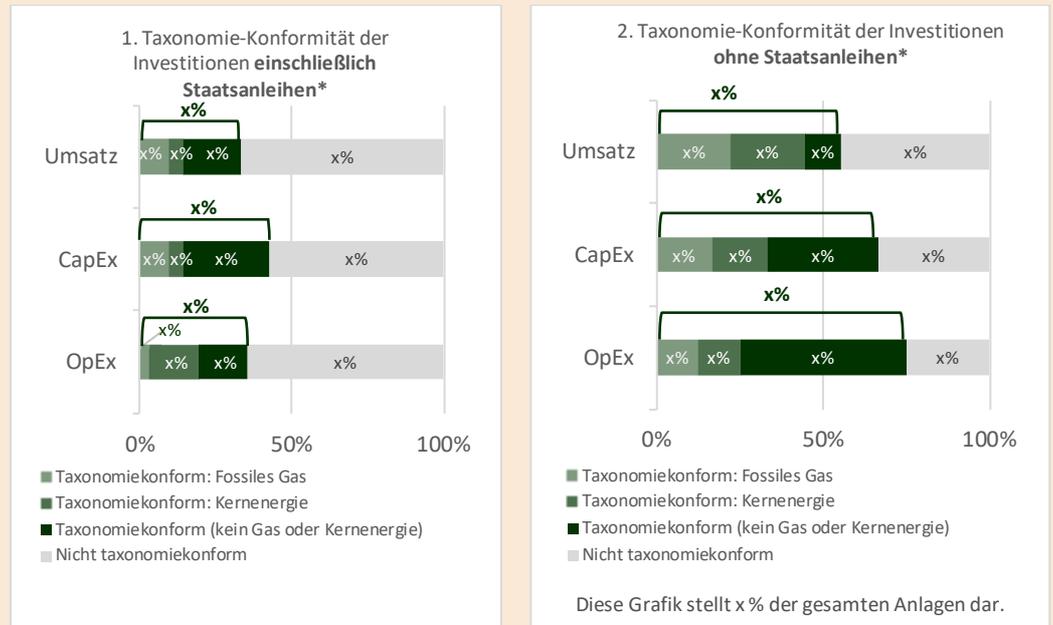
Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten 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 Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* 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?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



## Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Dies ist in der Grafik zur Vermögensallokation unter der Frage „Wie sah die Vermögensallokation aus?“ oben angegeben.



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?

Dies ist in der Grafik zur Vermögensallokation unter der Frage „Wie sah die Vermögensallokation aus?“ oben angegeben.



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

„Andere Investitionen“ umfasst die übrigen Investitionen des Portfolios, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren noch als nachhaltige Investitionen eingestuft wurden.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten sowie Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das externe oder NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung eines Unternehmens besser zu erkennen, wobei darauf hingewiesen wird, dass der Schwerpunkt des Portfolios auf Investitionen in Unternehmen liegt, welche die Entwicklung des Themas „Innovative Technologies“ fördern.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die thematische Beurteilung und die Gesamtbeurteilung des Unternehmens bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

### II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager arbeitete mit den Unternehmen mit einem soliden ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### III. ESG-Sektor-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



#### **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k.A.
- **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?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k.A.

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

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Japan Equity Engagement Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300ELGQMFUUPHG878

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser 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?

**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**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben zudem die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung dieser ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzmitteln und zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen im Gemeinwesen, Datenschutz und -sicherheit, Anreize für Mitarbeiter und Risikobereitschaft, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsnormen in der Lieferkette, Vielfalt und Integration der Belegschaft, Preistransparenz und verantwortungsvolles Marketing.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit der hausinternen NB-ESG-Bewertung gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Die hausinterne NB-ESG-Bewertung:

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte als Teil des Anlageprozesses verschiedene ökologische und soziale Merkmale für sein Bewertungsmodell. Der Sub-Investment-Manager griff auf eine hausinterne ESG-Bewertung von Neuberger Berman („NB“) zurück, der an den japanischen Markt angepasst wurde. Die hausinterne NB-ESG-Bewertung berücksichtigte in ihrem Bewertungsmodell außerdem das Mitwirkungspotenzial. Ferner berücksichtigte die hausinterne NB-ESG-Bewertung die von der Wesentlichkeitsmatrix von NB identifizierten ökologischen und sozialen Merkmale, die auf dem Wesentlichkeitsrahmen des Sustainability Accounting Standards Board („SASB“) basieren. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB konzentrierte sich auf die ESG-Merkmale, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden.

Grundlage für die hausinterne NB-ESG-Bewertung von NB ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von NB. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB konzentrierte sich auf die ESG-Merkmale, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sekorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteten ESG-Daten erstellt. Ergänzend kommen interne qualitative Analysen hinzu, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams des Sub-Investment-Managers genutzt wird.

Die hausinterne NB-ESG-Bewertung gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren für jeden Sektor, um davon eine hausinterne NB-ESG-Bewertung für Unternehmen abzuleiten, die im Portfolio gehalten werden. Unternehmen mit einer günstigen und/oder sich verbessernden hausinternen NB-ESG-Bewertung erhalten eine höhere Punktzahl, was bei der Erhöhung der Gewichtung der Unternehmen im Portfolio ein wesentlicher Gesichtspunkt war. Unternehmen mit einer schlechten hausinternen NB-ESG-Bewertung, insbesondere dann, wenn ein Unternehmen keine diesbezüglichen Maßnahmen ergriff, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit mit einer niedrigeren Bewertung versehen, wodurch die Gewichtung eines Unternehmens im Portfolio verringert werden konnte. Darüber hinaus bemühte sich der Sub-Investment-Manager, konstruktiven Dialogen bei im Portfolio gehaltenen Unternehmen Vorrang einzuräumen, um deren Bemühungen bei der Bewältigung wesentlicher Belange zu unterstützen, die der Sub-Investment-Manager für die unternehmerischen Fundamentaldaten und das langfristige Wachstum des Unternehmens, einschließlich ökologischer und sozialer Belange als ausschlaggebend erachtete. Der Erfolg der konstruktiven Mitwirkungsbemühungen des Sub-Investment-Managers gegenüber den Unternehmen hängt davon ab, wie offen die Unternehmen sind und wie sie auf eine solche Mitwirkung reagieren.

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

| Bezugszeitraum           | Rating            | Bereich            | Kombinierte Abdeckung |
|--------------------------|-------------------|--------------------|-----------------------|
| Interne NB-ESG-Bewertung | ES: 8,1<br>G: 7,9 | ES: 1-15<br>G:1-15 | 99 %                  |
| Daten von Dritten        | 5,6               | 0-10               |                       |

Im Hinblick auf die hausinterne NB-ESG-Bewertung wurde ein separates Rating zwischen 1 und 15 für ökologische und soziale Merkmale („ES“) sowie zur Bewertung der Governance („G“) verwendet, wobei 15 dem höchsten und 1 dem niedrigsten Rating entspricht. Für dieses Portfolio gibt es keine hausinterne NB-ESG-Mindestbewertung, die ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss.

Die durchschnittliche hausinterne NB-ESG-Bewertung ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jedes im Portfolio gehaltene Unternehmen erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums erfasste Climate Value-at-Risk („CVaR“) das Ausmaß der Risiken und der Chancen des Klimaübergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmen.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

|  |         |
|--|---------|
| Der CVaR prognostizierte, dass ein Szenario der Klimaerwärmung beim verwalteten Vermögen im Bezugszeitraum zu folgendem Wertverlust führen könnte. | -25,2 % |
| CVaR-Abdeckung im Bezugszeitraum.  | 79 %    |

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Suv-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

### 3. ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy, die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy, Ausschlüsse gemäß dem EU-Referenzwert für klimabedingten Wandel („EU-CTB“), wie im Rahmen der Neuberger Berman EU Climate Benchmark Standard Exclusions Policy vorgesehen, und die sonstigen spezifischen Ausschlüsse identifiziert wurden, die im SFDR-Anhang des Portfolios angegeben sind, oder nicht mit diesen vereinbar waren. Zudem investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („UNGC-Grundsätze“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („OECD-Leitsätze“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („UNGPs“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („ILO-Normen“) verstießen.

Bei der Anwendung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus der hausinternen NB-ESG-Bewertung und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

#### Sonstiges

Im Bezugszeitraum führte das Portfolio die EU-CTB-Ausschlüsse ein, wie im Rahmen der Neuberger Berman EU Climate Benchmark Standard Exclusions Policy vorgesehen. Die Neuberger Berman EU Climate Benchmark Standard Exclusions Policy wurde vom Sub-Investment-Manager erstellt zur Ausrichtung auf die Leitlinien der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde zu Fondsnamen, die ESG- oder nachhaltigkeitsbezogene Begriffe verwenden.

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

Ausnahmsweise wurden für den Bezugszeitraum 2022 die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgte (sie umfassen die Veröffentlichung der SFDR-Vorlagen für vorvertragliche Informationen).

### 1. Interne NB-ESG-Bewertung

|                            | Interne NB-ESG-Bewertung | Rating der Daten durch externe Anbieter | Kombinierte Abdeckung |
|----------------------------|--------------------------|---|-----------------------|
| <b>Bereich</b>             | ES:1-15<br>G: 1-15       | 0-10                                    | 0-100 %               |
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | ES: 8,1<br>G: 8,5        | 5,1                                     | 100 %                 |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | ES: 7,7<br>G: 7,7        | 5,5                                     | 98 %                  |

|                            |                   |     |      |
|----------------------------|-------------------|-----|------|
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | ES: 8,1<br>G: 7,9 | 5,6 | 99 % |
|----------------------------|-------------------|-----|------|

## 2. CVaR

|                            | <b>CVaR</b> | <b>Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------|------------------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | -20,7 %     | 90 %             |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | -21,8 %     | 77 %             |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | -25,2 %     | 79 %             |

## 3. Ausschlüsse

|                            | <b>Gesamtzahl der Verstöße</b> |
|----------------------------|--------------------------------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 0                              |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 0                              |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 0                              |

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

k.A.

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

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten. Dessen ungeachtet war der Sub-Investment-Manager nicht in Unternehmen investiert, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-

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.

Grundsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*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 EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



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

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Unternehmen durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

| <b>PAIs auf Produktebene</b>      |  |
|-----------------------------------|--|
| <b>Thema</b>                      | <b>Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen</b>   |
| <i>Treibhausgasemissionen</i>     | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind  |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen<br>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen<br>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbar Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



### Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat den Bloomberg Industry Classification Standard („**BICS**“) verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2024 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2024 – 31. Dezember 2024

| Größte Investitionen            | Sektor                      | In % der Vermögenswerte | Land  |
|---------------------------------|-----------------------------|-------------------------|-------|
| OKINAWA CELLULAR TELEPHO //JPY/ | KOMMUNIKATION               | 5,2                     | JAPAN |
| TOKYU FUDOSAN HOLDINGS C //JPY/ | FINANZWERTEN                | 3,6                     | JAPAN |
| JSB CO LTD //JPY/               | FINANZWERTEN                | 3,6                     | JAPAN |
| YAMANASHI CHUO BANK LTD //JPY/  | FINANZWERTEN                | 3,5                     | JAPAN |
| TRANSACTION CO LTD //JPY/       | ZYKLISCHE KONSUMGÜTER       | 3,4                     | JAPAN |
| USS CO LTD //JPY/               | ZYKLISCHE KONSUMGÜTER       | 3,3                     | JAPAN |
| MITSUBISHI LOGISTICS COR //JPY/ | INDUSTRIE                   | 3,2                     | JAPAN |
| DAIEI KANKYO CO LTD //JPY/      | INDUSTRIE                   | 3,2                     | JAPAN |
| NITERRA CO LTD //JPY/           | ZYKLISCHE KONSUMGÜTER       | 3,1                     | JAPAN |
| AMADA CO LTD //JPY/             | INDUSTRIE                   | 3,1                     | JAPAN |
| RESORTTRUST INC //JPY/          | ZYKLISCHE KONSUMGÜTER       | 2,6                     | JAPAN |
| SHOFU INC //JPY/                | NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 2,5                     | JAPAN |
| DAIWA INDUSTRIES LTD //JPY/     | INDUSTRIE                   | 2,4                     | JAPAN |
| ASICS CORP //JPY/               | ZYKLISCHE KONSUMGÜTER       | 2,3                     | JAPAN |
| MUSASHI SEIMITSU INDUSTR //JPY/ | ZYKLISCHE KONSUMGÜTER       | 2,0                     | JAPAN |

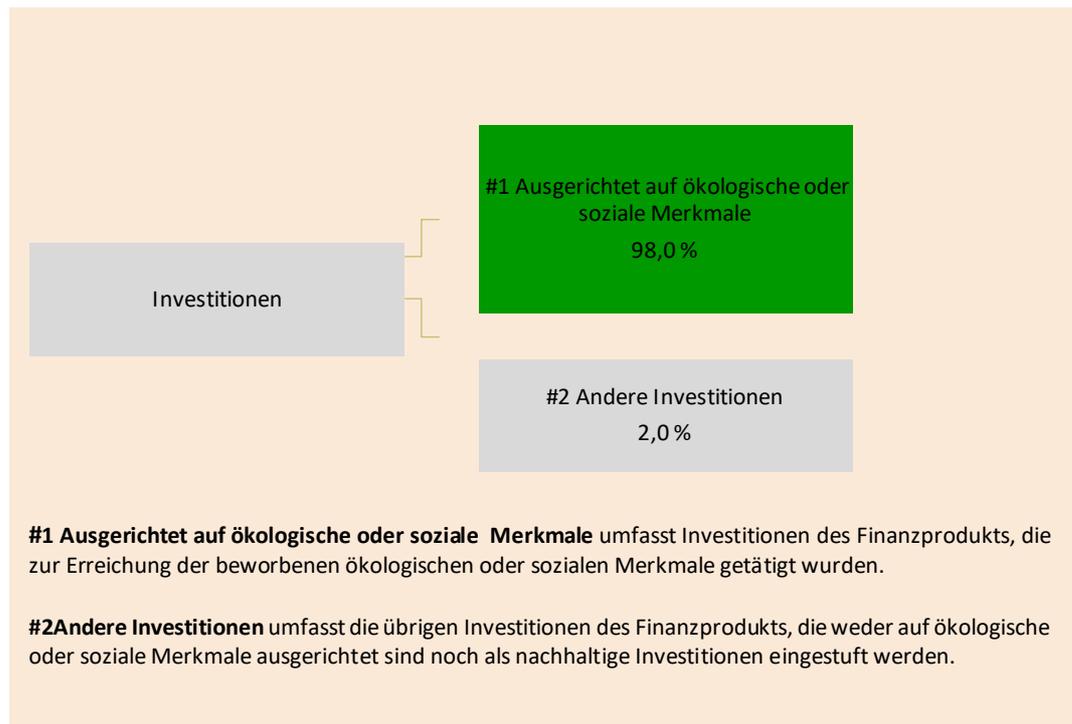


### Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### ● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Die Vermögensallokation des Portfolios im Bezugszeitraum wird in nachstehender Grafik dargestellt. Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder eine hausinterne NB-ESG-Bewertung oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder externen Anbietern beruhen.



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

| Wirtschaftssektoren - BICS  | In % der Vermögenswerte |
|-----------------------------|-------------------------|
| INDUSTRIE                   | 23,6                    |
| ZYKLISCHE KONSUMGÜTER       | 21,9                    |
| NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 19,5                    |
| FINANZWERTEN                | 17,2                    |
| TECHNOLOGIE                 | 9,3                     |
| KOMMUNIKATION               | 6,7                     |
| GRUNDSTOFFE                 | 1,8                     |

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Bei-trag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätig-keiten** sind Tätig-keiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alter-nativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

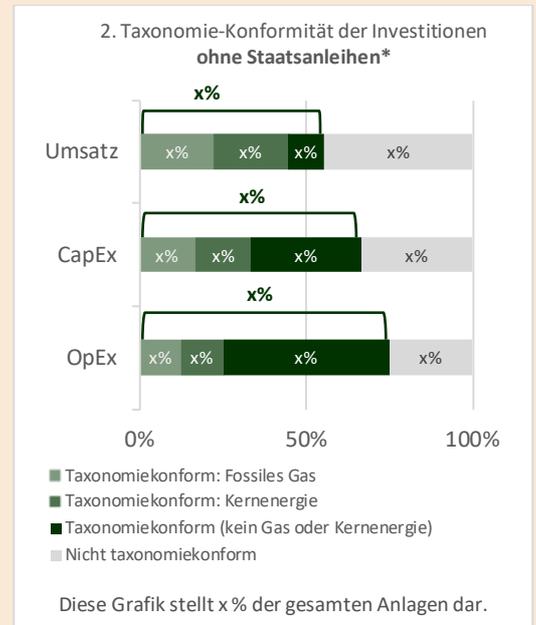
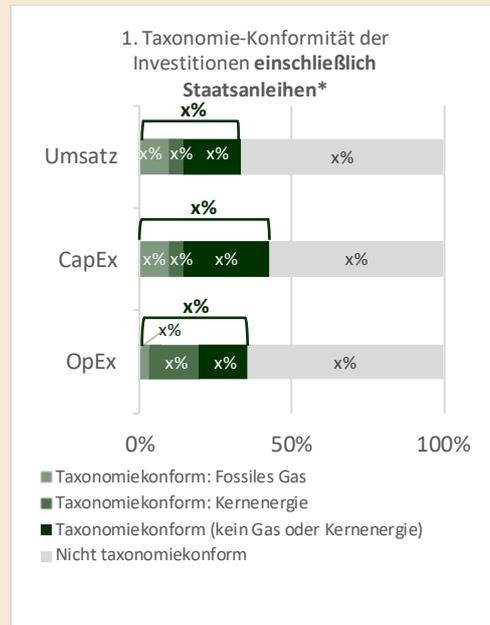
- Ja:  
 In fossiles Gas  In Kernenergie
- Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten 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 Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. 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.



\* 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?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



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 nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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

„Andere Investitionen“ umfasst die übrigen Investitionen des Portfolios, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren noch als nachhaltige Investitionen eingestuft wurden.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### **I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:**

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) die hausinterne NB-ESG-Bewertung sowie Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Für Belange der ökologischen und sozialen Verantwortlichkeit verfolgte der Sub-Investment-Manager über die hausinterne NB-ESG-Bewertung einen Top-down-Ansatz. Die hausinterne NB-ESG-Bewertung nutzte die Wesentlichkeitsmatrix von NB, um diejenigen Nachhaltigkeitsfaktoren zu identifizieren, die eine wesentliche Auswirkung auf die Nachhaltigkeit des Unternehmens gehabt haben könnten. Anschließend analysierte der Sub-Investment-Manager diese Belange im Hinblick auf das Geschäftsmodell, die Wertschöpfungskette, die Wachstumsphase des jeweiligen Unternehmens und dessen Wettbewerbsposition, um vorrangige Probleme zu identifizieren, die umgehend angegangen werden mussten. Dies geschah anhand von Recherchen vor Ort, bei der über mehrere Jahre öffentlich zugängliche Unternehmensinformationen durchforstet wurden, sowie Gesprächen mit dem Unternehmen, Konkurrenten, Lieferanten, Kunden und externen Researchanbietern, sofern durchführbar.

### **II. Mitwirkung:**

Der Sub-Investment-Manager arbeitete mit den Unternehmen mit einem soliden ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses.

Sobald das Portfolio in ein Unternehmen investiert hat, setzt der Sub-Investment-Manager ein Mitwirkungsziel und eine individuelle Strategie fest, um die im Rahmen des Bewertungsprozesses identifizierten wesentlichen Belange finanzieller Art anzugehen. Die Zusammenarbeit des Sub-Investment-Managers mit Portfoliobeständen zielte darauf ab, diesen Unternehmen zu helfen, ein langfristiges Wachstum zu generieren. Als langfristiger Anleger mit Fokus auf die Bottom-up-Aktienauswahl war der Sub-Investment-Manager der Ansicht, dass er mittels eines tiefgreifenden Dialogs über das Kapitalmanagement, Umwelt- und Sozialthemen von

finanzieller Wesentlichkeit sowie die Corporate Governance das jeweilige Unternehmen dabei unterstützte, ein langfristiges Wachstumsprofil aufrechtzuerhalten, was letztlich einen Performancebeitrag für das Portfolio leistete. Die Erfahrung des Sub-Investment-Managers bei der Zusammenarbeit mit Unternehmen zeigt, dass kleinere Unternehmen mehr Zeit und Ressourcen zur Bewältigung dieser Themen in Anspruch nehmen (im Durchschnitt zwei bis drei Jahre für Umwelt- und Sozialthemen). In Anbetracht dieses relativ langwierigen Prozesses führte der Sub-Investment-Manager ein System der Meilensteine ein, um sicherzustellen, dass die Mitwirkung weiterhin das gewünschte Ziel erbringt.

III. ESG-Sektor-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



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

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k.A.
- **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?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k.A.

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

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Next Generation Connectivity (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300H0HOXG52ES7840

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser 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?

**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 einen Anteil von 49,0 %\*\* 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**

\*Im Bezugszeitraum wurde der Neuberger Berman 5G Connectivity Fund in Neuberger Berman Next Generation Connectivity Fund umbenannt.

\*\*Weitere Einzelheiten zur Vermögensallokation des Portfolios (einschließlich des Engagements in nachhaltige Investitionen) finden Sie unter der Frage „Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?“

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie hier.

Sofem in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen,

die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Klimarisiken, THG-Emissionen, Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Wasserbewirtschaftung, Energiemanagement, Abfallentsorgung, Kraftstoffeffizienz, Gelegenheiten für saubere Technologien, Management des Produktlebenszyklus, Materialbeschaffung und Chemikaliensicherheit.
- **Soziale Merkmale:** Betriebssicherheit und Krisenvorsorge, Zugang zu Finanzmitteln, Zugang zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen im Gemeinwesen, Datenschutz und -sicherheit, Gesundheit und Ernährung, Preistransparenz, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Vielfalt und Integration in der Belegschaft, Geschäftsethik, Produktsicherheit, -qualität und -integrität, Management systemischer Risiken, Management des Rechts- und Regulierungsumfelds und Lieferkettenmanagement.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Daten Dritter und das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „NB-ESG-Quotient“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB China ESG Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („NB“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analyistenteam für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Unternehmen wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss. Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes NB-ESG-Quotient- oder externes Rating aufweisen, um im Laufe der Zeit eine Verbesserung der zugrunde liegenden

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

ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachten) zu erreichen.

| Bezugszeitraum    | Rating          | Bereich           | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|-----------------|-------------------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient   | ES: B<br>G: 2,4 | ES: A-D<br>G: 1-4 | 100 %                 |
| Daten von Dritten | 6,8             | 0-10              |                       |

Im Hinblick auf das NB-ESG-Quotient-Rating für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale („ES“) werden die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance („G“) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jedes im Portfolio gehaltene Unternehmen erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums erfasste Climate Value-at-Risk („CVaR“) das Ausmaß der Risiken und der Chancen des Klimaübergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmen.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

|  |        |
|--|--------|
| Der CVaR prognostizierte, dass ein Szenario der Klimaerwärmung beim verwalteten Vermögen im Bezugszeitraum zu folgendem Wertverlust führen könnte. | -8,1 % |
| CVaR-Abdeckung im Bezugszeitraum.  | 94 %   |

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Suv-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

### 3. ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy, die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy und die sonstigen spezifischen Ausschlüsse identifiziert wurden, die im SFDR-Anhang des Portfolios angegeben sind, oder nicht mit diesen vereinbar waren. Zudem investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

#### Sonstiges

Im Bezugszeitraum brachte das Portfolio die Neuberger Berman Enhanced Sustainable Exclusion Policy nicht zur Anwendung.

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

Ausnahmsweise wurden für den Bezugszeitraum 2022 die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgte (sie umfassen die Veröffentlichung der SFDR-Vorlagen für vorvertragliche Informationen).

### 1. NB-ESG-Quotient

|                            | <b>NB-ESG-Quotient-Rating</b> | <b>Rating der Daten durch externe Anbieter</b> | <b>Kombinierte Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| <b>Bereich</b>             | ES: A-D<br>G: 1-4             | 0-10   | 0-100 %                      |
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | ES: B<br>G: 2,7               | 6,5  | 100 %                        |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | ES: B<br>G: 2,5               | 6,8  | 96 %                         |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | ES: B<br>G: 2,4               | 6,8  | 100 %                        |

## 2. CvaR

|                            | <b>CVaR</b> | <b>Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------|------------------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | -2,6 %      | 97 %             |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | -6,1 %      | 96 %             |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | -8,1 %      | 94 %             |

## 3. Ausschlüsse

|                            | <b>Gesamtzahl der Verstöße</b> |
|----------------------------|--------------------------------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 0                              |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 0                              |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 0                              |

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

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckte sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Anlage zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Anlage eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat, wie nachstehend erläutert, und (iii) auf eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die gute Unternehmensführung eines Unternehmens, um festzustellen, ob das Unternehmen einer derartigen Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griff der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die Wirtschaftstätigkeit eines Unternehmens auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren.

Der Sub-Investment-Manager überprüfte die Unternehmen auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Unternehmen dieser Prüfung standhielten, quantifizierte der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag der Unternehmen zur Wirtschaft.

Der Sub-Investment-Manager erfasste dies auf drei Arten:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden);
- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDGs“) und
- Unternehmen aus Sektoren mit großen Auswirkungen, die sich auf der Grundlage des NB Net-Zero Alignment Indicator auf einen Netto-Null-Kurs umstellen.

Im Bezugszeitraum aktualisierte der Sub-Investment Manager den SFDR-Anhang des Portfolios, um dem Umstand Rechnung zu tragen, dass der Sub-Investment Manager bei der Ermittlung nachhaltiger Investitionen Unternehmen aus Sektoren mit großen Auswirkungen berücksichtigt, die sich auf der Grundlage des NB Net-Zero Alignment Indicator auf einen Netto-Null-Kurs umstellen.

Die Beurteilung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs wurde durch die Verfügbarkeit von angemessenen, verfügbaren und überprüfbaren Daten eingeschränkt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griff der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Proxydaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

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

Der Sub-Investment-Manager wandte seinen Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigten. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachtete der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele waren, die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (die „PAIs“):

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.

| PAIs                              |  |
|-----------------------------------|--|
| Thema                             | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen  |
| <i>Treibhausgasemissionen</i>     | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind<br>PAI 5 - Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen<br>PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren |
| <i>Biodiversität</i>              | PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken   |
| <i>Wasser</i>                     | PAI 8 - Emissionen in Wasser   |
| <i>Abfall</i>                     | PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle   |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen  |

PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen

PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle

PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen

PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Sub-Investment-Manager hat auch Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen berücksichtigt. Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

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

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, dass die ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen des Portfolios nicht erheblich beeinträchtigt wurden, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Unternehmen, die unter die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen;
- Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Unternehmen, die unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

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

Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*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 EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

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

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



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

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Unternehmen durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

1. Wie oben unter „*Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?*“ erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele führten, alle PAIs berücksichtigt.
2. Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

| <b>PAIs auf Produktebene</b>      |  |
|-----------------------------------|--|
| <b>Thema</b>                      | <b>Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen</b>   |
| <i>Treibhausgasemissionen</i>     | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind  |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen<br>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen<br>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbar Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2024 – 31. Dezember 2024

Der Sub-Investment-Manager hat den Bloomberg Industry Classification Standard („BICS“) verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2024 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

| Größte Investitionen           | Sektor        | In % der Vermögenswerte | Land            |
|--------------------------------|---------------|-------------------------|-----------------|
| NVIDIA CORP                    | TECHNOLOGIE   | 5,4                     | USA             |
| AMAZON.COM INC                 | KOMMUNIKATION | 5,0                     | USA             |
| TAIWAN SEMICONDUCTOR MAN /TWD/ | TECHNOLOGIE   | 4,6                     | TAIWAN          |
| META PLATFORMS INC-CLASS A     | KOMMUNIKATION | 4,1                     | USA             |
| BROADCOM INC                   | TECHNOLOGIE   | 3,7                     | USA             |
| SK HYNIX INC /KRW/             | TECHNOLOGIE   | 3,2                     | KOREA           |
| MICROSOFT CORP                 | TECHNOLOGIE   | 3,2                     | USA             |
| T-MOBILE US INC                | KOMMUNIKATION | 2,8                     | USA             |
| HON HAI PRECISION INDUST /TWD/ | INDUSTRIE     | 2,3                     | TAIWAN          |
| ADVANCED MICRO DEVICES         | TECHNOLOGIE   | 2,2                     | USA             |
| ARISTA NETWORKS INC            | KOMMUNIKATION | 2,2                     | USA             |
| ARM HOLDINGS PLC-ADR           | TECHNOLOGIE   | 2,1                     | GROSSBRITANNIEN |
| QUALCOMM INC                   | TECHNOLOGIE   | 2,1                     | USA             |
| MEDIATEK INC /TWD/             | TECHNOLOGIE   | 2,0                     | TAIWAN          |
| ADVANTEST CORP /JPY/           | TECHNOLOGIE   | 2,0                     | JAPAN           |

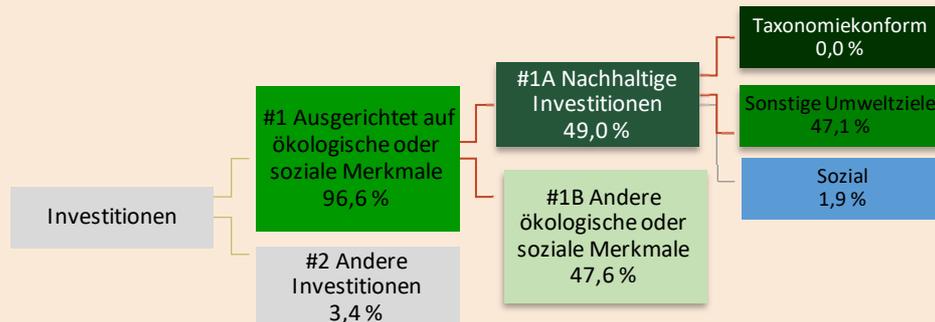


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Vermögensallokation des Portfolios im Bezugszeitraum wird in nachstehender Grafik dargestellt. Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder externen Anbietern beruhen.



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

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

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige** Investitionen umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.

- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

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

| Wirtschaftssektoren - BICS  | In % der Vermögenswerte |
|-----------------------------|-------------------------|
| TECHNOLOGIE                 | 63,4                    |
| KOMMUNIKATION               | 21,6                    |
| INDUSTRIE                   | 10,1                    |
| NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 3,6                     |
| ZYKLISCHE KONSUMGÜTER       | 1,3                     |



## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere

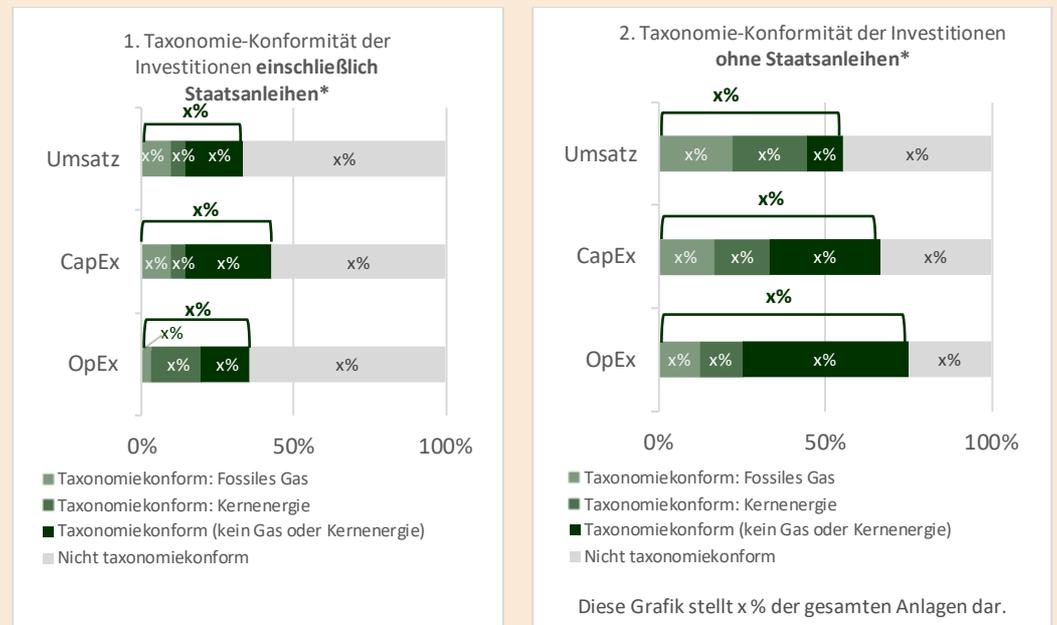
Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten 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 Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

- Ja:
- In fossiles Gas  In Kernenergie
- Nein

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. 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.



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

<sup>1</sup> ang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des (') beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der ) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



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 nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Dies ist in der Grafik zur Vermögensallokation unter der Frage „Wie sah die Vermögensallokation aus?“ oben angegeben.



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

Dies ist in der Grafik zur Vermögensallokation unter der Frage „Wie sah die Vermögensallokation aus?“ oben angegeben.



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

„Andere Investitionen“ umfasst die übrigen Investitionen des Portfolios, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren noch als nachhaltige Investitionen eingestuft wurden.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten sowie Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das externe Rating oder das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung eines Unternehmens besser zu erkennen, wobei der Schwerpunkt des Portfolios auf Investitionen in Unternehmen lag, die sich an der Entwicklung und Verbesserung der Konnektivität der nächsten Generation beteiligen.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die thematische Beurteilung und die Gesamtbeurteilung des Unternehmens bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

### II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager arbeitete mit den Unternehmen mit einem soliden ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. ESG-Sektor-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



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

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***  
k.A.
- ***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?***  
k.A.
- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***  
k.A.
- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***  
k.A.

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

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Next Generation Mobility Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 5493000YD3J3W1CMMU74

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser 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?

**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 53,5 %\* 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**

\*Weitere Einzelheiten zur Vermögensallokation des Portfolios (einschließlich des Engagements in nachhaltigen Investitionen) finden Sie unter der Frage „*Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?*“.

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Sofem in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Klimarisiken, THG-Emissionen, Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Wasserbewirtschaftung, Energiemanagement, Abfallentsorgung, Kraftstoffeffizienz, Gelegenheiten für saubere Technologien, Management des Produktlebenszyklus, Materialbeschaffung und Chemikaliensicherheit.
- **Soziale Merkmale:** Betriebssicherheit und Krisenvorsorge, Zugang zu Finanzmitteln, Zugang zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen im Gemeinwesen, Datenschutz und -sicherheit, Gesundheit und Ernährung, Preistransparenz, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Vielfalt und Integration in der Belegschaft, Geschäftsethik, Produktsicherheit, -qualität und -integrität, Management systemischer Risiken, Management des Rechts- und Regulierungsumfelds und Lieferkettenmanagement.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Investitionen) im Sinne der EU-Taxonomie

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Daten Dritter und das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB-ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB China ESG Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**NB**“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sekorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Unternehmen wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss. Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes NB-ESG-Quotient- oder externes Rating aufweisen, um im Laufe der Zeit eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachten) zu erreichen.

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

| Bezugszeitraum    | Rating          | Bereich           | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|-----------------|-------------------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient   | ES: B<br>G: 2,6 | ES: A-D<br>G: 1-4 | 98 %                  |
| Daten von Dritten | 6,9             | 0-10              |                       |

Im Hinblick auf das NB-ESG-Quotient-Rating für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale („ES“) werden die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance („G“) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jedes im Portfolio gehaltene Unternehmen erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums erfasste Climate Value-at-Risk („CVaR“) das Ausmaß der Risiken und der Chancen des Klimaübergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmen.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

|  |        |
|--|--------|
| Der CVaR prognostizierte, dass ein Szenario der Klimaerwärmung beim verwalteten Vermögen im Bezugszeitraum zu folgendem Wertverlust führen könnte. | -2,8 % |
| CVaR-Abdeckung im Bezugszeitraum.  | 95 %   |

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Suv-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy, die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy und die sonstigen spezifischen Ausschlüsse identifiziert wurden, die im SFDR-Anhang des Portfolios angegeben sind, oder nicht mit diesen vereinbar waren. Zudem investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

Sonstiges

Im Bezugszeitraum brachte das Portfolio die Neuberger Berman Enhanced Sustainable Exclusion Policy nicht zur Anwendung.

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

Ausnahmsweise wurden für den Bezugszeitraum 2022 die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgte (sie umfassen die Veröffentlichung der SFDR-Vorlagen für vorvertragliche Informationen).

1. NB-ESG-Quotient

|                            | <b>NB-ESG-Quotient-Rating</b> | <b>Rating der Daten durch externe Anbieter</b> | <b>Kombinierte Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| <b>Bereich</b>             | ES: A-D<br>G:1- 4             | 0-10   | 0-100 %                      |
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | ES: B<br>G: 2,2               | 6,7  | 99 %                         |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | ES: B<br>G:2.3                | 7,1  | 93 %                         |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | ES: B<br>G: 2,6               | 6,9  | 98 %                         |

## 2. CVaR

|                            | CVaR   | Abdeckung |
|----------------------------|--------|-----------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | -3,6 % | 93 %      |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | -5,0 % | 92 %      |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | -2,8 % | 95 %      |

## 3. Ausschlüsse

|                            | Gesamtzahl der Verstöße |
|----------------------------|-------------------------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 0                       |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 0                       |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 0                       |

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

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckte sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Anlage zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Anlage eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat, wie nachstehend erläutert, und (iii) auf eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die gute Unternehmensführung eines Unternehmens, um festzustellen, ob das Unternehmen einer derartigen Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griff der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die Wirtschaftstätigkeit eines Unternehmens auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren.

Der Sub-Investment-Manager überprüfte die Unternehmen auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Unternehmen dieser Prüfung standhielten, quantifizierte der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag der Unternehmen zur Wirtschaft.

Der Sub-Investment-Manager erfasste dies auf drei Arten:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden);
- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDGs“) und
- Unternehmen in Sektoren mit großen Auswirkungen, die sich auf der Grundlage des NB Net-Zero Alignment Indicator auf einen Netto-Null-Kurs umstellen.

Im Bezugszeitraum aktualisierte der Sub-Investment Manager den SFDR-Anhang des Portfolios, um dem Umstand Rechnung zu tragen, dass der Sub-Investment Manager bei der Ermittlung nachhaltiger Investitionen Unternehmen aus Sektoren mit großen Auswirkungen

berücksichtigt, die sich auf der Grundlage des NB Net-Zero Alignment Indicator auf einen Netto-Null-Kurs umstellen.

Die Beurteilung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs wurde durch die Verfügbarkeit von angemessenen, verfügbaren und überprüfbaren Daten eingeschränkt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griff der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Proxydaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

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

Der Sub-Investment-Manager wandte seinen Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigten. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachtete der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele waren, die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (die „PAIs“):

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.

| PAIs                              |  |
|-----------------------------------|--|
| Thema                             | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen  |
| <i>Treibhausgasemissionen</i>     | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind<br>PAI 5 - Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen<br>PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren   |
| <i>Biodiversität</i>              | PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken   |
| <i>Wasser</i>                     | PAI 8 - Emissionen in Wasser   |
| <i>Abfall</i>                     | PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle   |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen<br>PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen<br>PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle<br>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen |

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Sub-Investment-Manager hat auch Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen berücksichtigt. Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

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

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, dass die ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen des Portfolios nicht erheblich beeinträchtigt wurden, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Unternehmen, die unter die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen;
- Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Unternehmen, die unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

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

Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*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 EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



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

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Unternehmen durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

- i. *Wie oben unter „Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?“ erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele führten, alle PAIs berücksichtigt.*
- ii. *Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „PAIs auf Produktebene“):*

| PAIs auf Produktebene         |   |
|-------------------------------|---|
| Thema                         | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen   |
| <i>Treibhausgasemissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |

|                                   |   |
|-----------------------------------|---|
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen |
|                                   | PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen  |
|                                   | PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat den Bloomberg Industry Classification Standard („**BICS**“) verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2024 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2024 – 31. Dezember 2024

| Größte Investitionen           | Sektor                | In % der Vermögenswerte | Land        |
|--------------------------------|-----------------------|-------------------------|-------------|
| KIA CORP /KRW/                 | ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 4,4                     | KOREA       |
| HITACHI LTD /JPY/              | INDUSTRIE             | 3,9                     | JAPAN       |
| APPLIED MATERIALS INC          | TECHNOLOGIE           | 3,7                     | USA         |
| ASML HOLDING NV-NY REG SHS     | TECHNOLOGIE           | 3,6                     | NIEDERLANDE |
| AMPHENOL CORP-CL A             | INDUSTRIE             | 3,6                     | USA         |
| NVIDIA CORP                    | TECHNOLOGIE           | 3,5                     | USA         |
| MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC   | TECHNOLOGIE           | 3,3                     | USA         |
| TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR    | TECHNOLOGIE           | 3,1                     | TAIWAN      |
| ON SEMICONDUCTOR               | TECHNOLOGIE           | 3,0                     | USA         |
| FERRARI NV /EUR/               | ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 3,0                     | ITALIEN     |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG /EUR/ | TECHNOLOGIE           | 2,9                     | DEUTSCHLAND |
| CADENCE DESIGN SYS INC         | TECHNOLOGIE           | 2,8                     | USA         |

|                                |                          |     |            |
|--------------------------------|--------------------------|-----|------------|
| BYD CO LTD-H /HKD/             | ZYKLISCHE<br>KONSUMGÜTER | 2,7 | CHINA      |
| CONTEMPORARY AMPEREX TEC /CNH/ | ZYKLISCHE<br>KONSUMGÜTER | 2,5 | CHINA      |
| SCHNEIDER ELEC SA /EUR/        | INDUSTRIE                | 2,4 | FRANKREICH |

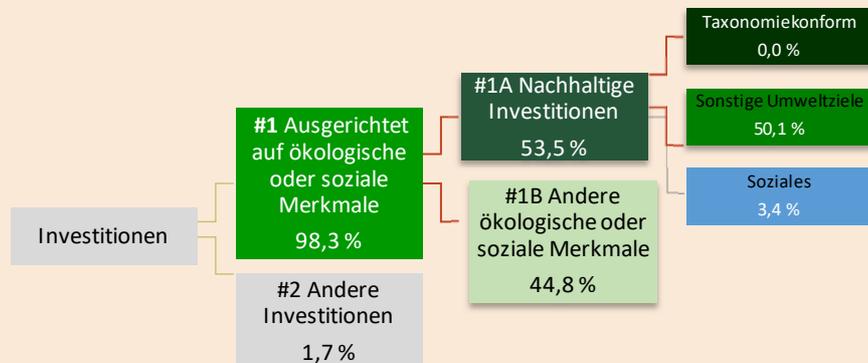


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Vermögensallokation des Portfolios im Bezugszeitraum wird in nachstehender Grafik dargestellt. Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder externen Anbietern beruhen.



**#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.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.

- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

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

| <b>Wirtschaftssektoren - BICS</b> | <b>In % der Vermögenswerte</b> |
|-----------------------------------|--------------------------------|
| TECHNOLOGIE                       | 46,0                           |
| INDUSTRIE                         | 25,7                           |
| ZYKLISCHE KONSUMGÜTER             | 19,0                           |
| KOMMUNIKATION                     | 4,9                            |
| GRUNDSTOFFE                       | 4,4                            |



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

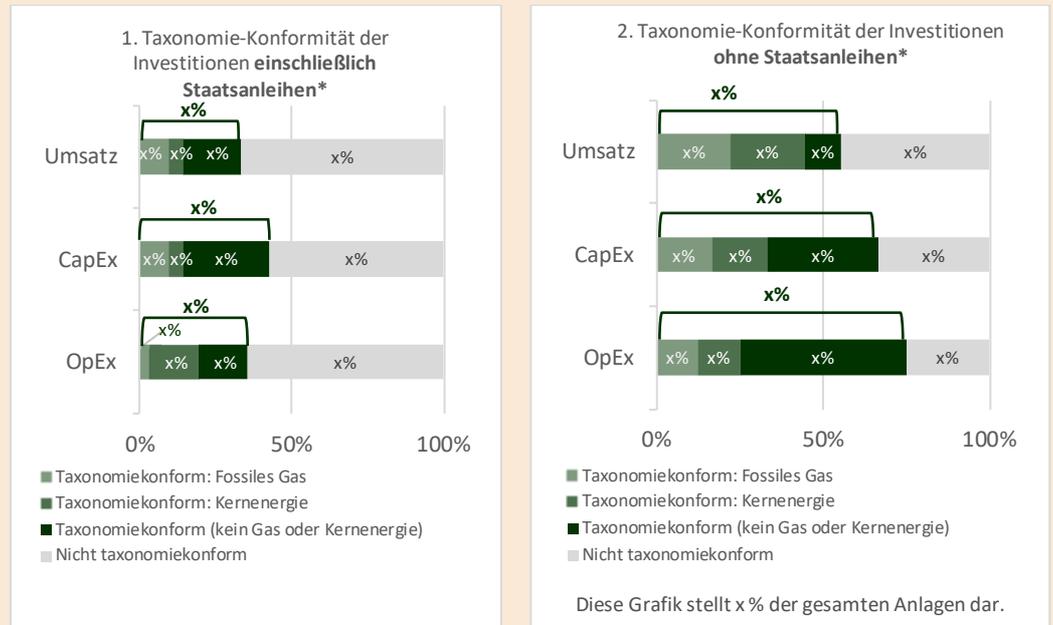
- Ja:  
 In fossiles Gas  In Kernenergie
- Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten 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 Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* 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?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



## Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Dies ist in der Grafik zur Vermögensallokation unter der Frage „Wie sah die Vermögensallokation aus?“ oben angegeben.



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?

Dies ist in der Grafik zur Vermögensallokation unter der Frage „Wie sah die Vermögensallokation aus?“ oben angegeben.



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

„Andere Investitionen“ umfasst die übrigen Investitionen des Portfolios, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren noch als nachhaltige Investitionen eingestuft wurden.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

ESG-Merkmale werden auf drei verschiedenen Ebenen berücksichtigt:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten sowie Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das externe oder NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung eines Unternehmens besser zu erkennen, wobei darauf hingewiesen wird, dass der Schwerpunkt des Portfolios auf Investitionen in Unternehmen liegt, welche die Entwicklung des Themas „Next Generation Mobility“ fördern.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die thematische Beurteilung und die Gesamtbeurteilung des Unternehmens bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

### II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager arbeitete mit den Unternehmen mit einem soliden ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### III. ESG-Sektor-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k.A.
- **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?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k.A.

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

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Next Generation Space Economy Fund (das „Portfolio“)  
**Unternehmenskennung:** 549300FT24ZYHNJCVO63

## 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 27,6 %\* 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**

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser 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.

\*Weitere Einzelheiten zur Vermögensallokation des Portfolios (einschließlich des Engagements in nachhaltige Investitionen) finden Sie unter der Frage „*Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?*“

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Sofem in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Klimarisiken, THG-Emissionen, Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Wasserbewirtschaftung, Energiemanagement, Abfallentsorgung, Kraftstoffeffizienz, Gelegenheiten für saubere Technologien, Management des Produktlebenszyklus, Materialbeschaffung und Chemikaliensicherheit.
- **Soziale Merkmale:** Betriebssicherheit und Krisenvorsorge, Zugang zu Finanzmitteln, Zugang zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen im Gemeinwesen, Datenschutz und -sicherheit, Gesundheit und Ernährung, Preistransparenz, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Vielfalt und Integration in der Belegschaft, Geschäftsethik, Produktsicherheit, -qualität und -integrität, Management systemischer Risiken, Management des Rechts- und Regulierungsumfelds und Lieferkettenmanagement.

Das Portfolio zielt auf Konformität mit einem Netto-Null-Ziel ab, wie im SFDR-Anhang und im Abschnitt „Nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten“ im Prospekt ausführlicher beschrieben.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und werden im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

### ● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB China ESG Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**NB**“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analyistenteam für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Unternehmen wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss. Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Unternehmen

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

ein, die ein schlechtes NB-ESG-Quotient- oder externes Rating aufweisen, um im Laufe der Zeit eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachen) zu erreichen.

| Bezugszeitraum    | Rating          | Bereich           | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|-----------------|-------------------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient   | ES: B<br>G: 2,6 | ES: A-D<br>G: 1-4 | 99 %                  |
| Daten von Dritten | 6,6             | 0-10              |                       |

Im Hinblick auf die NB-ESG-Quotient-Ratings der Aktienemittenten werden für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale (ES) die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance („G“) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jedes im Portfolio gehaltene Unternehmen erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums erfasste Climate Value-at-Risk („**CVaR**“) das Ausmaß der Risiken und der Chancen des Klimaübergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmen.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

|  |        |
|--|--------|
| Der CVaR prognostizierte, dass ein Szenario der Klimaerwärmung beim verwalteten Vermögen im Bezugszeitraum zu folgendem Wertverlust führen könnte. | -7,9 % |
| CVaR-Abdeckung im Bezugszeitraum.  | 91 %   |

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy, die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy und die sonstigen spezifischen Ausschlüsse identifiziert wurden, die im SFDR-Anhang des Portfolios angegeben sind, oder nicht mit diesen vereinbar waren. Zudem investierte das Portfolio nicht mehr in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

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

Ausnahmsweise wurden für den Bezugszeitraum 2022 die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgte (sie umfassen die Veröffentlichung der SFDR-Vorlagen für vorvertragliche Informationen).

1. NB-ESG-Quotient

|                            | <b>NB-ESG-Quotient-Rating</b> | <b>Rating der Daten durch externe Anbieter</b> | <b>Kombinierte Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| <b>Bereich</b>             | ES: A-D<br>G: 1-4             | 0-10   | 0-100 %                      |
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | ES: B<br>G: 2,7               | 6,2  | 97 %                         |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | ES: B<br>G: 2,6               | 6,5  | 95 %                         |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | ES: B<br>G: 2,6               | 6,6  | 99 %                         |

2. CVaR

|                            | <b>CVaR</b> | <b>Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------|------------------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | -4,0 %      | 82 %             |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | -7,1 %      | 94 %             |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | -7,9 %      | 91 %             |

### 3. Ausschlüsse

|                     | Gesamtzahl der Verstöße |
|---------------------|-------------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | 0                       |
| Bezugszeitraum 2023 | 0                       |
| Bezugszeitraum 2024 | 0                       |

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?**

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckte sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Anlage zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Anlage eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat, wie nachstehend erläutert, und (iii) auf eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die gute Unternehmensführung eines Unternehmens, um festzustellen, ob das Unternehmen einer derartigen Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griff der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die Wirtschaftstätigkeit eines Unternehmens auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren.

Der Sub-Investment-Manager überprüfte die Unternehmen auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Unternehmen dieser Prüfung standhielten, quantifizierte der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag der Unternehmen zur Wirtschaft.

Der Sub-Investment-Manager erfasste dies auf drei Arten:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden);
- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDGs“) und
- Unternehmen aus Sektoren mit großen Auswirkungen, die sich auf der Grundlage des NB Net-Zero Alignment Indicator auf einen Netto-Null-Kurs umstellen.

Im Bezugszeitraum aktualisierte der Sub-Investment Manager den SFDR-Anhang des Portfolios, um dem Umstand Rechnung zu tragen, dass der Sub-Investment Manager bei der Ermittlung nachhaltiger Investitionen Unternehmen aus Sektoren mit großen Auswirkungen berücksichtigt, die sich auf der Grundlage des NB Net-Zero Alignment Indicator auf einen Netto-Null-Kurs umstellen.

Die Beurteilung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs wurde durch die Verfügbarkeit von angemessenen, verfügbaren und überprüfbaren Daten eingeschränkt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griff der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Proxydaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

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

Der Sub-Investment-Manager wandte seinen Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigten. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachtete der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele waren, die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (die „PAIs“):

| PAIs                              |   |
|-----------------------------------|---|
| Thema                             | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen   |
| <i>Treibhausgasemissionen</i>     | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind<br>PAI 5 - Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen<br>PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren  |
| <i>Biodiversität</i>              | PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken  |
| <i>Wasser</i>                     | PAI 8 - Emissionen in Wasser  |
| <i>Abfall</i>                     | PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle  |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen<br>PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen<br>PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle<br>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen<br>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Sub-Investment-Manager hat auch Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen berücksichtigt. Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

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

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, dass die ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen des Portfolios nicht erheblich beeinträchtigt wurden, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Unternehmen, die unter die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen;
- Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Unternehmen, die unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

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

Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*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 EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

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

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



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

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Unternehmen durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

1. Wie oben unter „*Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?*“ erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele führten, alle PAIs berücksichtigt.
2. Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

| PAIs auf Produktebene             |  |
|-----------------------------------|--|
| Thema                             | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen  |
| <i>Treibhausgasemissionen</i>     | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind  |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen<br>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen<br>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und

- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat den Bloomberg Industry Classification Standard („**BICS**“) verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2024 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2024 – 31. Dezember 2024

| Größte Investitionen           | Sektor        | In % der Vermögenswerte | Land            |
|--------------------------------|---------------|-------------------------|-----------------|
| ROCKET LAB USA INC             | INDUSTRIE     | 5,8                     | USA             |
| QUALCOMM INC                   | TECHNOLOGIE   | 3,3                     | USA             |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN       | INDUSTRIE     | 3,3                     | USA             |
| AIRBUS SE /EUR/                | INDUSTRIE     | 3,1                     | FRANKREICH      |
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC      | INDUSTRIE     | 3,1                     | USA             |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC         | KOMMUNIKATION | 3,1                     | USA             |
| SINGAPORE TECH ENGINEERI /SGD/ | INDUSTRIE     | 3,1                     | SINGAPUR        |
| MITSUBISHI HEAVY INDUSTR /JPY/ | INDUSTRIE     | 3,1                     | JAPAN           |
| SAFRAN SA /EUR/                | INDUSTRIE     | 3,0                     | FRANKREICH      |
| BAE SYSTEMS PLC /GBP/          | INDUSTRIE     | 2,9                     | GROSSBRITANNIEN |
| NVIDIA CORP                    | TECHNOLOGIE   | 2,8                     | USA             |
| AMPHENOL CORP-CL A             | INDUSTRIE     | 2,7                     | USA             |
| TRANSDIGM GROUP INC            | INDUSTRIE     | 2,7                     | USA             |
| AMAZON.COM INC                 | KOMMUNIKATION | 2,7                     | USA             |
| ADVANCED MICRO DEVICES         | TECHNOLOGIE   | 2,6                     | USA             |



## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

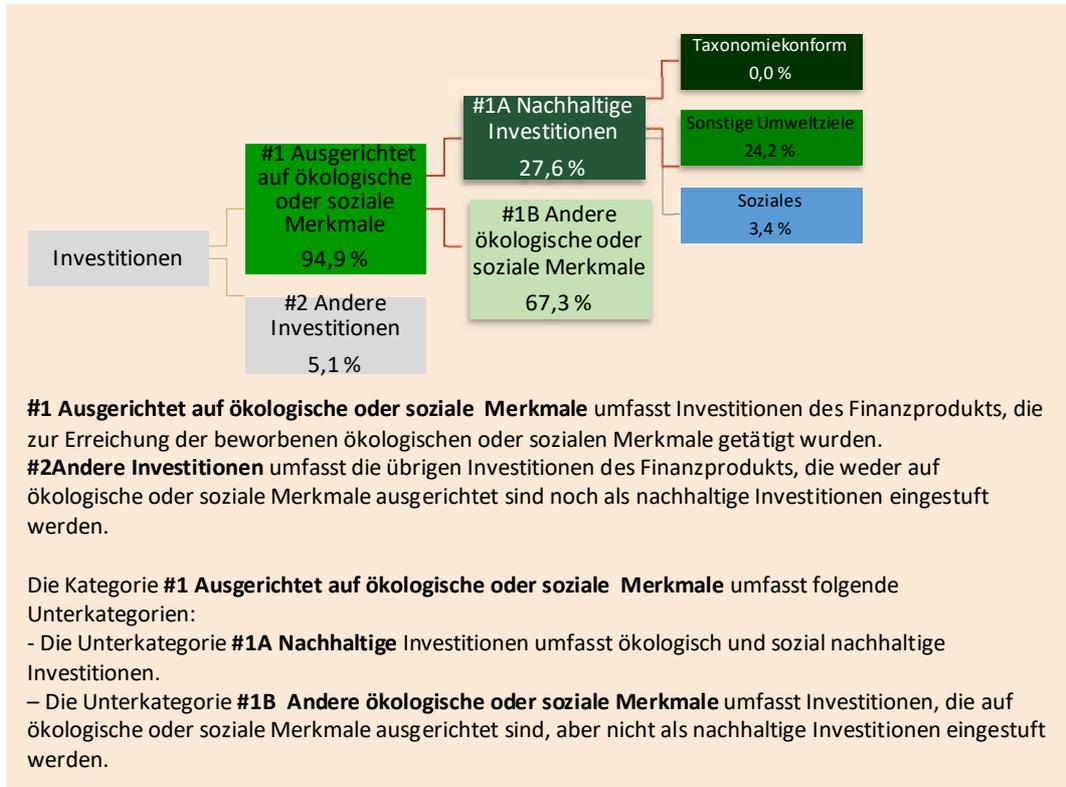
### ● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Die Vermögensallokation des Portfolios im Bezugszeitraum wird in nachstehender Grafik dargestellt. Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder externen Anbietern beruhen.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

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

**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



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

| Wirtschaftssektoren - BICS | In % der Vermögenswerte |
|----------------------------|-------------------------|
| INDUSTRIE                  | 55,7                    |
| TECHNOLOGIE                | 22,3                    |
| KOMMUNIKATION              | 17,5                    |
| GRUNDSTOFFE                | 2,9                     |
| FINANZWERTEN               | 1,6                     |



## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten 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 Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

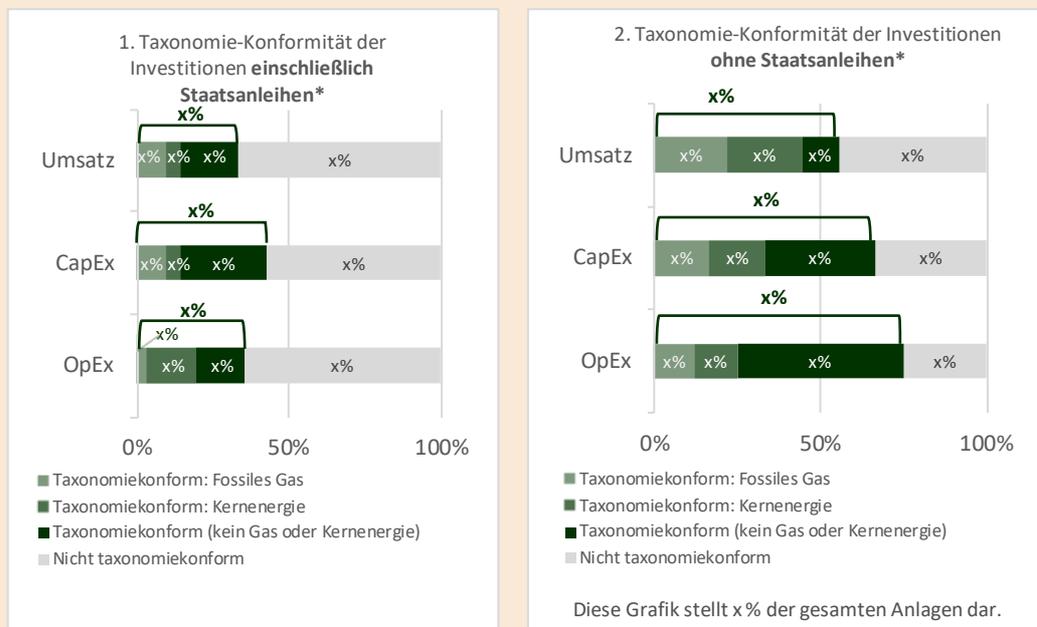
Nein



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

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. 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.



\* 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?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



**Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Dies ist in der Grafik zur Vermögensallokation unter der Frage „Wie sah die Vermögensallokation aus?“ oben angegeben.



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

Dies ist in der Grafik zur Vermögensallokation unter der Frage „Wie sah die Vermögensallokation aus?“ oben angegeben.



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

„Andere Investitionen“ umfasst die übrigen Investitionen des Portfolios, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren noch als nachhaltige Investitionen eingestuft wurden.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### **I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:**

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten sowie Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben

aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das externe oder NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung eines Unternehmens besser zu erkennen, wobei darauf hingewiesen wird, dass der Schwerpunkt des Portfolios auf Investitionen in Unternehmen liegt, welche die Entwicklung des Themas „Next Generation Space Economy“ fördern.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die thematische Beurteilung und die Gesamtbeurteilung des Unternehmens bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

## II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager arbeitete mit den Unternehmen mit einem soliden ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

## III. ESG-Sektor-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

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?**

k.A.

### ● **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?**

k.A.

### ● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

k.A.

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

k.A.

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300J30SXW5866TW70

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser 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?

**Ja**

**Nein**

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: \_\_\_%

Es wurden **damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 40.9 %\* 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**

\*Weitere Einzelheiten zum Mindestanteil nachhaltiger Investitionen, die ökologische oder soziale Merkmale bewerben, finden Sie unter der Frage „Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?“.

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Sofem in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio für staatliche Emittenten beworben:

- **Ökologische Merkmale:** staatliche Energieeffizienz, Anpassung an den Klimawandel, Entwaldung, Treibhausgasemissionen („THG“), Luft- und Haushaltsverschmutzung und unsichere sanitäre Einrichtungen.
- **Soziale Merkmale:** Fortschritte bei den UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung (Sustainable Development Goals, "SDGs"), Gesundheits- und Bildungsniveau, Qualität der Regulierung, politische Stabilität und Freiheiten, Gleichstellung der Geschlechter sowie Forschung und Entwicklung.

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio für Unternehmensemittenten beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und Landnutzung, Kohlenstoffemissionen, Gelegenheiten für saubere Technologien, Wasserstress, Schadstoffemissionen und Abfälle, Finanzierung von Umweltauswirkungen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck von Produkten, Umweltpolitik, Umweltmanagementsystem, Programme zur Reduzierung von THG-Emissionen, umweltfreundliche Beschaffungspolitik und Programme für treibhausfreie Luftemissionen.
- **Soziale Merkmale:** Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Schutz der Privatsphäre und Datensicherheit, Produktsicherheit und -qualität, Sicherheit von Finanzprodukten, Diskriminierungspolitik, Programme zur Einbindung der Gemeinschaft, Diversitätsprogramme und Menschenrechtspolitik.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

## Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses haben der Manager und der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „NB- ESG-Quotient“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für Länder und Unternehmenssektoren, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating abzuleiten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten den NB-ESG-Quotienten, um die aufgeführten ökologischen und sozialen Merkmale zu bewerten, indem sie primär in Wertpapiere von Emittenten mit einem relativ günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotienten-Rating investierten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Unternehmen wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Dementsprechend beschränkten der Manager und der Sub-Investment-Manager das Engagement in Emittenten mit dem schlechtesten NB-ESG-Quotienten-Rating, außer es bestand die begründete Erwartung, dass sich das NB-ESG-Quotienten-Rating im Laufe der Zeit verbessern würde.

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

| Bezugszeitraum           | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|--------------------------|--------|---------|-----------------------|
| <b>NB-ESG-Quotient</b>   | 56     | 1-100   | 99 %                  |
| <b>Daten von Dritten</b> | 4,5    | 0-10    |                       |

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

## 2. ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy und die sonstigen spezifischen Ausschlüsse identifiziert wurden, die im SFDR-Anhang des Portfolios angegeben sind, oder nicht mit diesen vereinbar waren. Zudem investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit dieser vereinbar waren), wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik auf das Portfolio haben der Manager und der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik verstoßen. Wo möglich haben der Manager und der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise ihrer Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager erörterten und diskutierten die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund ihres eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

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

Ausnahmsweise wurden für den Bezugszeitraum 2022 die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgte (sie umfassen die Veröffentlichung der SFDR-Vorlagen für vorvertragliche Informationen).

## 1. Der NB-ESG-Quotient

|                            | <b>NB-ESG-Quotient-Rating</b> | <b>Rating der Daten durch externe Anbieter</b> | <b>Kombinierte Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| <b>Bereich</b>             | 1-100                         | 0-10   | 0-100 %                      |
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 55                            | 4,2  | 95 %                         |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 56                            | 4,5  | 98 %                         |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 56                            | 4,5  | 99 %                         |

## 2. Ausschlüsse

|                            | <b>Gesamtzahl der Verstöße</b> |
|----------------------------|--------------------------------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 0                              |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 0                              |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 0                              |

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

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckt sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Investition zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Investition eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat (wie nachstehend erläutert) und (iii) eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die Unternehmensführung eines Emittenten, um festzustellen, ob der Emittent einer derartige Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griffen der Manager und der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die wirtschaftlichen Tätigkeiten eines Emittenten auf ökologische oder soziale Merkmalen ausgerichtet waren.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager überprüften die Emittenten auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Emittenten diese Prüfung bestanden haben, haben der Manager und der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag des Emittenten zur Wirtschaft gemessen.

Bei Unternehmensemittenten haben der Manager und der Sub-Investment-Manager dies auf drei Arten erfasst:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden);
- Ausrichtung der Umsätze auf die UN-Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDGs“) und
- Unternehmensemittenten in Sektoren mit großen Auswirkungen, die sich auf der Grundlage des NB Net-Zero Alignment Indicator auf einen Netto-Null-Kurs umstellen.

Im Bezugszeitraum aktualisierten der Manager und der Sub-Investment Manager den SFDR-Anhang des Portfolios, um dem Umstand Rechnung zu tragen, dass der Manager und der Sub-Investment Manager bei der Ermittlung nachhaltiger Investitionen Emittenten aus Sektoren mit großen Auswirkungen berücksichtigen, die sich auf der Grundlage des NB Net-Zero Alignment Indicator auf einen Netto-Null-Kurs umstellen.

Die Berücksichtigung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs, nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers, war durch die Verfügbarkeit von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbareren Daten begrenzt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griffen der Manager und der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Stellvertreterdaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

Bei staatlichen Emittenten haben der Manager und der Sub-Investment-Manager dies auf folgenden Arten erfasst:

- Fortschritte bei der Anpassung an den Klimawandel und dem Klimaschutz und
- Fortschritte bei der Erreichung der SDGs, mit Schwerpunkt auf Lebenserwartung und Bildung

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

Der Manager und der Sub-Investment-Manager wandten ihren Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigen. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachteten der Manager und der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Bei der Feststellung, ob die ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen des Portfolios nicht erheblich beeinträchtigt wurden, berücksichtigten der Manager und der Sub-Investment-Manager die in Teil 1 der nachstehenden Tabelle aufgeführten Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen für Unternehmensemittenten (die „**PAIs**“) und die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen für staatliche Emittenten (die „**staatlichen PAIs**“) wie nachfolgend in Teil 2 der Tabelle dargelegt:

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.

| <b>Teil 1 – PAIs</b>              |  |
|-----------------------------------|--|
| <b>Thema</b>                      | <b>Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen</b>   |
| <i>Treibhausgasemissionen</i>     | <p>PAI 1 - THG-Emissionen</p> <p>PAI 2 - CO<sub>2</sub>-Fußabdruck</p> <p>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird</p> <p>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind</p> <p>PAI 5 - Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen</p> <p>PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren</p>  |
| <i>Biodiversität</i>              | PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken   |
| <i>Wasser</i>                     | PAI 8 - Emissionen in Wasser   |
| <i>Abfall</i>                     | PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle   |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | <p>PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen</p> <p>PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen</p> <p>PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle</p> <p>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen</p> <p>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)</p> |
| <b>Teil 2 – staatliche PAIs</b>   |  |
| <i>Umwelt</i>                     | PAI 15 – THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird  |
| <i>Soziales</i>                   | PAI 16 - Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen  |

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager haben auch Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen berücksichtigt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager investierten nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

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

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Manager und den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, dass die ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen des Portfolios nicht erheblich beeinträchtigt wurden, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Emittenten, die quantitative und qualitative Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden, unterschreiten;
- Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Emittenten, wenn sie unter die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

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

Der Manager und der Sub-Investment-Manager investierten nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*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 EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



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

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager und den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigten PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

1. Wie oben unter „Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?“ erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele führten, alle PAIs und staatlichen PAIs berücksichtigt.
2. Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigten in Bezug auf die Nachhaltigkeitsfaktoren die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 1 der nachstehenden Tabelle für Unternehmensemittenten (die „**PAIs für Unternehmensemittenten**“), und die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 2 der nachstehenden Tabelle für staatliche Emittenten (die „**staatlichen PAIs**“) (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“) aufgeführt sind:

| Teil 1 – PAIs für Unternehmensemittenten |   |
|--|---|
| Thema                                    | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen   |
| <i>Treibhausgasemissionen</i>            | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |

|                                   |  |
|-----------------------------------|--|
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen<br>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen<br>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |
| <b>Teil 2 – staatliche PAIs</b>   |  |
| <i>Umwelt</i>                     | PAI 15 – THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird  |
| <i>Soziales</i>                   | PAI 16 - Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen  |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager und den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager und der Sub-Investment-Manager haben den Bloomberg Industry Classification Standard („BICS“) verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2024 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2024 – 31. Dezember 2024

| Größte Investitionen                | Sektor       | In % der Vermögenswerte | Land          |
|-------------------------------------|--------------|-------------------------|---------------|
| REPUBLIC OF COLOMBIA REGD           | STAATLICH    | 2,5                     | KOLUMBIEN     |
| IVORY COAST /EUR/ REGD REG S        | STAATLICH    | 1,5                     | COTE DIVOIRE  |
| REPUBLIC OF ANGOLA REGD REG S       | STAATLICH    | 1,5                     | ANGOLA        |
| REPUBLIC OF PANAMA REGD             | STAATLICH    | 1,4                     | PANAMA        |
| SOUTHERN GAS CORRIDOR REGD REG S    | ENERGIE      | 1,2                     | ASERBAIDSCHAN |
| REPUBLIC OF COLOMBIA REGD           | STAATLICH    | 1,2                     | KOLUMBIEN     |
| UNITED STATES TREASURY NOTE         | STAATLICH    | 1,1                     | USA           |
| COMISION FEDERAL DE ELEC REGD REG S | VERSORGUNG   | 1,1                     | MEXIKO        |
| PETROLEOS MEXICANOS REGD            | ENERGIE      | 1,1                     | MEXIKO        |
| YPF SOCIEDAD ANONIM REGD REG S      | ENERGIE      | 1,1                     | ARGENTINIEN   |
| ROMANIA /EUR/ REGD REG S EMTN       | STAATLICH    | 1,1                     | RUMÄNIEN      |
| REPUBLIC OF ARGENTINA REGD S/UP     | STAATLICH    | 1,1                     | ARGENTINIEN   |
| QNB FINANCE LTD REGD REG S EMTN     | FINANZWERTEN | 1,0                     | KAIMANINSELN  |
| REPUBLIC OF PANAMA REGD             | STAATLICH    | 1,0                     | PANAMA        |
| KOREAREHABNRESOURCE REGD REG S      | STAATLICH    | 1,0                     | KOREA         |

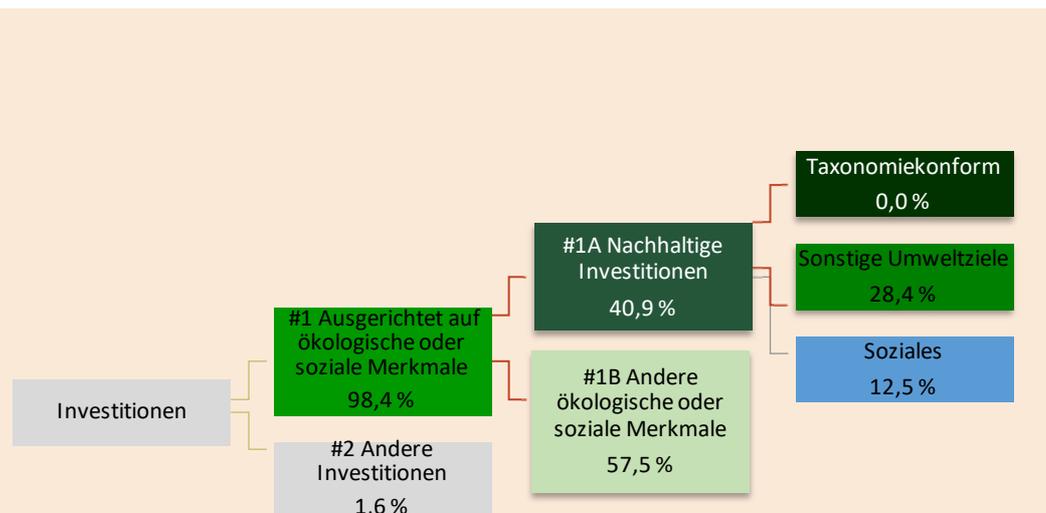


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Vermögensallokation des Portfolios im Bezugszeitraum wird in nachstehender Grafik dargestellt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager berechneten den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager und der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatten. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.



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

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

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige** Investitionen umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.

– Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

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

| Wirtschaftssektoren - BICS  | In % der Vermögenswerte |
|-----------------------------|-------------------------|
| STAATLICH                   | 39,2                    |
| FINANZWERTEN                | 31,8                    |
| ENERGIE                     | 13,0                    |
| VERSORGUNG                  | 3,8                     |
| GRUNDSTOFFE                 | 3,6                     |
| ZYKLISCHE KONSUMGÜTER       | 3,0                     |
| NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 2,6                     |
| INDUSTRIE                   | 1,6                     |
| KOMMUNIKATION               | 0,7                     |
| TECHNOLOGIE                 | 0,5                     |
| DIVERSIFIZIERT              | 0,2                     |



## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

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

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager können bestätigen, dass das Portfolio in Investitionen investiert hat, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Manager und der Sub-Investment-Manager werden das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

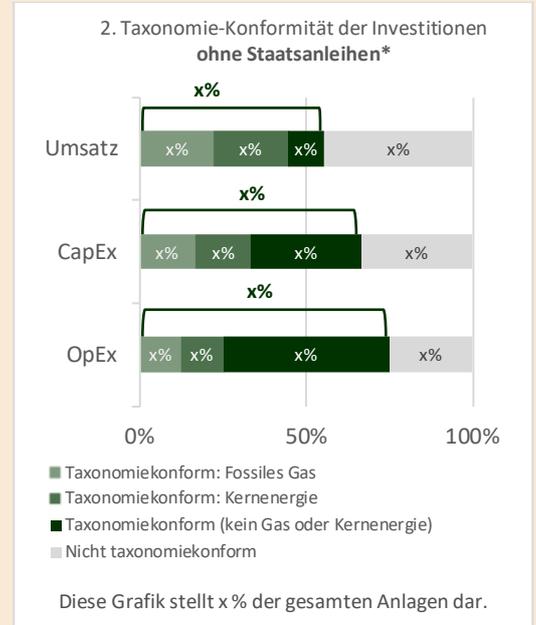
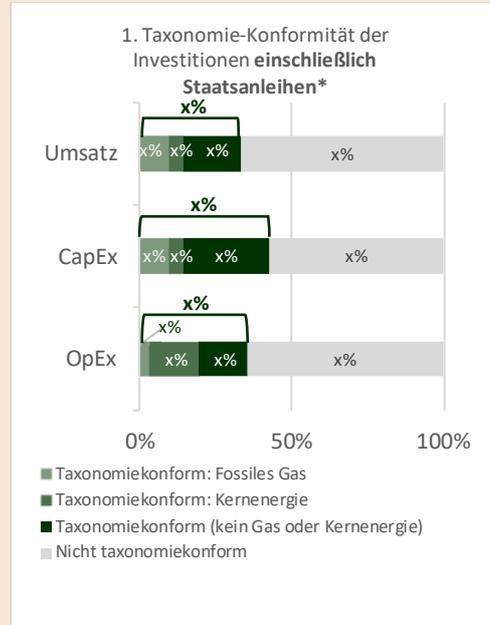
- Ja:  
 In fossiles Gas  In Kernenergie  
 Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten 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 Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* 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?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



## Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Dies ist in der Grafik zur Vermögensallokation unter der Frage „Wie sah die Vermögensallokation aus?“ oben angegeben.



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?

Dies ist in der Grafik zur Vermögensallokation unter der Frage „Wie sah die Vermögensallokation aus?“ oben angegeben.



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

„Andere Investitionen“ umfasst die übrigen Investitionen des Portfolios, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren noch als nachhaltige Investitionen eingestuft wurden.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager und der Sub-Investment-Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachteten, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen, verhinderten und sie sicherstellen, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager wendeten bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager verstehen unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Managers und des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Managers und des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten sowie Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotienten herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Manager und vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

### II. Mitwirkung:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager engagierten sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager betrachteten diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil ihres Anlageprozesses. Die Fortschritte bei der Einbindung wurden vom Manager und dem Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### III. ESG-Sektor-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



### **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k.A.
- **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?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k.A.

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

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Short Duration Euro Bond (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 5493005BLB45DI1FOM10

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser 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?

**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 einen Anteil von 17,4 % 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**

\*Im Bezugszeitraum wurde der Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund in Neuberger Berman Short Duration Euro Bond Fund umbenannt.

\*\*Weitere Einzelheiten zur Vermögensallokation des Portfolios (einschließlich des Engagements in nachhaltigen Investitionen) finden Sie nachfolgend unter der Frage „Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?“.

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Sofem in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen,

die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, verantwortliche und transparente Risikübernahme, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung, Wasserbewirtschaftung und Entsorgung gefährlicher Abfälle.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Geschäftsethik; Chemikaliensicherheit, Beziehungen im Gemeinwesen, umstrittene Beschaffung, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität, verantwortungsbewusste Werbung, Etikettierung und Marketing und Menschenrechte.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigte der Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB China ESG Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („NB“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analyistenteam für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergriffen hat, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Darüber hinaus bemühte sich der Manager, konstruktiven Dialogen bei Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating Vorrang einzuräumen, um zu beurteilen, ob Bedenken angemessen berücksichtigt wurden.

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

| Bezugszeitraum    | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|--------|---------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient   | 64     | 1-100   | 93 %                  |
| Daten von Dritten | 6,9    | 0-10    |                       |

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums wurde mit Climate Value-at-Risk („**CVaR**“) das Ausmaß der Risiken und Chancen des Übergangs und der physischen Klimarisiken für Untermehensemittenten gemessen.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts einer Emission oder eines Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

|  |        |
|--|--------|
| Der CVaR prognostizierte, dass ein Szenario der Klimaerwärmung beim verwalteten Vermögen im Bezugszeitraum zu folgendem Wertverlust führen könnte. | -4,3 % |
| CVaR-Abdeckung im Bezugszeitraum.  | 45 %   |

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

### 3. ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy und die sonstigen spezifischen Ausschlüsse identifiziert wurden, die im SFDR-Anhang des Portfolios angegeben sind, oder nicht mit diesen vereinbar waren. Zudem investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit dieser vereinbar waren), wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („UNGC-Grundsätze“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („OECD-Leitsätze“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („UNGPs“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („ILO-Normen“) verstießen.

Bei der Anwendung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik auf das Portfolio verwendete der Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten, die gegen die oben dargelegte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik verstoßen. Wo möglich versuchte der Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

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

Ausnahmsweise wurden für den Bezugszeitraum 2022 die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgte (sie umfassen die Veröffentlichung der SFDR-Vorlagen für vorvertragliche Informationen).

#### 1. Der NB-ESG-Quotient

|                            | <b>NB-ESG-Quotient-Rating</b> | <b>Rating der Daten durch externe Anbieter</b> | <b>Kombinierte Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| <b>Bereich</b>             | 1-100                         | 0-10   | 0-100 %                      |
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 62                            | 6,5  | 87 %                         |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 63                            | 6,8  | 90 %                         |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 64                            | 6,9  | 93 %                         |

## 2. CvaR

|                            | <b>CVaR</b> | <b>Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------|------------------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | -5,3 %      | 52 %             |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | -5,3 %      | 52 %             |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | -4,3 %      | 45 %             |

## 3. Ausschlüsse

|                            | <b>Gesamtzahl der Verstöße</b> |
|----------------------------|--------------------------------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 0                              |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 0                              |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 0                              |

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

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckte sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Anlage zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Anlage eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat (wie nachstehend erläutert) und (iii) auf eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die gute Unternehmensführung eines Emittenten, um festzustellen, ob der Emittent einer derartigen Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griff der Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die Wirtschaftstätigkeit eines Emittenten auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet war.

Der Manager überprüfte die Emittenten auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Emittenten dieser Prüfung standhielten, quantifizierte der Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag der Emittenten zur Wirtschaft.

Der Manager erfasste dies auf drei Arten:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden);
- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDGs“) und
- Unterehnehmensemittenten in Sektoren mit großen Auswirkungen, die sich auf der Grundlage des NB Net-Zero Alignment Indicator auf einen Netto-Null-Kurs umstellen.

Im Bezugszeitraum aktualisierte der Manager den SFDR-Anhang des Portfolios, um dem Umstand Rechnung zu tragen, dass der Manager bei der Ermittlung nachhaltiger

Investitionen Emittenten aus Sektoren mit großen Auswirkungen berücksichtigt, die sich auf der Grundlage des NB Net-Zero Alignment Indicator auf einen Netto-Null-Kurs umstellen.

Die Beurteilung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs wurde durch die Verfügbarkeit von angemessenen, verfügbaren und überprüfbar Daten eingeschränkt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griff der Manager auf Daten von Drittanbietern und Proxydaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

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

Der Manager wendete seinen Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigen. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachtete der Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und auf Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Manager berücksichtigten bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele waren, die folgenden Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (die „PAIs“), die in der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind:

| PAIs                          |  |
|-------------------------------|--|
| Thema                         | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen  |
| <i>Treibhausgasemissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind<br>PAI 5 - Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen<br>PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren |
| <i>Biodiversität</i>          | PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken   |
| <i>Wasser</i>                 | PAI 8 - Emissionen in Wasser   |
| <i>Abfall</i>                 | PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle   |

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.

|                                   |  |
|-----------------------------------|--|
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | <p>PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen</p> <p>PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen</p> <p>PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle</p> <p>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen</p> <p>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)</p> |
|-----------------------------------|--|

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Manager berücksichtigte ferner Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen und investierte nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

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

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Manager bei der Feststellung, dass die ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen des Portfolios nicht erheblich beeinträchtigt wurden, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Emittenten, die unter die vom Manager für jede PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen;
- Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Emittenten, wenn sie unter die vom Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

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

das Portfolio investierte nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*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 EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



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

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager) berücksichtigt.

Der Manager berücksichtigte PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

1. Wie oben unter „*Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?*“ erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele führten, alle PAIs berücksichtigt.
2. Der Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

| <b>PAIs auf Produktebene</b>  |   |
|-------------------------------|---|
| <b>Thema</b>                  | <b>Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen</b>  |
| <i>Treibhausgasemissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck |

|  |   |
|--|---|
|  | <p>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird</p> <p>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind</p>   |
| <p><i>Soziales und Beschäftigung</i></p> | <p>PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen</p> <p>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen</p> <p>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)</p> |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel, die vom Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager hat den Bloomberg Industry Classification Standard („BICS“) verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem über die vier Kalenderquartalsenden des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitt basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2024 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2024 – 31. Dezember 2024

| Größte Investitionen                              | Sektor                                  | In % der Vermögenswerte | Land            |
|---|---|-------------------------|-----------------|
| FED CAISSES DESJARDINS /EUR/ REGD REG S           | FINANZWERTEN                            | 1,5                     | KANADA          |
| BANQUE FED CRED MUTUEL /EUR/ REGD V/R /PERP/ EMTN | FINANZWERTEN                            | 1,4                     | FRANKREICH      |
| LANDSBANKINN HF /EUR/ REGD REG S                  | FINANZWERTEN                            | 1,3                     | ISLAND          |
| INTESA SANPAOLO SPA /EUR/ REGD REG S EMTN         | FINANZWERTEN                            | 1,2                     | ITALIEN         |
| UBS GROUP AG /EUR/ REGD V/R REG S                 | FINANZWERTEN                            | 1,1                     | SCHWEIZ         |
| NATWEST GROUP PLC /EUR/ REGD V/R REG S EMTN       | FINANZWERTEN                            | 1,0                     | GROSSBRITANNIEN |
| HEIMSTADEN BOSTAD AB /EUR/ REGD V/R /PERP/ REG S  | FINANZWERTEN                            | 1,0                     | SCHWEDEN        |
| BANK OF NOVA SCOTIA /EUR/ REGD REG S EMTN         | FINANZWERTEN                            | 1,0                     | KANADA          |
| KNAB NV /EUR/ REGD REG S EMTN                     | FINANZWERTEN                            | 1,0                     | NIEDERLANDE     |
| BNP PARIBAS /EUR/ REGD V/R REG S EMTN             | FINANZWERTEN                            | 0,9                     | FRANKREICH      |
| SUMITOMO MITSUI BANKING /EUR/ REGD REG S EMTN     | FINANZWERTEN                            | 0,9                     | JAPAN           |
| DUTCH PROPERTY FINANCE 2021-2 BV SER 2021-2 CL AV | HYPOTHEKARISCH BESICHETERTE WERTPAPIERE | 0,9                     | NIEDERLANDE     |
| HOLCIM FINANCE L /EUR/ REGD REG S                 | INDUSTRIE                               | 0,9                     | LUXEMBURG       |
| CRED MUTUEL HOME LOAN SF /EUR/ REGD REG S         | FINANZWERTEN                            | 0,8                     | FRANKREICH      |
| ATHENE GLOBAL FUNDING /EUR/ REGD REG S EMTN       | FINANZWERTEN                            | 0,8                     | USA             |

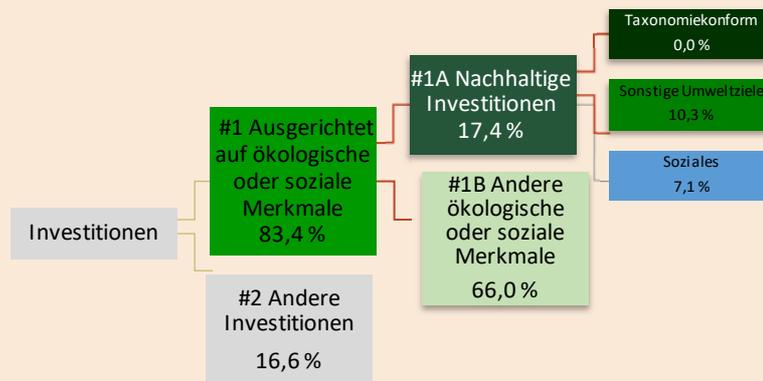


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Die Vermögensallokation des Portfolios im Bezugszeitraum wird in nachstehender Grafik dargestellt. Der Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen.



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

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

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige** Investitionen umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

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

| Wirtschaftssektoren - BICS                      | In % der Vermögenswerte |
|---|-------------------------|
| FINANZWERTEN                                    | 54,8                    |
| ZYKLISCHE KONSUMGÜTER                           | 8,5                     |
| STAATLICH                                       | 8,3                     |
| NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER                     | 7,6                     |
| HYPOTHEKARISCH BESICHERTE WERTPAPIERE           | 6,3                     |
| VERSORGUNG                                      | 4,3                     |
| INDUSTRIE                                       | 2,2                     |
| KEINE   | 1,9                     |
| KOMMUNIKATION                                   | 1,8                     |
| FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE (ABS-ANLEIHEN) | 1,8                     |
| ENERGIE   | 1,2                     |
| GRUNDSTOFFE                                     | 0,9                     |
| TECHNOLOGIE                                     | 0,4                     |



## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

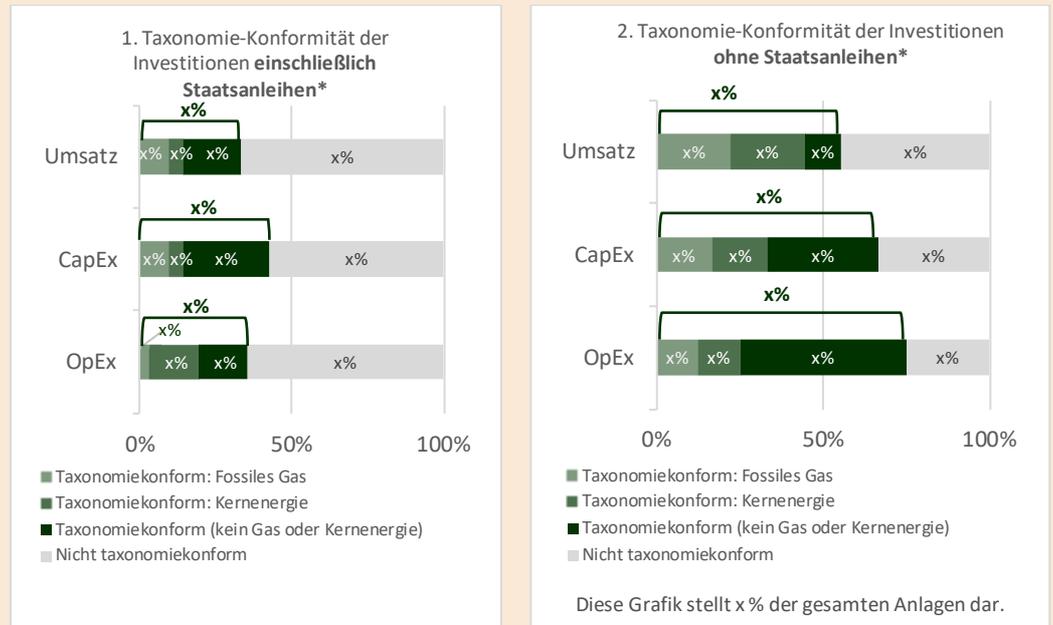
- Ja:  
 In fossiles Gas  In Kernenergie
- Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten 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 Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* 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?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



## Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Dies ist in der Grafik zur Vermögensallokation unter der Frage „Wie sah die Vermögensallokation aus?“ oben angegeben.



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?

Dies ist in der Grafik zur Vermögensallokation unter der Frage „Wie sah die Vermögensallokation aus?“ oben angegeben.



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

„Andere Investitionen“ umfasst die übrigen Investitionen des Portfolios, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren noch als nachhaltige Investitionen eingestuft wurden.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder zur Gewährleistung einer adäquaten Liquidität, Absicherung und Besicherung.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Emittentenanalysen durch die Investmentteams des Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten sowie Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in seine internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

### II. Mitwirkung:

Der Manager arbeitete mit den Emittenten über ein solides ESG-Dialogprogramm zusammen. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung der Mitwirkung verfolgt.

### III. ESG-Sektor-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



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

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k.A.
- **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?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k.A.

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

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Short Duration High Yield Engagement Fund (das „Portfolio“)\*

**Unternehmenskennung:** 5493009EN8Z7034TFP15

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser 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?

**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 einen Anteil von 18,3 % 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**

\*Im Bezugszeitraum wurde der Neuberger Berman Short Duration High Yield SDG Engagement Fund in Neuberger Berman Short Duration High Yield Engagement Fund umbenannt.

\*\*Weitere Einzelheiten zur Vermögensallokation des Portfolios (einschließlich des Engagements in nachhaltigen Investitionen) finden Sie unter der Frage „*Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?*“.

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Sofem in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen,

die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

Das Portfolio war bestrebt, die Verwirklichung der UN-Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDGs“) zu bewerben, indem mit mindestens 90 % der Emittenten (innerhalb von zwölf Monaten im Anschluss an den Kauf der von dem Unternehmensemittenten begebenen Wertpapiere) Kontakt aufgenommen und Maßnahmen besprochen wurden, die sie im Rahmen ihrer Produkte, Dienstleistungen, betrieblichen Abläufe oder Prozesse ergreifen können und die mit diesen Zielen in Einklang stehen (oder wo das Potenzial besteht, dass nach einer Zusammenarbeit mit diesen Unternehmen eine stärkere Ausrichtung auf diese Ziele erreicht wird).

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, THG-Emissionen, Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung, Wasserbewirtschaftung und Entsorgung gefährlicher Abfälle.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Geschäftsethik; Chemikaliensicherheit, Beziehungen im Gemeinwesen, umstrittene Beschaffung, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität, verantwortungsbewusste Werbung, Etikettierung und Marketing und Menschenrechte.

Das Portfolio zielt auf Konformität mit einem Netto-Null-Ziel ab, wie im SFDR-Anhang und im Abschnitt „Nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten“ im Prospekt ausführlicher beschrieben.

Der Sub-Investment-Manager hielt für den Berichtszeitraum eine durchschnittliche ESG-Bewertung für das Portfolio aufrecht, die besser war als die des breiten US-Hochzinsmarktes, der durch den ICE BofA U.S. High Yield Index repräsentiert wird, und die auf der Grundlage von ESG-Bewertungen Dritter von einem etablierten externen Anbieter bewertet wurde. Das Portfolio wurde aktiv verwaltet, der ICE BofA U.S. High Yield Index wurde ausschließlich zum Vergleich von ESG-Bewertungen und der Reduzierung der Kohlenstoffintensität verwendet.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

### ● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die Wesentlichkeitsmatrix von NB, die sich auf die ESG-Merkmale konzentrierte, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analyistentams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen. Jedes Sektorkriterium

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

wurde unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteten ESG-Daten erstellt. Ergänzend kamen interne qualitative Analysen hinzu, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analyistenteam des Sub-Investment-Managers genutzt wurde.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergriffen hat, wurden aus dem Portfolio entfernt.

| Bezugszeitraum           | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|--------------------------|--------|---------|-----------------------|
| <b>NB-ESG-Quotient</b>   | 58     | 1-100   | 100 %                 |
| <b>Daten von Dritten</b> | 5,7    | 0-10    |                       |

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 das niedrigste und 100 das höchste Rating darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

## 2. Berichterstattung über die Zusammenarbeit:

Wie oben erwähnt, trug der Sub-Investment-Manager zur Erreichung der SDGs bei, indem er mit mindestens 90 % der Unternehmensemittenten in Kontakt trat (die zum 31. Dezember 2024 für mindestens zwölf Monate im Portfoliobestand waren).

Der Sub-Investment-Manager hat außerdem nachfolgend eine Zusammenfassung seiner Bemühungen zur Einflussnahme im Kalenderjahr 2024 beigefügt.

|   |
|---|
| Der Sub-Investment-Manager trat mit 174 im Portfolio gehaltenen Unternehmen während des Bezugszeitraums in Kontakt.   |
| 53 % dieser Dialoge des Sub-Investment-Managers waren direkte Einzelgespräche (entweder per Fernzugriff oder als persönliches Gespräch).  |
| 62 % der Gespräche des Sub-Investment-Managers fanden mit Mitarbeitern und Mitarbeiterinnen der CEO-/CFO-Ebene statt.   |
| 14 der insgesamt 17 UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung (Sustainable Development Goals, „SDG“) wurden vom Sub-Investment-Manager während seiner Zusammenarbeit mit den Unternehmen abgedeckt. |
| Zum 31. Dezember 2024 haben die Unternehmen 23 % der Mitwirkungsziele entweder vollständig erreicht oder teilweise Maßnahmen zu ihrer Erreichung ergriffen.                                     |

Weitere Informationen über die Einflussnahme durch den Sub-Investment-Manager finden sich in der Bericht des Portfolios über die Zusammenarbeit [hier](#).

Weitere Einzelheiten finden Sie in der Neuberger Berman Stewardship and Engagement Policy [hier](#).

### 3. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums wurde mit Climate Value-at-Risk („**CVaR**“) das Ausmaß der Risiken und Chancen des Übergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmensemittenten gemessen.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts einer Emission oder eines Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

|  |         |
|--|---------|
| Der CVaR prognostizierte, dass ein Szenario der Klimaerwärmung beim verwalteten Vermögen im Bezugszeitraum zu folgendem Wertverlust führen könnte. | -10,5 % |
| CVaR-Abdeckung im Bezugszeitraum.  | 54 %    |

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

### 4. ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy, die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy, Ausschlüsse gemäß

dem EU-Referenzwert für klimabedingten Wandel (der „**EU-CTB**“), wie im Rahmen der Neuberger Berman EU Climate Benchmark Standard Exclusions Policy vorgesehen, und die sonstigen spezifischen Ausschlüsse identifiziert wurden, die im SFDR-Anhang des Portfolios angegeben sind, oder nicht mit diesen vereinbar waren. Zudem investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit dieser vereinbar waren), wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

Sonstiges

Im Bezugszeitraum führte das Portfolio die **EU-CTB**-Ausschlüsse ein, wie im Rahmen der Neuberger Berman EU Climate Benchmark Standard Exclusions Policy vorgesehen. Die Neuberger Berman EU Climate Benchmark Standard Exclusions Policy wurde vom Sub-Investment-Manager erstellt zur Ausrichtung auf die Leitlinien der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde zu Fondsamen, die ESG- oder nachhaltigkeitsbezogene Begriffe verwenden.

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

Ausnahmsweise wurden für den Bezugszeitraum 2022 die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgte (sie umfassen die Veröffentlichung der SFDR-Vorlagen für vorvertragliche Informationen).

1. Der NB-ESG-Quotient

|                            | <b>NB-ESG-Quotient-Rating</b> | <b>Rating der Daten durch externe Anbieter</b> | <b>Kombinierte Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| <b>Bereich</b>             | 1-100                         | 0-10   | 0-100 %                      |
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 57                            | 5,3  | 100 %                        |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 57                            | 5,6  | 100 %                        |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 58                            | 5,7  | 100 %                        |

2. Berichterstattung über die Zusammenarbeit

|                            | <b>Unternehmen, mit denen zusammen-gearbeitet wurde</b> | <b>% der Dialoge waren direkte Einzelgespräche (entweder per Fernzugriff oder als persönliches Gespräch)</b> | <b>% der Dialoge erfolgten mit Mitarbeiter/innen auf CEO/CFO-Ebene</b> | <b>Anzahl der abgedeckten SDGs (von 17)</b> | <b>% der Unternehmen, mit denen zusammen-gearbeitet wurde, haben das Ziel dieser Mitwirkung entweder vollständig erreicht oder teilweise Maßnahmen zur Erreichung ihres Ziels ergriffen.</b> |
|----------------------------|---|--|--|---|--|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 114   | 65 %   | 48 %   | 14  | 16 %   |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 161   | 54 %   | 51 %   | 15  | 22 %   |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 174   | 53 %   | 62 %   | 14  | 23 %   |

3. CVaR

|                            | <b>CVaR</b> | <b>Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------|------------------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | -12,4 %     | 60 %             |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | -11,6 %     | 59 %             |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | -10,5 %     | 54 %             |

4. Ausschlüsse

|                     | <b>Gesamtzahl der Verstöße</b> |
|---------------------|--------------------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | 0                              |
| Bezugszeitraum 2023 | 0                              |
| Bezugszeitraum 2024 | 0                              |

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

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckte sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Anlage zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Anlage eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat (wie nachstehend erläutert) und (iii) auf eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die gute Unternehmensführung eines Emittenten, um festzustellen, ob der Emittent einer derartigen Beurteilung standhält.

Der Rahmen für nachhaltige Investitionen von NB griff auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die Wirtschaftstätigkeit eines Emittenten auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet war.

Der Sub-Investment-Manager überprüfte die Emittenten auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Emittenten diese Prüfung bestanden haben, hat der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag des Emittenten zur Wirtschaft gemessen.

Der Sub-Investment-Manager erfasste dies auf drei Arten:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden);
- Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs und
- Untermehensemittenten in Sektoren mit großen Auswirkungen, die sich auf der Grundlage des NB Net-Zero Alignment Indicator auf einen Netto-Null-Kurs umstellen.

Im Bezugszeitraum aktualisierte der Sub-Investment Manager den SFDR-Anhang des Portfolios, um dem Umstand Rechnung zu tragen, dass der Sub-Investment Manager bei der Ermittlung nachhaltiger Investitionen Emittenten aus Sektoren mit großen Auswirkungen berücksichtigt, die sich auf der Grundlage des NB Net-Zero Alignment Indicator auf einen Netto-Null-Kurs umstellen.

Die Beurteilung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs wurde durch die Verfügbarkeit von angemessenen, verfügbaren und überprüfbareren Daten eingeschränkt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griff der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Proxydaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des Rahmens für nachhaltige Investitionen von NB zurück.

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

NB wendete seinen Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigen. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachtete der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele waren, die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (die „PAIs“):

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.

| PAIs                              |   |
|-----------------------------------|---|
| Thema                             | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen   |
| <i>Treibhausgasemissionen</i>     | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind<br>PAI 5 - Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen<br>PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren  |
| <i>Biodiversität</i>              | PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken  |
| <i>Wasser</i>                     | PAI 8 - Emissionen in Wasser  |
| <i>Abfall</i>                     | PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle  |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen<br>PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen<br>PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle<br>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen<br>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte ferner Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen und investierte nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

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

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, dass die ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen des Portfolios nicht erheblich beeinträchtigt wurden, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Emittenten, die quantitative und qualitative Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI festgelegt wurden, unterschreiten;
- Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Emittenten, wenn sie unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

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

Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*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 EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



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

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

1. Wie oben unter „*Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?*“ erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele führten, alle PAIs berücksichtigt.
2. Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

| <b>PAIs auf Produktebene</b>  |   |
|-------------------------------|---|
| <b>Thema</b>                  | <b>Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen</b>  |
| <i>Treibhausgasemissionen</i> | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |

|                                  |   |
|----------------------------------|---|
| Soziales<br>und<br>Beschäftigung | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen |
|                                  | PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen  |
|                                  | PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)   |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbar Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die o. g. PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat den Bloomberg Industry Classification Standard („**BICS**“) verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2024 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2024 – 31. Dezember 2024

| Größte Investitionen                   | Sektor                      | In % der Vermögenswerte | Land        |
|--|-----------------------------|-------------------------|-------------|
| TRIVIUM PACKAGING FIN REGD 144A P/P    | INDUSTRIE                   | 0,9                     | NIEDERLANDE |
| ASGN INCORPORATED REGD 144A P/P        | TECHNOLOGIE                 | 0,8                     | USA         |
| CIVITAS RESOURCES INC REGD 144A P/P    | ENERGIE                     | 0,8                     | USA         |
| MAUSER PACKAGING SOLUT REGD 144A P/P   | INDUSTRIE                   | 0,7                     | USA         |
| PRIME SECSRVC BRW/FINANC REGD 144A P/P | NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 0,7                     | USA         |
| AMSTED INDUSTRIES REGD 144A P/P        | INDUSTRIE                   | 0,7                     | USA         |
| OLYMPUS WTR US HLDG CORP REGD 144A P/P | GRUNDSTOFFE                 | 0,7                     | USA         |
| VOC ESCROW LTD REGD 144A P/P           | ZYKLISCHE KONSUMGÜTER       | 0,7                     | USA         |
| CUSHMAN & WAKEFIELD US REGD 144A P/P   | FINANZWERTEN                | 0,7                     | USA         |
| HILCORP ENERGY I/HILCORP REGD 144A P/P | ENERGIE                     | 0,7                     | USA         |
| BENTELER INTERNATIONAL A REGD 144A P/P | DIVERSIFIZIERT              | 0,7                     | ÖSTERREICH  |
| CCO HLDGS LLC/CAP CORP REGD 144A P/P   | KOMMUNIKATION               | 0,7                     | USA         |
| FRONTIER COMMUNICATIONS REGD 144A P/P  | KOMMUNIKATION               | 0,6                     | USA         |
| UNITI GROUP/CSL CAPITAL REGD 144A P/P  | FINANZWERTEN                | 0,6                     | USA         |
| ATI INC REGD                           | GRUNDSTOFFE                 | 0,6                     | USA         |

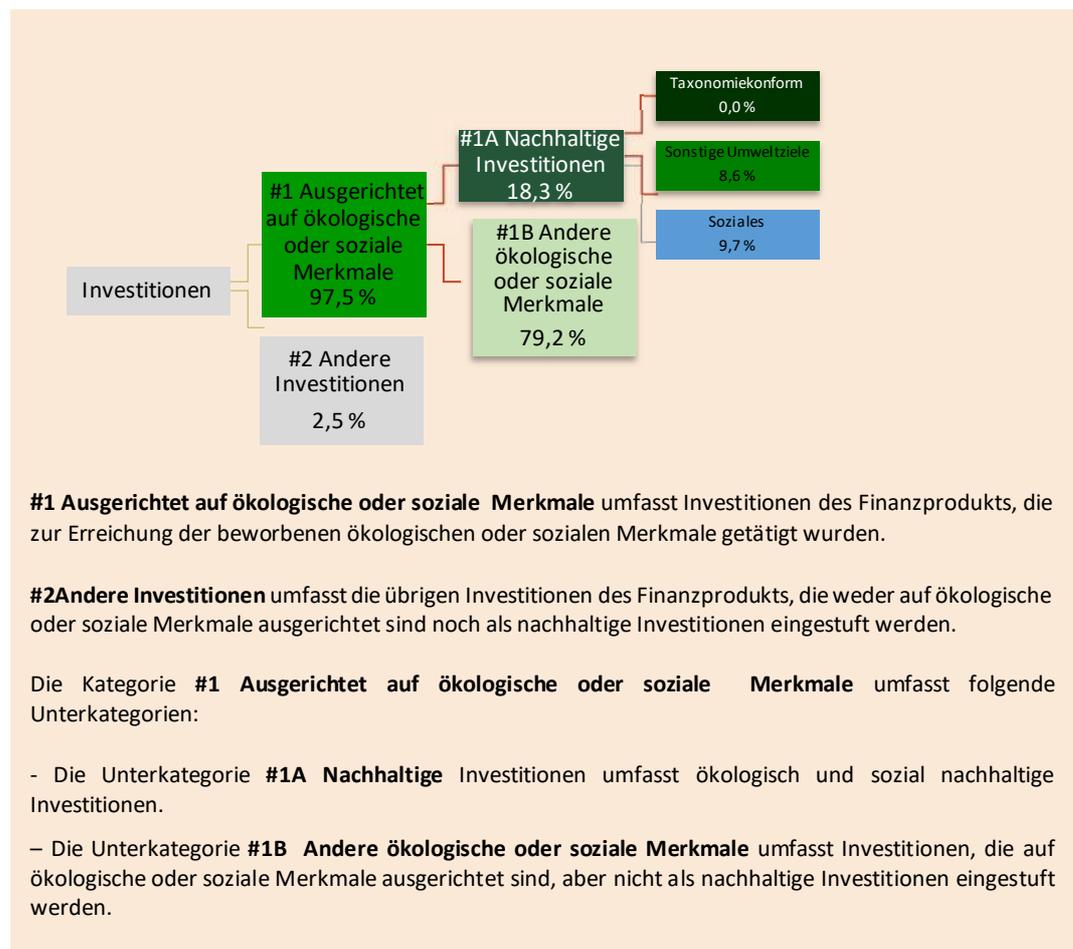


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### ● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Die Vermögensallokation des Portfolios im Bezugszeitraum wird in nachstehender Grafik dargestellt. Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen. Zur Klarstellung wird festgehalten, dass Investitionen in ein Vehikel für gemeinsame Anlagen von Neuberger Berman, das als mit Artikel 8 oder Artikel 9 der SFDR konform ausgewiesen war, als auf die mit dem Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet galten.



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

| <b>Wirtschaftssektoren - BICS</b>                 | <b>In % der Vermögenswerte</b> |
|---|--------------------------------|
| ZYKLISCHE KONSUMGÜTER                             | 19,1                           |
| NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER                       | 16,6                           |
| INDUSTRIE   | 15,8                           |
| FINANZWERTEN                                      | 12,9                           |
| ENERGIE   | 10,6                           |
| KOMMUNIKATION                                     | 10,2                           |
| GRUNDSTOFFE                                       | 8,0                            |
| TECHNOLOGIE                                       | 3,8                            |
| KREDIT  | 1,3                            |
| VERSORGUNG  | 0,8                            |
| DIVERSIFIZIERT                                    | 0,7                            |
| FORDERUNGSBESICHETERTE WERTPAPIERE (ABS-ANLEIHEN) | 0,2                            |



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

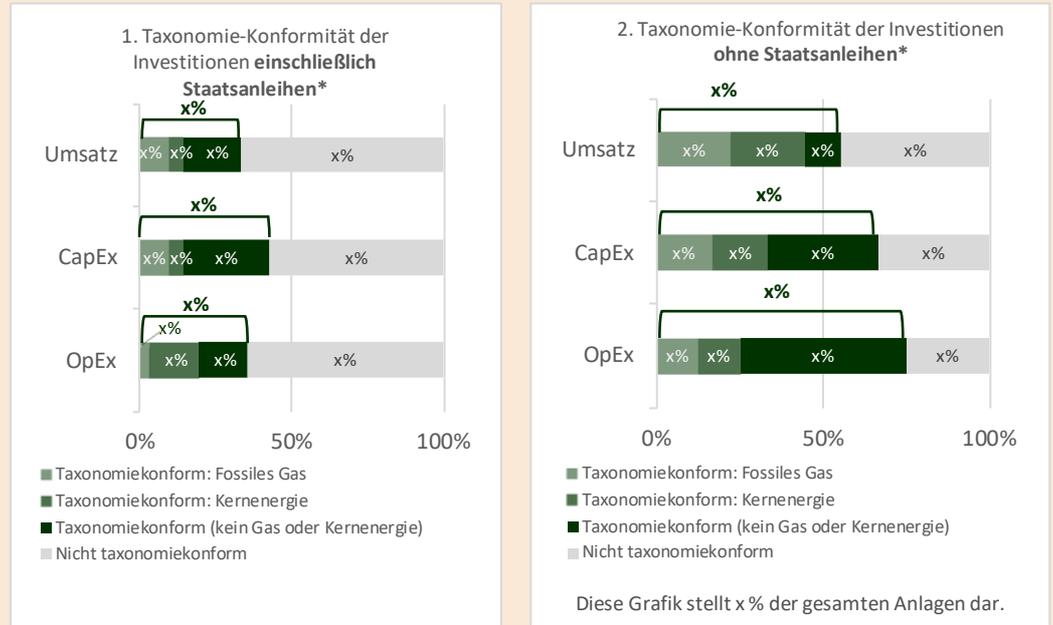
- Ja:  
 In fossiles Gas  In Kernenergie
- Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten 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 Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. 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.



\* 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?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



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 nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Dies ist in der Grafik zur Vermögensallokation unter der Frage „Wie sah die Vermögensallokation aus?“ oben angegeben.



## Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Dies ist in der Grafik zur Vermögensallokation unter der Frage „Wie sah die Vermögensallokation aus?“ oben angegeben.



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

„Andere Investitionen“ umfasst die übrigen Investitionen des Portfolios, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren noch als nachhaltige Investitionen eingestuft wurden.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Emittenteanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten sowie Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

### II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses.

Dieses Programm konzentrierte sich auf persönliche Treffen und Telefonkonferenzen, um die ESG-Risiken und -Chancen zu verstehen und die gute Unternehmensführung der Emittenten zu bewerten. Im Rahmen der direkten Zusammenarbeit hat der Sub-Investment-Manager Ziele festgelegt, welche Ziele die Emittenten erreichen sollten. Diese Ziele sowie die Fortschritte der Emittenten im Hinblick auf diese Ziele wurden vom Sub-Investment-Manager mit Hilfe eines internen Systems von NB zur Nachverfolgung der Mitwirkung erfasst und überwacht (weitere Einzelheiten sind dem obigen Abschnitt über die Mitwirkung zu entnehmen).

Das Portfolio:

- Bestrebt, die Verwirklichung der SDGs zu bewerben, indem darauf abgezielt wurde, mit mindestens 90 % der Emittenten (innerhalb von zwölf Monaten im Anschluss an den Kauf der von dem Unternehmensemittenten begebenen Wertpapiere) Kontakt aufzunehmen und Maßnahmen zu besprechen, die sie im Rahmen ihrer Produkte, Dienstleistungen, betrieblichen Abläufe oder Prozesse ergreifen könnten und die mit diesen Zielen in Einklang stehen (oder wo das Potenzial besteht, dass nach einer Zusammenarbeit mit diesen Emittenten eine stärkere Ausrichtung auf diese Ziele erreicht wird).
- Hielt eine durchschnittliche ESG-Bewertung für das Portfolio aufrecht, die besser war als die des breiten US-Hochzinsmarktes, der durch den ICE BofA U.S. High Yield Index repräsentiert wird, und die auf der Grundlage einer ESG-Bewertung Dritter von einem etablierten externen Anbieter bewertet wurde.

Der Sub-Investment-Manager nutzte ein hausinternes Instrument, um im Vorfeld einer Anlage die Wahrscheinlichkeit auf Erfolg bei der Mitwirkung gegenüber einem Emittenten festzustellen (der „**Mitwirkungspotenzial-Indikator**“). Der Mitwirkungspotenzial-Indikator bietet auf einer Skala von 1–5 eine Bewertung der Bereitschaft und Fähigkeit eines Emittenten, mit dem Sub-Investment-Manager zu den SDGs zusammenzuarbeiten. Ein Emittent, der beispielsweise als nicht bereit oder fähig zur Zusammenarbeit eingestuft wurde, erhielt einen Mitwirkungspotenzial-Indikator von „1“, während ein Emittent, der zur Zusammenarbeit bereit war, um ein Vorreiter bei der Unterstützung der SDGs zu werden, mit einem Mitwirkungspotenzial-Indikator von „5“ bewertet wurde. Der Sub-Investment-Manager priorisierte Anlagen in Emittenten mit einem Mitwirkungspotenzial-Indikator zwischen „2“ und „5“. Mit dem Mitwirkungspotenzial-Indikator wurden neben den finanziellen Beschränkungen für den Emittenten verschiedene Faktoren berücksichtigt, darunter die Bedeutung der SDGs im Geschäftsbetrieb des Emittenten, die Offenlegungspraktiken des Emittenten und die Beziehung des Sub-Investment-Managers zum Emittenten.

### III. ESG-Sektor-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k.A.
- **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?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k.A.

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 im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k.A.

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Strategic Income Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300RBLDK0PHH13M43

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser 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?

**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**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Sofem in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Treibhausgasemissionen („THG“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, verantwortliche und transparente Risikoübernahme, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung, Wasserbewirtschaftung und Entsorgung gefährlicher Abfälle.
- **Soziale Merkmale:** Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Geschäftsethik; Chemikaliensicherheit, Beziehungen im Gemeinwesen, umstrittene Beschaffung, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität, verantwortungsbewusste Werbung, Etikettierung und Marketing und Menschenrechte.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hauseigene Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**NB**“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteten ESG-Daten erstellt. Ergänzend kommen interne qualitative Analysen hinzu, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analyistenteam des Portfolio-Analyistenteam genutzt wird. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existierte kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergriff, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Darüber hinaus bemühte sich der Sub-Investment-Manager, konstruktiven Dialogen bei Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating Vorrang einzuräumen, um zu beurteilen, ob Bedenken angemessen berücksichtigt wurden.

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

| Bezugszeitraum    | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|--------|---------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient   | 65     | 1-100   | 40 %*                 |
| Daten von Dritten | 6,2    | 0-10    |                       |

\*Die kombinierte Abdeckung schließt das Engagement in verbrieften Schuldtiteln (z. B. CMBS, CMO und MBS) aus. Manche Engagements in verbrieften Schuldtiteln gelten als auf die mit dem Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet, wie in der Grafik zur Vermögensallokation ausgewiesen.

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums wurde mit Climate Value-at-Risk („**CVaR**“) das Ausmaß der Risiken und Chancen des Übergangs und der physischen Klimarisiken für Unterehnehmensemittenten gemessen.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts einer Emission oder eines Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

|  |        |
|--|--------|
| Der CVaR prognostizierte, dass ein Szenario der Klimaerwärmung beim verwalteten Vermögen im Bezugszeitraum zu folgendem Wertverlust führen könnte. | -5,9 % |
| CVaR-Abdeckung im Bezugszeitraum.  | 14 %   |

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

### 3. ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy und die sonstigen spezifischen Ausschlüsse identifiziert wurden, die im SFDR-Anhang des Portfolios angegeben sind, oder nicht mit diesen vereinbar waren. Zudem investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („UNGC-Grundsätze“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („OECD-Leitsätze“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („UNGPs“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („ILO-Normen“) verstießen.

Bei der Anwendung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

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

Ausnahmsweise wurden für den Bezugszeitraum 2022 die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgte (sie umfassen die Veröffentlichung der SFDR-Vorlagen für vorvertragliche Informationen).

#### 1. NB-ESG-Quotient

|                     | <b>NB-ESG-<br/>Quotient-Rating</b> | <b>Rating der Daten<br/>durch externe<br/>Anbieter</b> | <b>Kombinierte Abdeckung</b> |
|---------------------|------------------------------------|--|------------------------------|
| <b>Bereich</b>      | 1-100                              | 0-10   | 0-100 %                      |
| Bezugszeitraum 2022 | 72                                 | 5,7  | 66 %                         |
| Bezugszeitraum 2023 | 71                                 | 6,0  | 48 %                         |
| Bezugszeitraum 2024 | 65                                 | 6,2  | 40 %                         |

## 2. CvaR

|                     | <b>CVaR</b> | <b>Abdeckung</b> |
|---------------------|-------------|------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | -10,2 %     | 33 %             |
| Bezugszeitraum 2023 | -8,7 %      | 20 %             |
| Bezugszeitraum 2024 | -5,9 %      | 14 %             |

## 3. Ausschlüsse

|                     | <b>Gesamtzahl der Verstöße</b> |
|---------------------|--------------------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | 0                              |
| Bezugszeitraum 2023 | 0                              |
| Bezugszeitraum 2024 | 0                              |

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager nicht in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die

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.

UNGPs identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*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 EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



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

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte in Bezug auf die Nachhaltigkeitsfaktoren die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 1 der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind, für Unternehmensemittenten (die „**PAIs für Unternehmensemittenten**“), und die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 2 der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind, für staatliche Emittenten (die „**staatlichen PAIs**“) (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“):

| Teil 1 – PAIs für Unternehmensemittenten |   |
|--|---|
| Thema                                    | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen   |
| Treibhausgasemissionen                   | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind |

|                                   |  |
|-----------------------------------|--|
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen<br>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen<br>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |
| <b>Teil 2 – staatliche PAIs</b>   |  |
| <i>Umwelt</i>                     | PAI 15 – THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird  |
| <i>Soziales</i>                   | PAI 16 - Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen  |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbar Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat den Bloomberg Industry Classification Standard („**BICS**“) verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2024 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2024 – 31. Dezember 2024

| Größte Investitionen                                      | Sektor   | In % der Vermö-genswerte | Land |
|---|--|--------------------------|------|
| UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS            | STAATLICH  | 1,1                      | USA  |
| UNITED STATES TREASURY BILL ZCP FNMA 30YR TBA 5.5% APR 24 | STAATLICH<br>HYPOTHEKARISCH<br>BESICHERTE<br>WERTPAPIERE | 1,0                      | USA  |
| UNITED STATES TREASURY BILL ZCP FNMA 30YR TBA 5.5% JUL 24 | STAATLICH<br>HYPOTHEKARISCH<br>BESICHERTE<br>WERTPAPIERE | 0,9                      | USA  |
| UNITED STATES TREASURY BILL ZCP FNMA 30YR TBA 5.5% JUL 24 | STAATLICH<br>HYPOTHEKARISCH<br>BESICHERTE<br>WERTPAPIERE | 0,8                      | USA  |
| UNITED STATES TREASURY NOTE                               | STAATLICH  | 0,7                      | USA  |
| UNITED STATES TREASURY BILL ZCP FNMA 30YR TBA 2.5% JUL13  | STAATLICH<br>HYPOTHEKARISCH<br>BESICHERTE<br>WERTPAPIERE | 0,7                      | USA  |
| UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS            | STAATLICH  | 0,6                      | USA  |
| UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS            | STAATLICH  | 0,6                      | USA  |
| UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS            | STAATLICH  | 0,6                      | USA  |
| UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS            | STAATLICH  | 0,5                      | USA  |

|   |   |     |     |
|---|---|-----|-----|
| G2SF 30YR TBA 6.0% JUL 24                             | HYPOTHEKARISCH<br>BESICHERTE<br>WERTPAPIERE | 0,5 | USA |
| FNMA 30YR TBA 2.5% APR 24                             | HYPOTHEKARISCH<br>BESICHERTE<br>WERTPAPIERE | 0,5 | USA |
| UNITED STATES TREASURY NOTE                           | STAATLICH                                   | 0,5 | USA |
| UNITED STATES TREASURY NOTE                           | STAATLICH                                   | 0,5 | USA |
| FREDDIE MAC STACR REMIC TRUST<br>2022-DNA3 SER 2022-D | HYPOTHEKARISCH<br>BESICHERTE<br>WERTPAPIERE | 0,5 | USA |
| UNITED STATES TREASURY NOTE                           | STAATLICH                                   | 0,4 | USA |

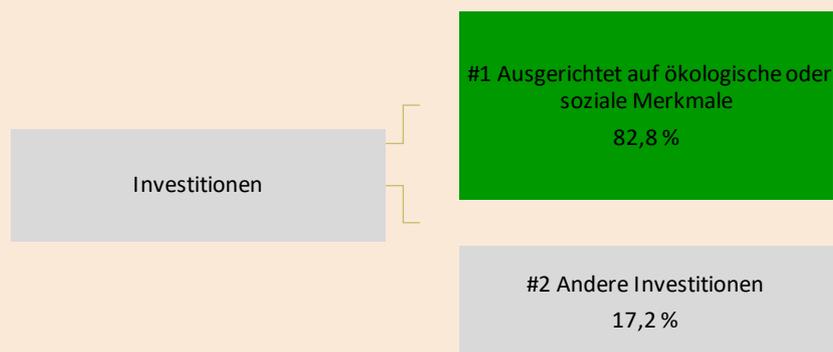


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Vermögensallokation des Portfolios im Bezugszeitraum wird in nachstehender Grafik dargestellt. Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.



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

**#2Andere 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?***

| <b>Wirtschaftssektoren - BICS</b>               | <b>In % der Vermögenswerte</b> |
|---|--------------------------------|
| HYPOTHEKARISCH BESICHERTE WERTPAPIERE           | 54,6                           |
| STAATLICH                                       | 11,8                           |
| FINANZWERTEN                                    | 8,8                            |
| FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE (ABS-ANLEIHEN) | 4,5                            |
| ZYKLISCHE KONSUMGÜTER                           | 3,4                            |
| NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER                     | 3,4                            |
| VERSORGUNG                                      | 3,1                            |
| KOMMUNIKATION                                   | 2,9                            |
| ENERGIE   | 2,1                            |
| INDUSTRIE                                       | 1,7                            |
| KREDIT  | 1,3                            |
| TECHNOLOGIE                                     | 1,1                            |
| GRUNDSTOFFE                                     | 0,8                            |
| STAATSNAH                                       | 0,2                            |
| KOMMUNAL  | 0,2                            |
| DIVERSIFIZIERT                                  | 0,1                            |



## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für

**Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

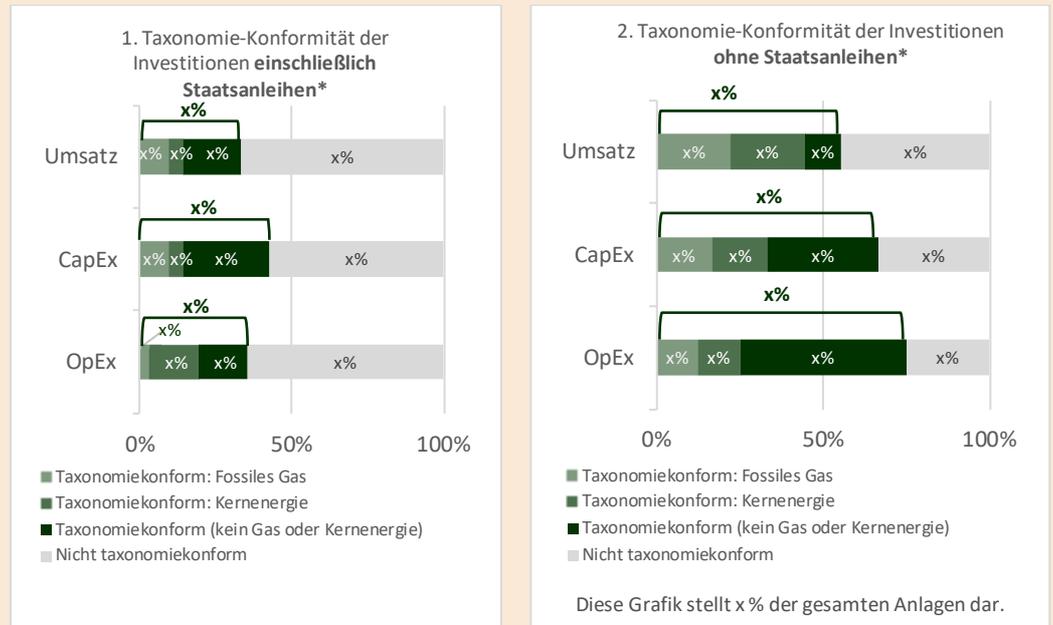
- Ja:
- In fossiles Gas  In Kernenergie
- Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten 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 Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. 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.



\* 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?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



### **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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

„Andere Investitionen“ umfasst die übrigen Investitionen des Portfolios, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren noch als nachhaltige Investitionen eingestuft wurden.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Emittentenanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten sowie Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in seine internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

### II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### III. ESG-Sektor-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k.A.
- **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?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k.A.

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

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Sustainable Asia High Yield Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 5493005FAT85HZ73DG37

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser 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?

**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 57.1 %\* 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**

\*Weitere Einzelheiten zum Mindestanteil nachhaltiger Investitionen, die ökologische oder soziale Merkmale bewerben, finden Sie unter der Frage „*Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?*“.

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Sofem in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio für Unternehmensemittenten beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Biodiversität und Landnutzung, Kohlenstoffemissionen, Gelegenheiten für saubere Technologien, Wasserstress, Schadstoffemissionen und Abfälle, Finanzierung von Umweltauswirkungen, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck von Produkten, Umweltpolitik, Umweltmanagementsystem, Programme zur Reduzierung von THG-Emissionen („**THG**“) umweltfreundliche Beschaffungspolitik und Programme für treibhausfreie Luftemissionen.
- **Soziale Merkmale:** Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Schutz der Privatsphäre und Datensicherheit, Produktsicherheit und -qualität, Sicherheit von Finanzprodukten, Diskriminierungspolitik, Programme zur Einbindung der Gemeinschaft, Diversitätsprogramme und Menschenrechtspolitik.

Das Portfolio zielt auf Konformität mit einem Netto-Null-Ziel ab, wie im SFDR-Anhang und im Abschnitt „Nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten“ im Prospekt ausführlicher beschrieben.

Das Portfolio erreichte im Bezugszeitraum ein Niveau der reduzierten CO<sub>2</sub>-Emissionen, die um mindestens 30 % niedriger war als das des breiteren Anlageuniversum asiatischer Hochzinsanleihen, das durch den J.P. Morgan Asian Credit High Yield Index (der „**Index**“) repräsentiert wird. Die durchschnittliche CO<sub>2</sub>-Emissionsintensität wurde auf der Grundlage der CO<sub>2</sub>-Emissionsintensität des Portfolios gemessen und berechnet. Sie wurde an jedem der vier Kalenderquartalsenden im Bezugszeitraum ermittelt. Das Portfolio wird aktiv verwaltet und beabsichtigte nicht, den Index abzubilden. Er wird hier zu Zwecken der Reduzierung der CO<sub>2</sub>-Emissionsintensität und des ESG-Vergleichs aufgenommen.

Für den Bezugszeitraum erreichte das Portfolio eine höhere ESG-Bewertung als das breitere Universum asiatischer Hochzinsanleihen, das durch den Index repräsentiert wird, basierend auf den ESG-Bewertungen eines etablierten externen Anbieters.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden.

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

Der Sub-Investment-Manager schloss Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating aus, es sei denn, es bestand die begründete Erwartung, dass sich das NB-ESG-Quotient-Rating im Laufe der Zeit verbessern würde.

| Bezugszeitraum    | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|--------|---------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient   | 57     | 1-100   | 98 %                  |
| Daten von Dritten | 5,5    | 0-10    |                       |

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

## 2. ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy, die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy, Ausschlüsse gemäß dem Paris-abgestimmten EU-Referenzwert („EU-PAB“), wie im Rahmen der Neuberger Berman EU Climate Benchmark Standard Exclusions Policy vorgesehen, und die sonstigen spezifischen Ausschlüsse identifiziert wurden, die im SFDR-Anhang des Portfolios angegeben sind, oder nicht mit diesen vereinbar waren. Zudem investierte das Portfolio nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit dieser vereinbar waren), wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („UNGC-Grundsätze“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischen Handeln („OECD-Leitsätze“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

### Sonstiges

Im Bezugszeitraum führte das Portfolio die EU-PAB-Ausschlüsse ein, wie im Rahmen der Neuberger Berman EU Climate Benchmark Standard Exclusions Policy vorgesehen. Die Neuberger Berman EU Climate Benchmark Standard Exclusions Policy wurde vom Sub-Investment-Manager erstellt zur Ausrichtung auf die Leitlinien der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde zu Fondsnamen, die ESG- oder nachhaltigkeitsbezogene Begriffe verwenden.

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

Ausnahmsweise wurden für den Bezugszeitraum 2022 die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgte (sie umfassen die Veröffentlichung der SFDR-Vorlagen für vorvertragliche Informationen).

#### 1. Der NB-ESG-Quotient

|                            | <b>NB-ESG-Quotient-Rating</b> | <b>Rating der Daten durch externe Anbieter</b> | <b>Kombinierte Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| <b>Bereich</b>             | 1-100                         | 0-10   | 0-100 %                      |
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 55                            | 4,2  | 95 %                         |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 56                            | 5,4  | 100 %                        |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 57                            | 5,5  | 98 %                         |

#### 2. Ausschlüsse

|                            | <b>Gesamtzahl der Verstöße</b> |
|----------------------------|--------------------------------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 0                              |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 0                              |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 0                              |

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

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckt sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Investition zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Investition eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat

(wie nachstehend erläutert) und (iii) eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die Unternehmensführung eines Emittenten, um festzustellen, ob der Emittent einer derartige Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griff der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die wirtschaftlichen Tätigkeiten eines Emittenten auf ökologische oder soziale Merkmalen ausgerichtet waren.

Der Sub-Investment-Manager überprüfte die Emittenten auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Emittenten diese Prüfung bestanden haben, hat der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag des Emittenten zur Wirtschaft gemessen.

Bei Unternehmensemittenten hat der Sub-Investment-Manager dies auf drei Arten erfasst:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden);
- Ausrichtung der Umsätze auf die UN-Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDGs“) und Unternehmensemittenten in Sektoren mit großen Auswirkungen, die sich auf der Grundlage des NB Net-Zero Alignment Indicator auf einen Netto-Null-Kurs umstellen.

Im Bezugszeitraum aktualisierte der Sub-Investment Manager den SFDR-Anhang des Portfolios, um dem Umstand Rechnung zu tragen, dass der Sub-Investment Manager bei der Ermittlung nachhaltiger Investitionen Unternehmen aus Sektoren mit großen Auswirkungen berücksichtigt, die sich auf der Grundlage des NB Net-Zero Alignment Indicator auf einen Netto-Null-Kurs umstellen.

Die Berücksichtigung Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs, nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers, war durch die Verfügbarkeit von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griff der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Proxydaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

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

Der Sub-Investment-Manager wandte seinen Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigten. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachtete der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachhaltigen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele waren, die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Indikatoren für die wichtigsten nachhaltigen Auswirkungen (die „PAIs“):

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.

| PAIs                              |   |
|-----------------------------------|---|
| Thema                             | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen   |
| <i>Treibhausgasemissionen</i>     | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind<br>PAI 5 - Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen<br>PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren  |
| <i>Biodiversität</i>              | PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken  |
| <i>Wasser</i>                     | PAI 8 - Emissionen in Wasser  |
| <i>Abfall</i>                     | PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle  |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen<br>PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen<br>PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle<br>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen<br>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbar Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Sub-Investment-Manager hat auch Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen berücksichtigt. Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

— — —

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

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, dass die ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen des Portfolios nicht erheblich beeinträchtigt wurden, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Emittenten, die quantitative und qualitative Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI festgelegt wurden, unterschreiten;
- Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Emittenten, wenn sie unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

— — —

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

Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*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 EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

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

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



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

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigt PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

1. Wie oben unter „*Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?*“ erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele führten, alle PAIs berücksichtigt.
2. Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

| PAIs auf Produktebene             |  |
|-----------------------------------|--|
| Thema                             | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen  |
| <i>Treibhausgasemissionen</i>     | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind  |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen<br>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen<br>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat den Bloomberg Industry Classification Standard („BICS“) verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2024 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2024 – 31. Dezember 2024

| Größte Investitionen                        | Sektor                | In % der Vermögenswerte | Land             |
|---|-----------------------|-------------------------|------------------|
| STANDARD CHARTERED PLC REGD V/R/PERP/ REG S | FINANZWERTEN          | 5,9                     | GROSS-BRITANNIEN |
| GREENKO POWER II LT REGD REG S              | ENERGIE               | 3,8                     | MAURITIUS        |
| MELCO RESORTS FINANCE REGD REG S            | ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 2,8                     | HONGKONG         |
| GLOBE TELECOM INC REGD V/R/PERP/ REG S      | KOMMUNIKATION         | 2,4                     | PHILIPPINEN      |
| MELCO RESORTS FINANCE REGD REG S            | ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 2,3                     | HONGKONG         |
| FRANSHION BRILLIANT LTD REGD REG S          | FINANZWERTEN          | 2,2                     | HONGKONG         |
| PERIAMA HOLDINGS LLC/DE REGD REG S          | GRUNDSTOFFE           | 2,0                     | USA              |
| STUDIO CITY FINANCE LTD REGD REG S          | ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 2,0                     | HONGKONG         |
| WYNN MACAU LTD REGD REG S                   | ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 1,9                     | MACAU            |
| CAS CAPITAL NO1 LTD REGD V/R/PERP/ REG S    | KOMMUNIKATION         | 1,9                     | HONGKONG         |
| KASIKORNBANK PCL HK REGD V/R REG S EMTN     | FINANZWERTEN          | 1,9                     | HONGKONG         |
| LONGFOR HOLDINGS LTD REGD                   | FINANZWERTEN          | 1,7                     | CHINA            |
| 10 RENEW POWER SUBSIDIAR REGD REG S         | VERSORGUNG            | 1,7                     | INDIEN           |
| SHRIRAM FINANCE LTD REGD REG S EMTN         | FINANZWERTEN          | 1,7                     | INDIEN           |
| GREENKO SOLAR MAURITIUS REGD REG S          | ENERGIE               | 1,7                     | MAURITIUS        |

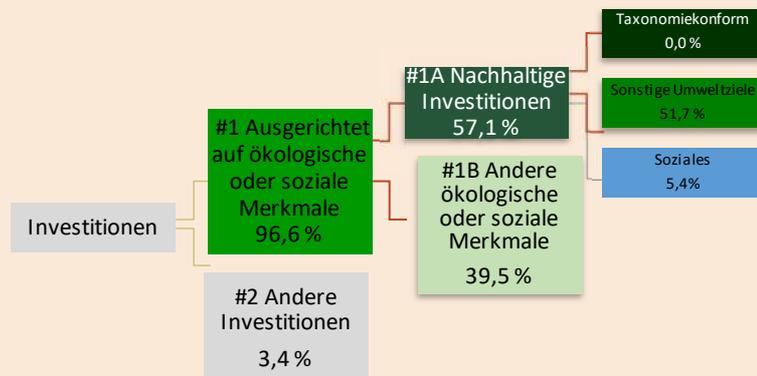


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Die Vermögensallokation des Portfolios im Bezugszeitraum wird in nachstehender Grafik dargestellt. Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen.



**#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.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.

- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

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

| Wirtschaftssektoren - BICS  | In % der Vermögenswerte |
|-----------------------------|-------------------------|
| FINANZWERTEN                | 43,1                    |
| ZYKLISCHE KONSUMGÜTER       | 18,6                    |
| ENERGIE                     | 10,0                    |
| STAATLICH                   | 8,0                     |
| KOMMUNIKATION               | 6,7                     |
| VERSORGUNG                  | 6,7                     |
| GRUNDSTOFFE                 | 3,8                     |
| TECHNOLOGIE                 | 1,8                     |
| INDUSTRIE                   | 1,0                     |
| NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 0,3                     |



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

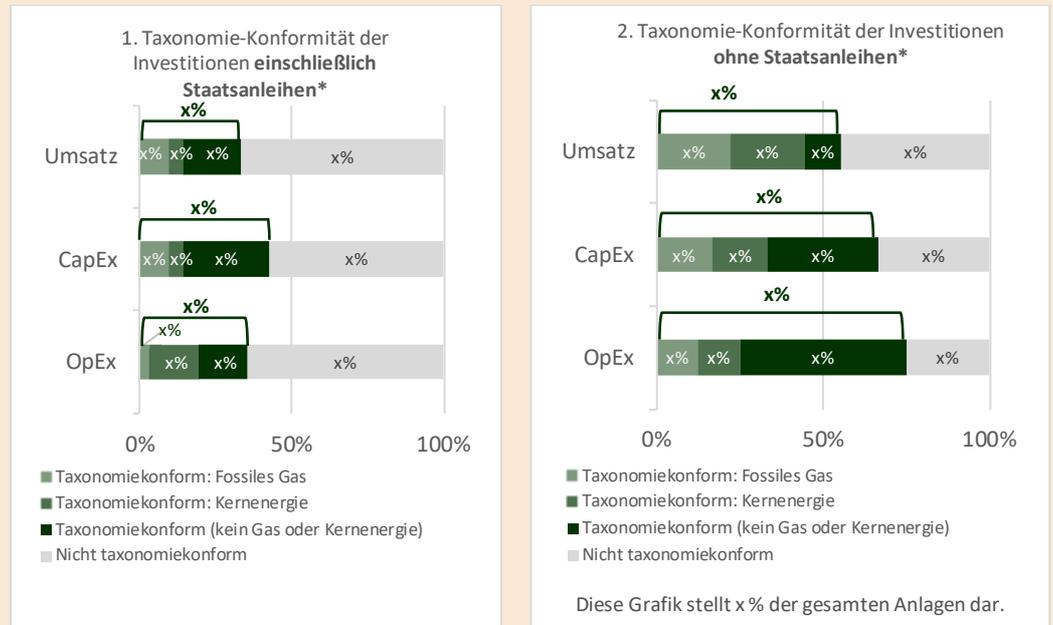
- Ja:  
 In fossiles Gas  In Kernenergie  
 Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten 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 Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* 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?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



## Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Dies ist in der Grafik zur Vermögensallokation unter der Frage „Wie sah die Vermögensallokation aus?“ oben angegeben.



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?

Dies ist in der Grafik zur Vermögensallokation unter der Frage „Wie sah die Vermögensallokation aus?“ oben angegeben.



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

„Andere Investitionen“ umfasst die übrigen Investitionen des Portfolios, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren noch als nachhaltige Investitionen eingestuft wurden.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Emittenteanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten sowie Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine wichtige Komponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

### II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### III. ESG-Sektor-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



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

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**  
k.A.
- **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?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k.A.

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

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 9, Absätze 1 bis 4a, der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 5 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten.**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman Sustainable Emerging Market Debt – Hard Currency Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300OWRIKGBWGY0X93

## Nachhaltiges Investitionsziel

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser 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?

Ja

Nein

Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: **67,5 %**

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: **28,1 %**

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**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Sofem in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.



## Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts erreicht?

Das Portfolio investierte in Wertpapiere von Emittenten, die zu ökologischen und sozialen Zielen beitragen. Die Emittenten wurden gegenüber dem nachhaltigen Anlageziel anhand der nachstehend aufgeführten Parameter bewertet.

### Ökologische Ziele

Der Sub-Investment-Manager hat gezielt in Emittenten investiert, die nachweislich bessere einkommensbereinigte Fortschritte bei der Anpassung an den Klimawandel und den Klimaschutz, der Reduzierung von Treibhausgasemissionen („THG“), der Vitalität von Ökosystemen und der Ausrichtung auf das Netto-Null-Ziel gemacht haben.

#### Ziele staatlicher Emittenten:

Länder, die sich im obersten 25. Perzentil befinden oder im nächsten 25. Perzentil mit sich verbessernden Merkmalen in Bezug auf den Indikator des staatlichen Klimaübergangsrisiko (dieser Indikator ist Eigentum des Sub-Investment-Managers und kombiniert Daten, die sich auf den Klimaschutz, die Anpassung an den Klimawandel, die Vitalität von Ökosystemen, die THG-Emissionen und die Anpassung an das Netto-Null-Ziel konzentrieren), wurden als in Einklang mit dem Umweltziel erachtet.

Die Netto-Null-Verpflichtungen und -Ziele wurden in der Erwartung festgelegt, dass die Regierungen ihre eigenen Verpflichtungen einhalten, um sicherzustellen, dass die Ziele des Pariser Abkommens erreicht werden, einschließlich erhöhter Ambitionen ihrer national festgelegten Beiträge (Nationally Determined Contributions, „NDCs“).

#### Ziele unternehmerischer Emittenten:

Das Portfolio zielt auf Konformität mit einem Netto-Null-Ziel ab, wie im SFDR-Anhang und im Abschnitt „Nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten“ im Prospekt ausführlicher beschrieben.

### Soziale Ziele

Der Sub-Investment-Manager zielte auf Investitionen in Emittenten ab, die bessere einkommensbereinigte Fortschritte bei der Erreichung der UN-Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDGs“), mit einem Schwerpunkt auf den Bereichen öffentliche Gesundheit und Bildung, nachweisen konnten.

Länder, die sich im obersten 25. Perzentil befinden oder im nächsten 25. Perzentil mit sich verbessernden Merkmalen in Bezug auf den Indikator für staatliche Nachhaltigkeit (dieser Indikator ist Eigentum des Sub-Investment-Managers und kombiniert Daten, die sich auf Lebenserwartung, Zugang zu Impfungen und medizinischem Fachpersonal, Sekundarschulbildung und eine geringere Einkommensgleichheit), wurden als in Einklang mit dem sozialen Ziel erachtet.

Das Portfolio hat sein nachhaltiges Anlageziel erreicht. Die Performance bzgl. des nachhaltigen Anlageziels wurde anhand der Nachhaltigkeitsindikatoren gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

## Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die Erreichung der nachhaltigen Anlageziele des Portfolios zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

### i. Berichte und Bewertungen von unabhängigen Dritten:

Der Sub-Investment-Manager nutzte die folgenden Berichte, Indizes und Bewertungen von Dritten, um die Fortschritte des Portfolios bei der Erreichung seiner nachhaltigen Anlageziele für Staaten zu messen:

**Fortschritte im Hinblick auf die UN-Ziele für nachhaltige Entwicklung mit einem Schwerpunkt auf die Anpassung an den Klimawandel und den Klimaschutz:**

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die nachhaltigen Ziele dieses Finanzprodukts erreicht werden.

- Notre Dame Global Adaptation Initiative Country Index („**ND-GAIN**“)

Der Sub-Investment-Manager verwendete den ND-GAIN-Index, um die Anfälligkeit eines Landes für den Klimawandel und die Klimaübergangsrisiken zu messen und zu bewerten.

Der Sub-Investment-Manager konzentrierte sich bei seiner Bewertung auf die einkommensbereinigte Anpassung an den Klimawandel.

- THG-Emissionen von Staaten:

Der Sub-Investment-Manager verfolgte die territorialen THG-Emissionen von Staaten, definiert als Tonnen CO<sub>2</sub>-Emissionen des um die Kaufkraft („**PPP**“) bereinigten BIP (territoriale Produktionsemissionen) oder pro Kopf (territoriale Konsumemissionen). Emittenten mit der höchsten territorialen Produktionsemissionen – definiert als oberstes Quartil und zunehmend – wurden aus dem Portfolio ausgeschlossen.

- Environmental Performance Index

Der Sub-Investment Manager verfolgte einkommensbereinigte Daten zur Vitalität von Ökosystemen aus dem Environmental Performance Index, einem gemeinsamen Projekt des Yale Center for Environmental Law & Policy und des Center for International Earth Science Information Network („**CIESIN**“) am Earth Institute der Columbia University. Dieser Indikator erfasste, wie gut die Länder Ökosysteme und die von ihnen erbrachten Leistungen erhalten, schützen und verbessern. Er besteht aus sechs Emissionskategorien: Biodiversität und Lebensräume, Ökosystemdienstleistungen, Fischereien, saurer Regen, Landwirtschaft und Wasserressourcen.

- Anpassung an das Netto-Null-Ziel – GermanWatch’s Climate Change Performance Index („**CCPI**“) und Climate Action Tracker

Der Sub-Investment-Manager verfolgte die Anpassung an das Netto-Null-Ziel von Ländern, die Staatsanleihen begeben gemäß dem CCPI und dem vom Climate Action Tracker gemessenen nationalen und globalen Bemühungen zur Eindämmung der globalen Erwärmung. Dies ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, Länder anzuvisieren, die sich bis 2050 oder früher zu Netto-Null-Emissionen verpflichtet haben.

**Fortschritte bei den UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung, mit Schwerpunkt auf der öffentlichen Gesundheit, der Sekundarschulbildung und der Überwindung von Einkommensungleichheiten:**

- Sustainable Development Report Index

Der Sub-Investment-Manager nutzte die Bertelsmann Stiftung und den Sustainable Development Solutions Network Sustainable Development Report Index, um die Leistung von Ländern bzgl. der SDGs zu bewerten. Dies ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, gezielt in Emittenten zu investieren, die bessere Fortschritte bei der Verwirklichung der SDGs demonstrierten. Länder, welche die ökologischen oder sozialen Ziele erfüllen, müssen ferner im obersten 75. Perzentil des Sustainable Development Report Index platziert sein, um als nachhaltig zu gelten.

- UNDP Human Development Index

Der Sub-Investment-Manager nutzte den UNDP-Index für menschliche Entwicklung, um auf einkommensbereinigter Basis die Errungenschaften in den Schlüsselbereichen Lebenserwartung, Bildung und Einkommensgleichheit weltweit zu messen. Dies ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, gezielt in Emittenten zu investieren, die bessere Fortschritte für die menschliche Entwicklung demonstrierten.

- Weltgesundheitsorganisation (WHO) – Das Globale Gesundheitsobservatorium

Der Sub-Investment-Manager setzte einkommensbereinigte Daten des Globalen Gesundheitsobservatoriums über die Durchimpfungsrate (Diphtherie-Tetanus-Toxoid) und die Keuchhustenimpfrate („**DTP3**“) bei Einjährigen sowie die Zahl der Ärzte pro Kopf der Bevölkerung ein.

#### Top-Performer oder Top-Improver im Portfolio

Die oben aufgeführten Berichte und Bewertungen unabhängiger Dritter wurden zusammengefasst, um „Top-Performers“ (Länder im obersten 25. Perzentil, die mit den ökologischen und/oder sozialen Zielen des Portfolios übereinstimmen) oder „Top-Improvers“ (Länder im nächsthöheren 25. Perzentil,

die sich verbessern und an die staatlichen ökologischen und/oder sozialen Zielen des Portfolios angepasst waren und weiterhin anpassen) zu identifizieren.

Nur staatliche Emittenten aus Schwellenländern, die den ökologischen und/oder sozialen Ziele des Portfolios entsprachen und als Top-Performer oder Top-Improver eingestuft wurden, wurden vom Portfolio gehalten. Die Einstufung von Ländern als Top-Performer oder Top-Improver ist ein Hinweis darauf, dass das Portfolio seine Umwelt- und sozialen Ziele erfüllt.

## ii. **ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:**

Zur Sicherstellung, dass das nachhaltige Investitionsziel des Portfolios erreicht wurde, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy, die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy, Ausschlüsse gemäß dem Paris-abgestimmten EU-Referenzwert („**EU-PAB**“), wie im Rahmen der Neuberger Berman EU Climate Benchmark Standard Exclusions Policy vorgesehen, und die sonstigen spezifischen Ausschlüsse identifiziert wurden, die im SFDR-Anhang des Portfolios angegeben sind, oder nicht mit diesen vereinbar waren.

Ferner investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit dieser vereinbar waren), wodurch solche Emittenten ausgeschlossen werden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

### Sonstiges

Im Bezugszeitraum brachte das Portfolio die Neuberger Berman Enhanced Sustainable Exclusion Policy nicht zur Anwendung.

Im Bezugszeitraum führte das Portfolio die EU-PAB-Ausschlüsse ein, wie im Rahmen der Neuberger Berman EU Climate Benchmark Standard Exclusions Policy vorgesehen. Die Neuberger Berman EU Climate Benchmark Standard Exclusions Policy wurde vom Sub-Investment-Manager erstellt zur Ausrichtung auf die Leitlinien der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde zu Fondsamen, die ESG- oder nachhaltigkeitsbezogene Begriffe verwenden.

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

### i. **Berichte und Bewertungen von unabhängigen Dritten**

Im Bezugszeitraum kam es zu den folgenden bemerkenswerten Änderungen gegenüber dem vorherigen Bezugszeitraum:

| Bezugszeitraum | Weitere als sozial nachhaltig geltende Länder aus dem Universum staatlicher Emittenten | Weitere als ökologisch nachhaltig geltende Länder aus dem Universum staatlicher Emittenten | Nicht länger als sozial nachhaltig geltende Länder aus dem Universum staatlicher Emittenten | Nicht länger als ökologisch nachhaltig geltende Länder aus dem Universum staatlicher Emittenten |
|----------------|--|--|---|---|
| 2023           | 4  | 5  | 6   | 7   |
| 2024           | 2  | 1  | 1   | 0   |

Aus vorstehender Tabelle gehen die Bewegungen im gesamten Universum staatlicher Emittenten hervor, möglicherweise einschließlich solcher Staaten, die im Portfolio nicht gehalten werden.

Dabei ist zu beachten, dass die Kategorie „Nicht Nachhaltig“ im Portfolio nur Investitionen enthalten durfte, die der Sub-Investment-Manager als notwendig für das ordnungsgemäße Funktionieren des Portfolios erachtete (z. B. zur Gewährleistung einer angemessenen Liquidität, Absicherung und Besicherung). Galt ein Land für Investitionszwecke nicht länger als sozial nachhaltig, aber als ökologisch nachhaltig oder umgekehrt, konnte das Portfolio dieses Land weiterhin halten, da es für Investitionszwecke nach wie vor als nachhaltig anerkannt würde.

## ii. ESG-Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

|                            | Gesamtzahl der Verstöße |
|----------------------------|-------------------------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 0                       |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 0                       |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 0                       |

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 wurden nachhaltige Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen nicht erheblich beeinträchtigt?*

Der Sub-Investment-Manager wandte seinen Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigten. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachen würde, betrachtete der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Sub-Investment-Manager trug bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlageziele waren, den folgenden Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen Rechnung. Bei staatlichen Emittenten (die den Großteil des Portfolios ausmachten) werden diese im Detail im ersten Abschnitt der nachstehenden Tabelle („**Staatliche PAIs**“) und bei Unternehmensemittenten (die „**PAIs für Unternehmensemittenten**“) im zweiten Abschnitt aufgeführt (zusammen die „**PAIs**“):

| PAIs  |   |
|-------|---|
| Thema | Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen |

| <b>Teil 1 – Staatliche PAIs</b>                 |   |
|---|---|
| <i>Umwelt</i>                                   | PAI 15 – THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird   |
| <i>Soziales</i>                                 | PAI 16 - Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen   |
| <b>Teil 2 – PAIs für Unternehmensemittenten</b> |   |
| <i>Treibhausgasemissionen</i>                   | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind<br>PAI 5 -Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen<br>PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren   |
| <i>Biodiversität</i>                            | PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken  |
| <i>Wasser</i>                                   | PAI 8 - Emissionen in Wasser  |
| <i>Abfall</i>                                   | PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle  |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i>               | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen<br>PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen<br>PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle<br>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen<br>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte ferner Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen und investierte nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

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

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, dass die ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen des Portfolios nicht erheblich beeinträchtigt wurden, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung von Emittenten, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für die relevanten PAIs festgelegt wurden;
- Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Emittenten, wenn sie unter die vom Sub-Investment-Manager für die relevanten PAIs festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben näher beschriebenen ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik von NB, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

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

Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy identifiziert werden.



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

Der Sub-Investment-Manager prüfte die Auswirkungen der PAIs auf Nachhaltigkeitsfaktoren.

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

In Bezug auf das Portfolio erfolgte die Betrachtung der PAIs durch den Sub-Investment-Manager durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Emittenten, die quantitative und qualitative Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für die relevante PAI festgelegt wurden, unterschritten;
- Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Emittenten, wenn sie unter die vom Sub-Investment-Manager für die relevanten PAIs festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben näher beschriebenen ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik von NB, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat den Bloomberg Industry Classification Standard („BICS“) verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln. Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2024 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2024 – 31. Dezember 2024

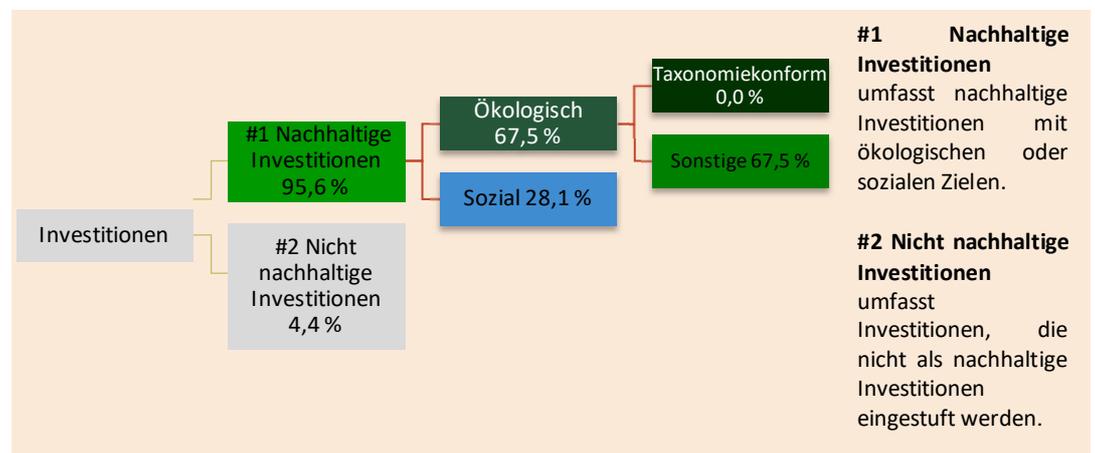
| Größte Investitionen                    | Sektor    | In % der Vermögenswerte | Land               |
|---|-----------|-------------------------|--------------------|
| REPUBLIC OF CHILE /EUR/ REGD            | STAATLICH | 2,9                     | CHILE              |
| REPUBLIC OF PERU /EUR/ REGD             | STAATLICH | 2,8                     | PERU               |
| REPUBLIC OF COLOMBIA REGD               | STAATLICH | 2,7                     | KOLUMBIEN          |
| REPUBLIC OF SERBIA /EUR/ REGD REG S     | STAATLICH | 2,7                     | REPUBLIK SERBIEN   |
| FED REPUBLIC OF BRAZIL REGD             | STAATLICH | 2,6                     | BRASILIEN          |
| KINGDOM OF MOROCCO REGD REG S           | STAATLICH | 2,5                     | MAROKKO            |
| ROMANIA /EUR/ REGD REG S EMTN           | STAATLICH | 2,4                     | RUMÄNIEN           |
| IVORY COAST /EUR/ REGD REG S            | STAATLICH | 2,2                     | COTE D'IVOIRE      |
| REPUBLIC OF ARGENTINA REGD S/UP SER     | STAATLICH | 2,0                     | ARGENTINIEN        |
| REPUBLIC OF ARGENTINA REGD S/UP         | STAATLICH | 1,9                     | ARGENTINIEN        |
| REPUBLIC OF EL SALVADOR REGD REG S      | STAATLICH | 1,9                     | EL SALVADOR        |
| UNITED MEXICAN STATES REGD MTN SER GMTN | STAATLICH | 1,9                     | MEXIKO             |
| REPUBLIC OF ARMENIA REGD REG S          | STAATLICH | 1,8                     | ARMENIEN           |
| DOMINICAN REPUBLIC REGD REG S           | STAATLICH | 1,8                     | DOMINICAN REPUBLIC |
| ROMANIA /EUR/ REGD REG S                | STAATLICH | 1,7                     | RUMÄNIEN           |



## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?



Die Vermögensallokation des Portfolios im Bezugszeitraum wird in vorstehender Grafik dargestellt. Die Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder Dritten beruhen.

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

| <b>Wirtschaftssektoren - BICS</b> | <b>In % der Vermögenswerte</b> |
|-----------------------------------|--------------------------------|
| STAATLICH                         | 89,3                           |
| FINANZWERTEN                      | 6,0                            |
| GRUNDSTOFFE                       | 2,1                            |
| INDUSTRIE                         | 1,3                            |
| KOMMUNIKATION                     | 1,1                            |
| ENERGIE                           | 0,2                            |

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten 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 Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**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 CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:

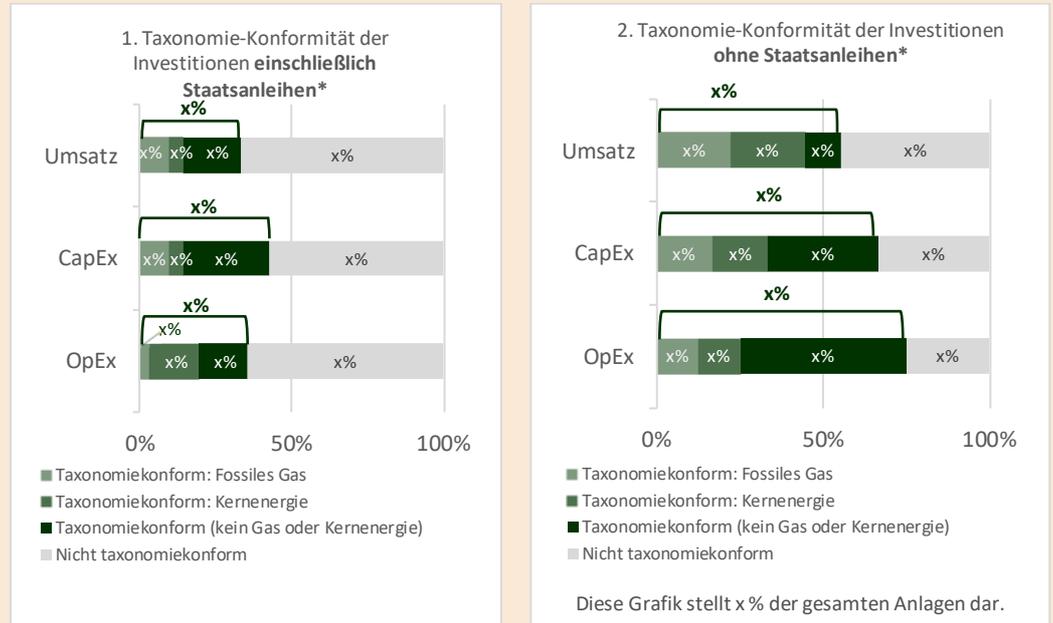
In fossiles Gas

In Kernenergie

Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. 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.



\* 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?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



### **Wie hoch war der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden?**

Dies ist in der Grafik zur Vermögensallokation unter der Frage „Wie sah die Vermögensallokation aus?“ oben angegeben.



sind ökologisch nachhaltige Investitionen, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomie **nicht berücksichtigen**.



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

Dies ist in der Grafik zur Vermögensallokation unter der Frage „Wie sah die Vermögensallokation aus?“ oben angegeben.



### **Welche Investitionen fallen unter „nicht nachhaltige Investitionen“, welcher Anlagezweck wird mit ihnen verfolgt und gibt es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Unter „nicht nachhaltige Investitionen“ fallen die übrigen Investitionen des Portfolios, die nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft wurden.

Die Investitionen der Kategorie „Nicht Nachhaltig“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Sub-Investment-Manager als notwendig für das ordnungsgemäße Funktionieren des Portfolios erachtete, z. B. die Gewährleistung einer angemessenen Liquidität, Absicherung und Besicherung.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager war der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine nachhaltigen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



## Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem nachhaltigen Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### i. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager verstand unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Emittenteanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigte daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit dem Nachhaltigkeitsziel des Portfolios, indem es (wie jeweils anwendbar) Berichte und Bewertungen von unabhängigen Dritten, den NB-ESG-Quotienten sowie Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) verwendete.

Der Indikator für die Entwicklung der Nachhaltigkeit von Staaten (dieser Indikator ist Eigentum des Sub-Investment-Managers) bewertete die Fortschritte staatlicher Emittenten bei der Anpassung an den Klimawandel und dem Klimaschutz, der Verringerung der THG-Emissionen und der Ausrichtung auf Netto-Null sowie bei der Erreichung der SDGs mit besonderem Schwerpunkt auf der öffentlichen Gesundheit und Bildung.

Der Sub-Investment-Manager führte zudem eine fortlaufende Analyse der ESG-Faktoren durch, indem er emittentenbezogene Bewertungen des NB-ESG-Quotienten erstellte und nutzte, um Risiken und Chancen bei der Gesamtbewertung der Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings konnten auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in seine internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der nachhaltigen Anlageziele des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

Emittenten mit einem günstigen NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn der Emittent keine diesbezüglichen Maßnahmen ergriffen hat, wurden nicht in das Portfolio aufgenommen.

| Bezugszeitraum    | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|--------|---------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient   | 54     | 1-100   | 99 %                  |
| Daten von Dritten | 4,3    | 0-10    |                       |

Für den NB-ESG-Quotient wird ein Rating zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 das niedrigste und 100 das höchste Rating darstellt. Für dieses Portfolio gibt es keine Mindestrating des NB ESG-Quotienten. Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung des nachhaltigen Anlageziels. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Bewertung der Daten Dritter reichen von 0–10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Der Sub-Investment-Manager tätigte keine Investitionen in staatlichen Emittenten, bei denen er eine schwache ESG-Praxis festgestellt hat wie im SFDR-Anhang näher beschrieben.

## ii. **Mitwirkung:**

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

## iii. **ESG-Sektor-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:**

Um sicherzustellen, dass das vom Portfolio beworbene nachhaltige Anlageziel erreicht wurde, wendete das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



## **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Nachhaltigkeitsreferenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

### ● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

k.A.

### ● **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf das nachhaltige Investitionsziel bestimmt wird?**

k.A.

### ● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

k.A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das nachhaltige Ziel des Finanzprodukts erreicht wird.

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

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman US Equity Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300GF328Y6TQJI517

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser 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?

**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**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Sofem in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Klimarisiken, THG-Emissionen, Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Wasserbewirtschaftung, Energiemanagement, Abfallentsorgung, Kraftstoffeffizienz, Gelegenheiten für saubere Technologien, Management des Produktlebenszyklus, Materialbeschaffung und Chemikaliensicherheit.
- **Soziale Merkmale:** Betriebssicherheit und Krisenvorsorge, Zugang zu Finanzmitteln, Zugang zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen im Gemeinwesen, Datenschutz und -sicherheit, Gesundheit und Ernährung, Preistransparenz, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Vielfalt und Integration in der Belegschaft, Geschäftsethik, Produktsicherheit, -qualität und -integrität, Management systemischer Risiken, Management des Rechts- und Regulierungsumfelds und Lieferkettenmanagement.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB China ESG Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („NB“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wurde unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analyistenteam für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Unternehmen wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss. Unternehmen mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient- oder externen Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Unternehmen mit einem schlechten NB-ESG-Quotient- oder externen Rating, insbesondere dann, wenn ein Unternehmen diesbezüglich keine Maßnahmen ergriff, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Darüber hinaus überwacht der Sub-Investment-Manager fortlaufend Unternehmen mit einem unterdurchschnittlichen oder schlechten NB-ESG-Quotient- oder externen Rating, um zu verstehen, wie sie besagte ESG-Bedenken mildern/verbessern.

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

| Bezugszeitraum    | Rating          | Bereich           | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|-----------------|-------------------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient   | ES: B<br>G: 2,3 | ES: A-D<br>G: 1-4 | 100 %                 |
| Daten von Dritten | 6,5             | 0-10              |                       |

Im Hinblick auf das NB-ESG-Quotient-Rating der Aktienemittenten werden für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale („ES“) die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance („G“) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jedes im Portfolio gehaltene Unternehmen erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums erfasste Climate Value-at-Risk („**CVaR**“) das Ausmaß der Risiken und der Chancen des Klimaübergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmen.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

|  |        |
|--|--------|
| Der CVaR prognostizierte, dass ein Szenario der Klimaerwärmung beim verwalteten Vermögen im Bezugszeitraum zu folgendem Wertverlust führen könnte. | -5,1 % |
| CVaR-Abdeckung im Bezugszeitraum.  | 99 %   |

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Suv-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

### 3. ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy und die sonstigen spezifischen Ausschlüsse identifiziert wurden, die im SFDR-Anhang des Portfolios angegeben sind, oder nicht mit diesen vereinbar waren. Zudem investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („UNGC-Grundsätze“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („OECD-Leitsätze“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („UNGPs“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („ILO-Normen“) verstießen.

Bei der Anwendung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

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

Ausnahmsweise wurden für den Bezugszeitraum 2022 die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgte (sie umfassen die Veröffentlichung der SFDR-Vorlagen für vorvertragliche Informationen).

### 1. NB-ESG-Quotient

|                            | <b>NB-ESG-Quotient-Rating</b> | <b>Rating der Daten durch externe Anbieter</b> | <b>Kombinierte Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| <b>Bereich</b>             | ES: A-D<br>G: 1-4             | 0-10   | 0-100 %                      |
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | ES: B<br>G: 2,2               | 6,6  | 100 %                        |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | ES: B<br>G: 2,1               | 6,6  | 97 %                         |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | ES: B<br>G: 2,3               | 6,5  | 100 %                        |

## 2. CVaR

|                            | CVaR   | Abdeckung |
|----------------------------|--------|-----------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | -5,7 % | 91 %      |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | -6,8 % | 96 %      |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | -5,1 % | 99 %      |

## 3. Ausschlüsse

|                            | Gesamtzahl der Verstöße |
|----------------------------|-------------------------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 0                       |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 0                       |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 0                       |

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager nicht in Unternehmen investiert, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die ILO-Normen, die UNGC-Grundsätze und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*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 EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

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

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



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

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Unternehmen durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

| <b>PAIs auf Produktebene</b>      |  |
|-----------------------------------|--|
| <b>Thema</b>                      | <b>Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen</b>   |
| <i>Treibhausgasemissionen</i>     | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind  |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen<br>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen<br>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat den Bloomberg Industry Classification Standard („**BICS**“) verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2024 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2024 – 31. Dezember 2024

| Größte Investitionen       | Sektor                         | In % der Vermögenswerte | Land |
|----------------------------|--------------------------------|-------------------------|------|
| MICROSOFT CORP             | TECHNOLOGIE                    | 9,1                     | USA  |
| AMAZON.COM INC             | KOMMUNIKATION                  | 8,3                     | USA  |
| NVIDIA CORP                | TECHNOLOGIE                    | 7,1                     | USA  |
| META PLATFORMS INC-CLASS A | KOMMUNIKATION                  | 5,8                     | USA  |
| APPLE INC                  | TECHNOLOGIE                    | 5,2                     | USA  |
| ALPHABET INC-CL A          | KOMMUNIKATION                  | 4,7                     | USA  |
| BROADCOM INC               | TECHNOLOGIE                    | 3,5                     | USA  |
| SALESFORCE INC             | TECHNOLOGIE                    | 3,0                     | USA  |
| VISA INC-CLASS A SHARES    | FINANZWERTEN                   | 2,6                     | USA  |
| NETFLIX INC                | KOMMUNIKATION                  | 2,4                     | USA  |
| INTUIT INC                 | TECHNOLOGIE                    | 2,3                     | USA  |
| MASTERCARD INC - A         | FINANZWERTEN                   | 2,2                     | USA  |
| TJX COMPANIES INC          | ZYKLISCHE<br>KONSUMGÜTER       | 2,1                     | USA  |
| ABBVIE INC                 | NICHT-ZYKLISCHE<br>KONSUMGÜTER | 1,9                     | USA  |
| SERVICENOW INC             | TECHNOLOGIE                    | 1,8                     | USA  |

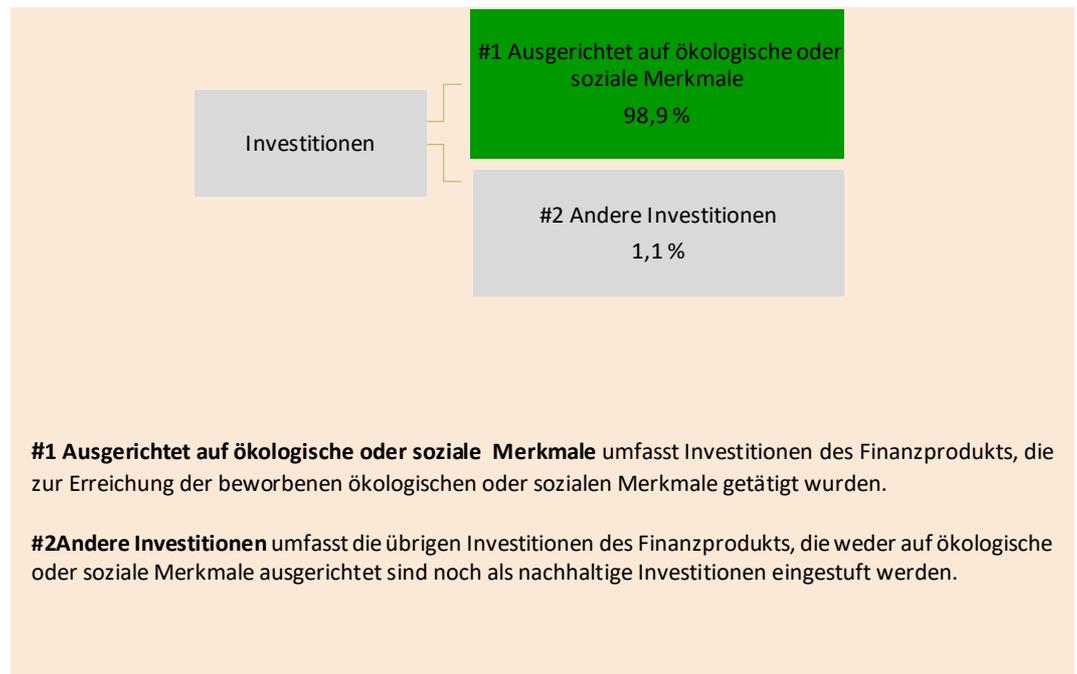


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Vermögensallokation des Portfolios im Bezugszeitraum wird in nachstehender Grafik dargestellt. Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder externen Anbietern beruhen.



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

| Wirtschaftssektoren - BICS  | In % der Vermögenswerte |
|-----------------------------|-------------------------|
| TECHNOLOGIE                 | 38,8                    |
| KOMMUNIKATION               | 25,7                    |
| NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 13,0                    |
| ZYKLISCHE KONSUMGÜTER       | 9,9                     |
| FINANZWERTEN                | 7,3                     |
| INDUSTRIE                   | 3,3                     |
| VERSORGUNG                  | 2,0                     |



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

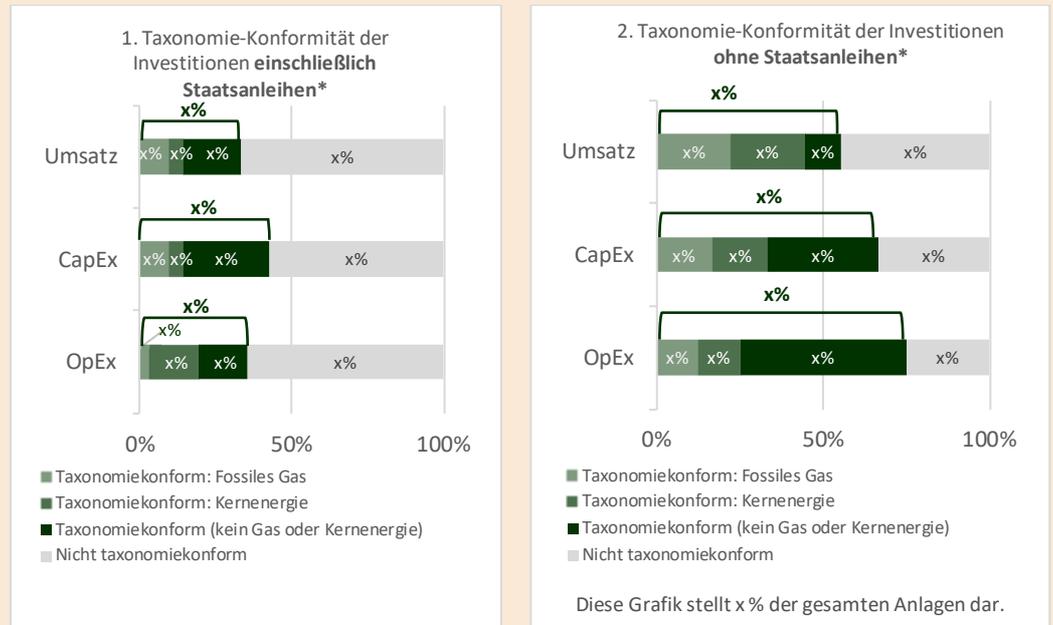
Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten 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 Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. 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.



\* 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?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



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 nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.



### Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.



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

„Andere Investitionen“ umfasst die übrigen Investitionen des Portfolios, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren noch als nachhaltige Investitionen eingestuft wurden.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten sowie Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde herangezogen, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung besser zu erkennen. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient und das externe Rating) in die Gesamtbetrachtung der Unternehmen bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

### II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager trat in einen Dialog mit Unternehmen ein. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### III. ESG-Sektor-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

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?**  
k.A.
- **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?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k.A.

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman US Large Cap Value Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300J88053TDGDPM52

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser 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?

**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**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Sofem in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Klimarisiken, THG-Emissionen, Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Wasserbewirtschaftung, Energiemanagement, Abfallentsorgung, Kraftstoffeffizienz, Gelegenheiten für saubere Technologien, Management des Produktlebenszyklus, Materialbeschaffung und Chemikaliensicherheit.
- **Soziale Merkmale:** Betriebssicherheit und Krisenvorsorge, Zugang zu Finanzmitteln, Zugang zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen im Gemeinwesen, Datenschutz und -sicherheit, Gesundheit und Ernährung, Preistransparenz, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Vielfalt und Integration in der Belegschaft, Geschäftsethik, Produktsicherheit, -qualität und -integrität, Management systemischer Risiken, Management des Rechts- und Regulierungsumfelds und Lieferkettenmanagement.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Chancen und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB China ESG Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („NB“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Unternehmen wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss. Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes NB-ESG-Quotient-Rating aufweisen, um eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachen) zu erreichen.

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

| Bezugszeitraum           | Rating          | Bereich           | Kombinierte Abdeckung |
|--------------------------|-----------------|-------------------|-----------------------|
| <b>NB-ESG-Quotient</b>   | ES: B<br>G: 2,0 | ES: A-D<br>G: 1-4 | 100 %                 |
| <b>Daten von Dritten</b> | 6,5             | 0-10              |                       |

Im Hinblick auf das NB-ESG-Quotient-Rating für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale („ES“) werden die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance („G“) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jedes im Portfolio gehaltene Unternehmen erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums erfasste Climate Value-at-Risk („CVaR“) das Ausmaß der Risiken und der Chancen des Klimaübergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmen.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

|  |         |
|--|---------|
| Der CVaR prognostizierte, dass ein Szenario der Klimaerwärmung beim verwalteten Vermögen im Bezugszeitraum zu folgendem Wertverlust führen könnte. | -22,1 % |
| CVaR-Abdeckung im Bezugszeitraum   | 98 %    |

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy und die sonstigen spezifischen Ausschlüsse identifiziert wurden, die im SFDR-Anhang des Portfolios angegeben sind, oder nicht mit diesen vereinbar waren. Zudem investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser

vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („UNGC-Grundsätze“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („OECD-Leitsätze“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („UNGP“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („ILO-Normen“) verstießen.

Bei der Anwendung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

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

Ausnahmsweise wurden für den Bezugszeitraum 2022 die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgte (sie umfassen die Veröffentlichung der SFDR-Vorlagen für vorvertragliche Informationen).

1. NB-ESG-Quotient

|                            | <b>NB-ESG-Quotient-Rating</b> | <b>Rating der Daten durch externe Anbieter</b> | <b>Kombinierte Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| <b>Bereich</b>             | ES: A-D<br>G: 1-4             | 0-10   | 0-100 %                      |
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | ES: B<br>G: 2,0               | 6,8  | 100 %                        |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | ES: B<br>G: 2,2               | 6,6  | 95 %                         |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | ES: B<br>G: 2,0               | 6,5  | 100 %                        |

2. CVaR

|                            | <b>CVaR</b> | <b>Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------|------------------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | -18,5 %     | 96 %             |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | -23,8 %     | 95 %             |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | -22,1 %     | 98 %             |

### 3. Ausschlüsse

|                     | Gesamtzahl der Verstöße |
|---------------------|-------------------------|
| Bezugszeitraum 2022 | 0                       |
| Bezugszeitraum 2023 | 0                       |
| Bezugszeitraum 2024 | 0                       |

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager nicht in Unternehmen investiert, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die ILO-Normen, die UNGC-Grundsätze und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst 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.

*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 EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

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

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



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

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, wichtigste nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren zu berücksichtigen.



### Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat den Bloomberg Industry Classification Standard („BICS“) verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2024 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2024 – 31. Dezember 2024

| Größte Investitionen         | Sektor                      | In % der Vermögenswerte | Land |
|------------------------------|-----------------------------|-------------------------|------|
| EXXON MOBIL CORP             | ENERGIE                     | 4,0                     | USA  |
| JOHNSON & JOHNSON            | NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 3,7                     | USA  |
| PROCTER & GAMBLE CO/THE      | NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 3,2                     | USA  |
| DUKE ENERGY CORP             | VERSORGUNG                  | 3,0                     | USA  |
| WALMART INC                  | ZYKLISCHE KONSUMGÜTER       | 2,9                     | USA  |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | FINANZWERTEN                | 2,8                     | USA  |
| JPMORGAN CHASE & CO          | FINANZWERTEN                | 2,8                     | USA  |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B  | FINANZWERTEN                | 2,5                     | USA  |
| SEMPRA                       | VERSORGUNG                  | 2,4                     | USA  |
| DTE ENERGY COMPANY           | VERSORGUNG                  | 2,2                     | USA  |
| DANAHER CORP                 | NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 2,2                     | USA  |
| PFIZER INC                   | NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 2,1                     | USA  |
| FREEMPORT-MCMORAN INC        | GRUNDSTOFFE                 | 2,0                     | USA  |

|                              |                                |     |        |
|------------------------------|--------------------------------|-----|--------|
| WHEATON PRECIOUS METALS CORP | GRUNDSTOFFE                    | 2,0 | KANADA |
| KROGER CO                    | NICHT-ZYKLISCHE<br>KONSUMGÜTER | 2,0 | USA    |

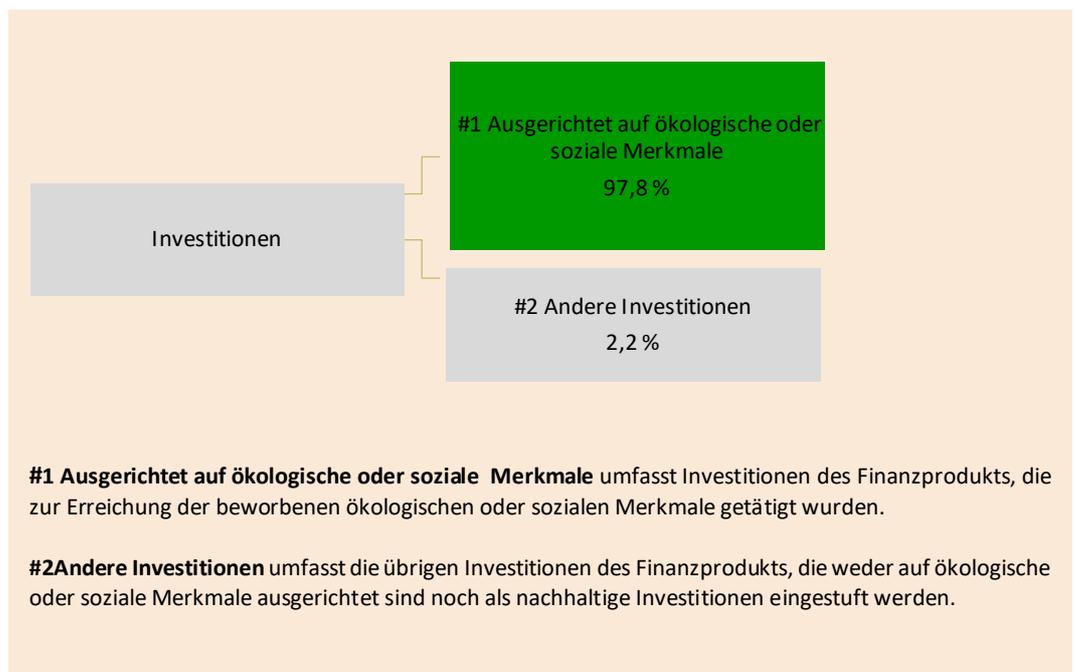


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### ● *Wie sah die Vermögensallokation aus?*

Die Vermögensallokation des Portfolios im Bezugszeitraum wird in nachstehender Grafik dargestellt. Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder externen Anbietern beruhen.



● *In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?*

| <b>Wirtschaftssektoren - BICS</b> | <b>In % der Vermögenswerte</b> |
|-----------------------------------|--------------------------------|
| NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER       | 31,8                           |
| FINANZWERTEN                      | 20,0                           |
| VERSORGUNG                        | 12,8                           |
| GRUNDSTOFFE                       | 10,8                           |
| ENERGIE                           | 6,5                            |
| ZYKLISCHE KONSUMGÜTER             | 6,1                            |
| INDUSTRIE                         | 5,0                            |
| TECHNOLOGIE                       | 5,0                            |
| KOMMUNIKATION                     | 2,0                            |



## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichte Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

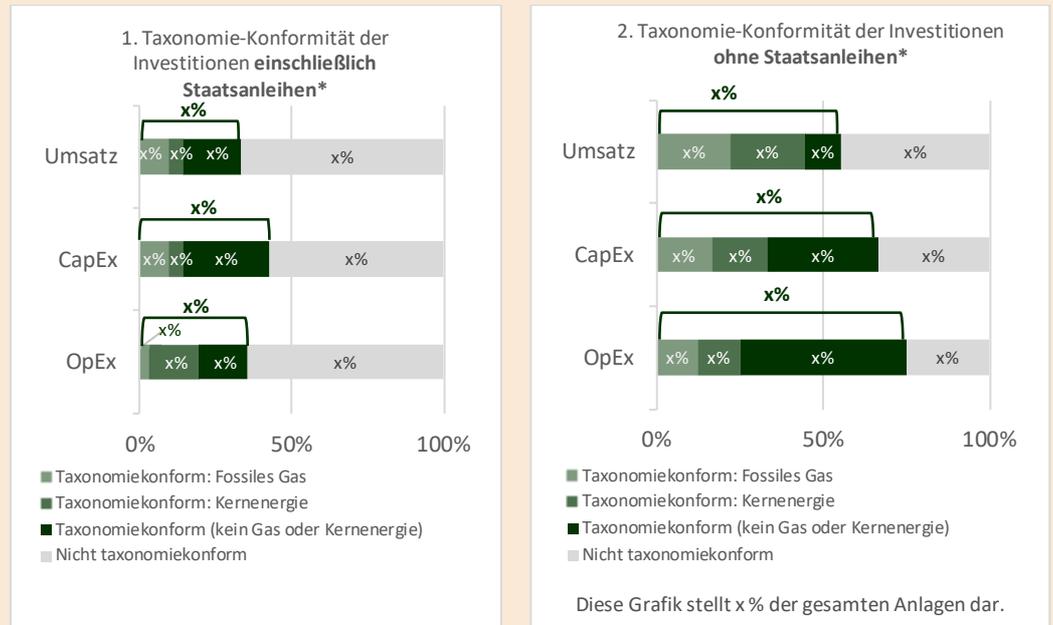
- Ja:  
 In fossiles Gas  In Kernenergie  
 Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten 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 Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. 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.



\* 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?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



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 nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.



### Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.



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

„Andere Investitionen“ umfasst die übrigen Investitionen des Portfolios, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren noch als nachhaltige Investitionen eingestuft wurden.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### **I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:**

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten sowie Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde herangezogen, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung besser zu erkennen. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die Gesamtbetrachtung der Unternehmen bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

### **II. Mitwirkung:**

Der Sub-Investment-Manager arbeitete mit den Unternehmen mit einem soliden ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### **III. ESG-Sektor-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:**

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

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?**  
k.A.
- **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?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k.A.

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman US Long Short Equity Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 54930034RCIO16VO2Z23

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser 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?

**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**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

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

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Klimarisiken, THG-Emissionen, Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Wasserbewirtschaftung, Energiemanagement, Abfallentsorgung, Kraftstoffeffizienz, Gelegenheiten für saubere Technologien, Management des Produktlebenszyklus, Materialbeschaffung und Chemikaliensicherheit.
- **Soziale Merkmale:** Betriebssicherheit und Krisenvorsorge, Zugang zu Finanzmitteln, Zugang zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen im Gemeinwesen, Datenschutz und -sicherheit, Gesundheit und Ernährung, Preistransparenz, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Vielfalt und Integration in der Belegschaft, Geschäftsethik, Produktsicherheit, -qualität und -integrität, Management systemischer Risiken, Management des Rechts- und Regulierungsumfelds und Lieferkettenmanagement.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

### ● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Der ESG-Rahmen fand auf das Long-Segment des Portfolios Anwendung, das einen mehrjährigen Anlagehorizont verfolgt. Die Short-Positionen des Sub-Investment-Managers werden über Derivate zum Ausdruck gebracht und waren daher nicht zur Berücksichtigung von ESG-Faktoren verpflichtet. Genauere Angaben zur erwarteten Long/Short-Allokation des Portfolios finden sich im Abschnitt „*Anlageansatz*“ des Nachtrags.

Grundlage des NB China ESG Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**NB**“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentrierte, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteten ESG-Daten erstellt. Ergänzend kommen interne qualitative Analysen hinzu, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analyistentams des Sub-Investment-Managers genutzt wird. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Unternehmen wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss. Unternehmen mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient- oder externen Rating hatten eine bessere Chance, in das Long-Segment des Portfolios aufgenommen zu werden. Unternehmen mit einem schlechten NB-ESG-Quotient- oder externen Rating, insbesondere dann, wenn ein Unternehmen diesbezüglich keine Maßnahmen ergriff, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Long-Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Long-Segment des Portfolios entfernt. Darüber hinaus bemühte sich der Sub-Investment-Manager, konstruktiven Dialogen bei Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient- oder externen Rating Vorrang einzuräumen, um zu beurteilen, ob Bedenken angemessen berücksichtigt wurden.

| Bezugszeitraum    | Rating | Bereich | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|--------|---------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient   | ES: B  | ES: A-D | 98 %                  |
|                   | G:2.2  | G: 1-4  |                       |
| Daten von Dritten | 6,4    | 0-10    |                       |

Im Hinblick auf das NB-ESG-Quotient-Rating für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale („ES“) werden die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance („G“) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jedes im Portfolio gehaltene Unternehmen erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Bewertungen der Daten Dritter reichen von 0 bis 10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums erfasste Climate Value-at-Risk („**CVaR**“) das Ausmaß der Risiken und der Chancen des Klimaübergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmen.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

|  |         |
|--|---------|
| Der CVaR prognostizierte, dass ein Szenario der Klimaerwärmung beim verwalteten Vermögen im Bezugszeitraum zu folgendem Wertverlust führen könnte. | -11,7 % |
| CVaR-Abdeckung im Bezugszeitraum.  | 74 %    |

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Suv-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy und die sonstigen spezifischen Ausschlüsse identifiziert wurden, die im SFDR-Anhang des Portfolios angegeben sind, oder nicht mit diesen vereinbar waren. Zudem investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („UNGC-Grundsätze“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („OECD-Leitsätze“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („UNGP“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („ILO-Normen“) verstießen.

Lediglich Long-Positionen wurden durch die vorstehend aufgeführte NB-ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik abgedeckt.

Bei der Anwendung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik verstießen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

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

Ausnahmsweise wurden für den Bezugszeitraum 2022 die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgte (sie umfassen die Veröffentlichung der SFDR-Vorlagen für vorvertragliche Informationen).

1. NB-ESG-Quotient

|                            | <b>NB-ESG-Quotient-Rating</b> | <b>Rating der Daten durch externe Anbieter</b> | <b>Kombinierte Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| <b>Bereich</b>             | ES: A-D<br>G: 1-4             | 0-10   | 0-100 %                      |
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | ES: B<br>G: 2,2               | 6,5  | 98 %                         |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | ES: B<br>G: 2,2               | 6,3  | 81 %                         |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | ES: B<br>G: 2,2               | 6,4  | 98 %                         |

Angesichts des Engagements des Portfolios in Short-Positionen (die nicht als Investitionen erachtet werden, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen) kann es eine Herausforderung sein, ein hohes Niveau der kombinierten Abdeckung im gesamten Portfolio aufrechtzuerhalten. Die ESG-Analyse wird intern durchgeführt, mit Unterstützung durch die

Daten externer Anbieter, und nicht ausgelagert. Der Sub-Investment-Manager nimmt auf kontinuierlicher Basis Bewertungen dieser ESG-Merkmale vor. Von Zeit zu Zeit kann es vorkommen, dass einem Unternehmen zum Zeitpunkt der Anlage für einen kurzen Zeitraum kein NB-ESG-Quotient-Rating zugewiesen wird. Der Sub-Investment-Manager steht in regelmäßigen Abständen mit externen Anbietern von ESG-Daten in Kontakt, um Themen wie die Datenabdeckung zu diskutieren und Optionen zur Behebung von Datenlücken zu prüfen. Die Nutzung mehrerer externer Anbieter von ESG-Daten ermöglicht es dem Sub-Investment-Manager, die Datenabdeckung und die Qualität der Daten der externen Anbieter von ESG-Daten zu bewerten. Darüber hinaus prüft der Sub-Investment-Manager weiterhin neue ESG-Datenprodukte und externe Anbieter von ESG-Daten, um potenzielle Verbesserungen unserer bestehenden ESG-Datenabdeckung zu bewerten.

## 2. CVaR

|                            | CVaR    | Abdeckung |
|----------------------------|---------|-----------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | -16,6 % | 59 %      |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | -21,5 % | 68 %      |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | -11,7 % | 74 %      |

## 3. Ausschlüsse

|                            | Gesamtzahl der Verstöße |
|----------------------------|-------------------------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 0                       |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 0                       |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 0                       |

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?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

*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 EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

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

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

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager nicht in Unternehmen investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit ihnen übereinstimmten), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



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

Nicht zutreffend – Dieses Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, wichtigste nachteilige Auswirkungen zu berücksichtigen.



### Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat den Bloomberg Industry Classification Standard („BICS“) verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2024 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2024 – 31. Dezember 2024

| Größte Investitionen       | Sektor                | In % der Vermögenswerte | Land |
|----------------------------|-----------------------|-------------------------|------|
| MICROSOFT CORP             | TECHNOLOGIE           | 5,5                     | USA  |
| AMAZON.COM INC             | KOMMUNIKATION         | 4,6                     | USA  |
| ALPHABET INC-CL A          | KOMMUNIKATION         | 3,6                     | USA  |
| APPLE INC                  | TECHNOLOGIE           | 3,5                     | USA  |
| META PLATFORMS INC-CLASS A | KOMMUNIKATION         | 3,5                     | USA  |
| SALESFORCE INC             | TECHNOLOGIE           | 2,6                     | USA  |
| MCDONALDS CORP             | ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 2,6                     | USA  |

|                         |                                |     |     |
|-------------------------|--------------------------------|-----|-----|
| NVIDIA CORP             | TECHNOLOGIE                    | 2,6 | USA |
| JPMORGAN CHASE & CO     | FINANZWERTEN                   | 2,4 | USA |
| TJX COMPANIES INC       | ZYKLISCHE KONSUMGÜTER          | 2,0 | USA |
| KEURIG DR PEPPER INC    | NICHT-ZYKLISCHE<br>KONSUMGÜTER | 2,0 | USA |
| NEXTERA ENERGY INC      | VERSORGUNG                     | 2,0 | USA |
| MASTERCARD INC - A      | FINANZWERTEN                   | 1,9 | USA |
| UNION PACIFIC CORP      | INDUSTRIE                      | 1,8 | USA |
| VISA INC-CLASS A SHARES | FINANZWERTEN                   | 1,8 | USA |

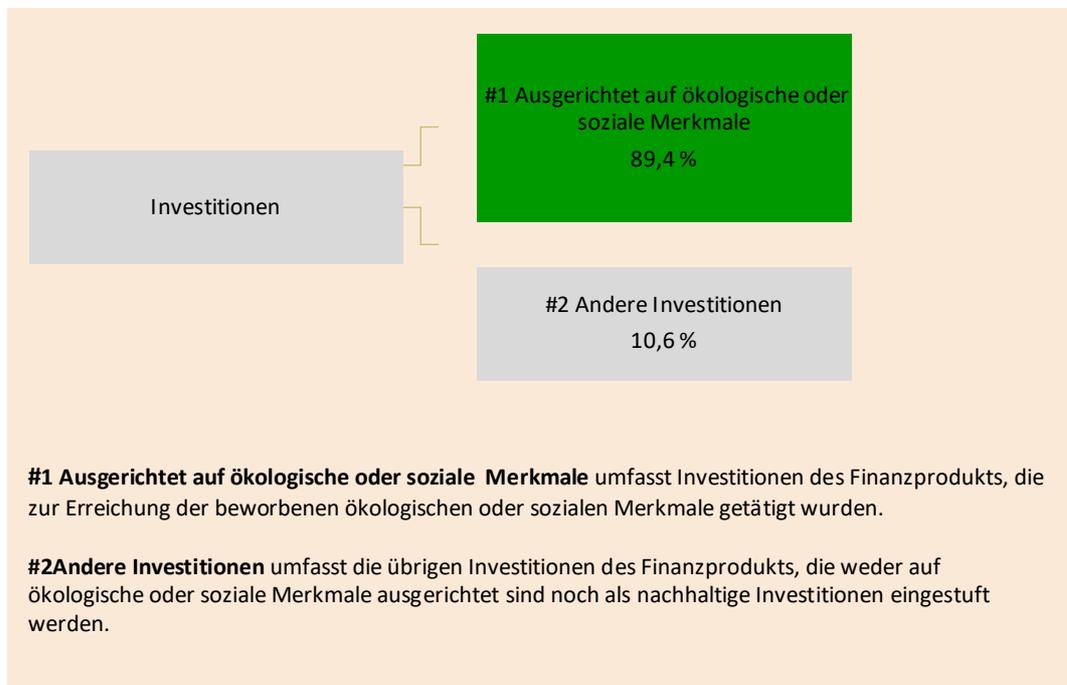


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

### ● *Wie sah die Vermögensallokation aus?*

Die Vermögensallokation des Portfolios im Bezugszeitraum wird in nachstehender Grafik dargestellt. Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder externen Anbietern beruhen.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.



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

| Wirtschaftssektoren - BICS  | In % der Vermögenswerte |
|-----------------------------|-------------------------|
| TECHNOLOGIE                 | 25,6                    |
| KOMMUNIKATION               | 18,4                    |
| NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 14,6                    |
| FINANZWERTEN                | 12,1                    |
| ZYKLISCHE KONSUMGÜTER       | 11,2                    |
| INDUSTRIE                   | 9,0                     |
| VERSORGUNG                  | 6,0                     |
| ENERGIE                     | 1,8                     |
| KEINE                       | 0,8                     |
| KREDIT                      | 0,3                     |
| GRUNDSTOFFE                 | 0,2                     |

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

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

**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



**Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?**

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

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

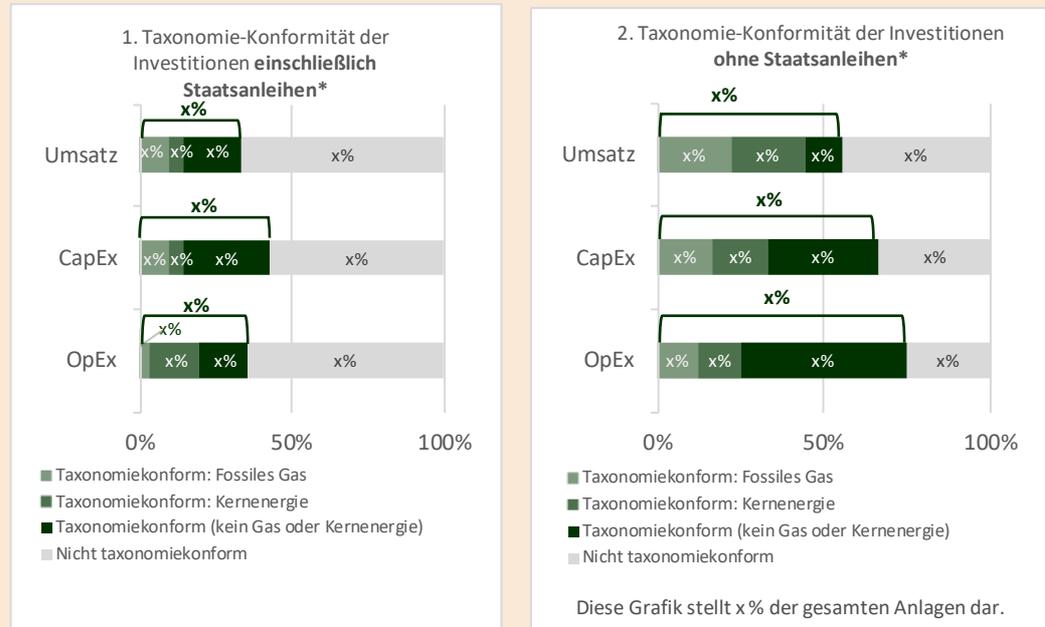
- Ja:
- In fossiles Gas     In Kernenergie
- Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten 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 Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. 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.



\* 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?**  
Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.
- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**  
Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



**Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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

„Andere Investitionen“ umfasst die übrigen Investitionen des Portfolios, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren noch als nachhaltige Investitionen eingestuft wurden.



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

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### **I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:**

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten sowie Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient- oder externe Rating für Unternehmen wurde herangezogen, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung besser zu erkennen.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient und das externe Rating) in die Gesamtbetrachtung der Unternehmen bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

### **II. Mitwirkung:**

Der Sub-Investment-Manager trat in einen Dialog mit Unternehmen ein. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses für das Long-Segment. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### III. ESG-Sektor-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Um sicherzustellen, dass die im Long-Segment des Portfolios beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Long-Segment des Portfolios die oben erwähnte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.

Wie vorstehend erwähnt, werden lediglich Long-Positionen durch die vorstehend aufgeführte NB-ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik abgedeckt.



### Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

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

k.A.

- **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?**

k.A.

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

k.A.

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

k.A.

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

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman US Multi Cap Opportunities Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300K77TBAIVA0NY51

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser 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?

**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**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Sofem in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Klimarisiken, THG-Emissionen, Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Wasserbewirtschaftung, Energiemanagement, Abfallentsorgung, Kraftstoffeffizienz, Gelegenheiten für saubere Technologien, Management des Produktlebenszyklus, Materialbeschaffung und Chemikaliensicherheit.
- **Soziale Merkmale:** Betriebssicherheit und Krisenvorsorge, Zugang zu Finanzmitteln, Zugang zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen im Gemeinwesen, Datenschutz und -sicherheit, Gesundheit und Ernährung, Preistransparenz, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Vielfalt und Integration in der Belegschaft, Geschäftsethik, Produktsicherheit, -qualität und -integrität, Management systemischer Risiken, Management des Rechts- und Regulierungsumfelds und Lieferkettenmanagement.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB China ESG Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („NB“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sekorkriterium wurde unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analyistenteam für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Unternehmen wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss. Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes NB-ESG-Quotient-Rating aufweisen, um eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachen) zu erreichen.

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

| Bezugszeitraum    | Rating          | Bereich               | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|-----------------|-----------------------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient   | ES: B<br>G: 2,0 | ES: A-D<br><br>G: 1-4 | 100 %                 |
| Daten von Dritten | 6,4             | 0-10                  |                       |

Im Hinblick auf das NB-ESG-Quotient-Rating für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale („ES“) werden die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance („G“) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jedes im Portfolio gehaltene Unternehmen erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums erfasste Climate Value-at-Risk („CVaR“) das Ausmaß der Risiken und der Chancen des Klimaübergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmen.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

|  |         |
|--|---------|
| Der CVaR prognostizierte, dass ein Szenario der Klimaerwärmung beim verwalteten Vermögen im Bezugszeitraum zu folgendem Wertverlust führen könnte. | -14,0 % |
| CVaR-Abdeckung im Bezugszeitraum.  | 100 %   |

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

### 3. ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy und die sonstigen spezifischen Ausschlüsse identifiziert wurden, die im SFDR-Anhang des Portfolios angegeben sind, oder nicht mit diesen vereinbar waren. Zudem investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit dieser vereinbar waren), wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischen Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

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

Ausnahmsweise wurden für den Bezugszeitraum 2022 die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgte (sie umfassen die Veröffentlichung der SFDR-Vorlagen für vorvertragliche Informationen).

#### 1. NB-ESG-Quotient

|                            | <b>NB-ESG-Quotient-Rating</b> | <b>Rating der Daten durch externe Anbieter</b> | <b>Kombinierte Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| <b>Bereich</b>             | ES: A-D<br>G: 1-4             | 0-10   | 0-100 %                      |
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | ES: C<br>G: 2,3               | 6,2  | 99 %                         |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | ES: B<br>G: 2,2               | 6,2  | 99 %                         |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | ES: B<br>G: 2,0               | 6,4  | 100 %                        |

## 2. CVaR

|                            | CVaR    | Abdeckung |
|----------------------------|---------|-----------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | -12,6 % | 99 %      |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | -15,6 % | 99 %      |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | -14,0 % | 100 %     |

## 3. Ausschlüsse

|                            | Gesamtzahl der Verstöße |
|----------------------------|-------------------------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 0                       |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 0                       |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 0                       |

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager nicht in Unternehmen investiert, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die ILO-Normen, die UNGC-Grundsätze und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst 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.

*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 EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

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

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



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

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Unternehmen durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

| <b>PAIs auf Produktebene</b>      |  |
|-----------------------------------|--|
| <b>Thema</b>                      | <b>Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen</b>   |
| <i>Treibhausgasemissionen</i>     | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind  |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen<br>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen<br>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



### Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat den Bloomberg Industry Classification Standard („**BICS**“) verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2024 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2024 – 31. Dezember 2024

| Größte Investitionen         | Sektor                      | In % der Vermögenswerte | Land   |
|------------------------------|-----------------------------|-------------------------|--------|
| MICROSOFT CORP               | TECHNOLOGIE                 | 5,5                     | USA    |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B  | FINANZWERTEN                | 5,3                     | USA    |
| ALPHABET INC-CL C            | KOMMUNIKATION               | 4,9                     | USA    |
| APPLE INC                    | TECHNOLOGIE                 | 4,5                     | USA    |
| BROOKFIELD CORP              | FINANZWERTEN                | 3,9                     | KANADA |
| AMAZON.COM INC               | KOMMUNIKATION               | 3,8                     | USA    |
| GRAPHIC PACKAGING HOLDING CO | INDUSTRIE                   | 3,6                     | USA    |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC       | KOMMUNIKATION               | 3,4                     | USA    |
| HCA HEALTHCARE INC           | NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 3,3                     | USA    |
| ARAMARK                      | ZYKLISCHE KONSUMGÜTER       | 3,2                     | USA    |
| JPMORGAN CHASE & CO          | FINANZWERTEN                | 3,1                     | USA    |
| US FOODS HOLDING CORP        | NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 3,0                     | USA    |
| APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC | FINANZWERTEN                | 2,9                     | USA    |
| T-MOBILE US INC              | KOMMUNIKATION               | 2,9                     | USA    |
| CSX CORP                     | INDUSTRIE                   | 2,7                     | USA    |

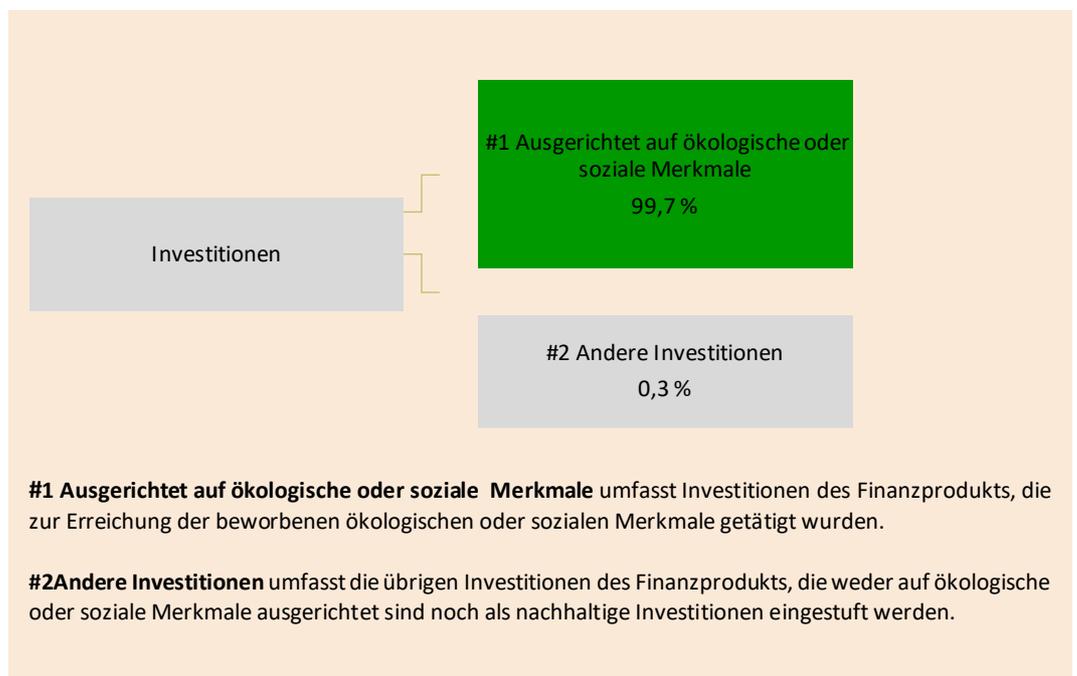


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### ● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Die Vermögensallokation des Portfolios im Bezugszeitraum wird in nachstehender Grafik dargestellt. Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnungen basierten auf Marktbewertungen des Portfolios und können auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder Dritten basieren.



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

| Wirtschaftssektoren - BICS  | In % der Vermögenswerte |
|-----------------------------|-------------------------|
| FINANZWERTEN                | 21,4                    |
| INDUSTRIE                   | 17,5                    |
| NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 16,9                    |
| KOMMUNIKATION               | 16,4                    |
| TECHNOLOGIE                 | 14,5                    |
| ZYKLISCHE KONSUMGÜTER       | 9,3                     |
| ENERGIE                     | 2,5                     |
| VERSORGUNG                  | 1,5                     |

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Bei-trag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

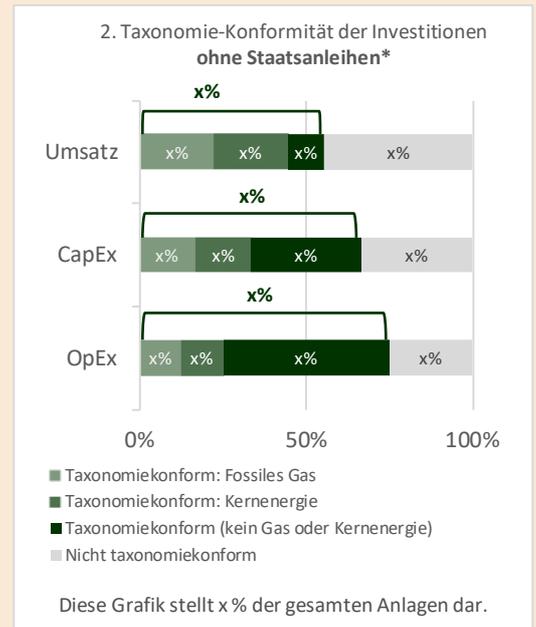
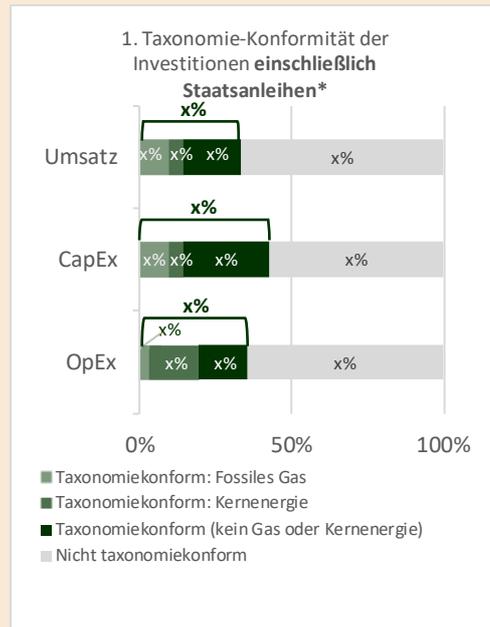
- Ja:  
 In fossiles Gas  In Kernenergie
- Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten 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 Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. 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.



\* 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?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



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 nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.



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

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.



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

„Andere Investitionen“ umfasst die übrigen Investitionen des Portfolios, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren noch als nachhaltige Investitionen eingestuft wurden.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### **I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:**

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten sowie Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde herangezogen, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung besser zu erkennen. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die Gesamtbetrachtung der Unternehmen bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

### **II. Mitwirkung:**

Der Sub-Investment-Manager arbeitete mit den Unternehmen mit einem soliden ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### **III. ESG-Sektor-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:**

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



### **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

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?**  
k.A.
- **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?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k.A.

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman US Real Estate Securities Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300T9PUOV1AK0OR82

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser 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?

**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**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Klimarisiken, THG-Emissionen, Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Wasserbewirtschaftung, Energiemanagement, Abfallentsorgung, Kraftstoffeffizienz, Gelegenheiten für saubere Technologien, Materialbeschaffung und Chemikaliensicherheit.
- **Soziale Merkmale:** Betriebssicherheit und Krisenvorsorge, Zugang zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen im Gemeinwesen, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Vielfalt und Integration in der Belegschaft, Geschäftsethik, Produktsicherheit, -qualität und -integrität, Management systemischer Risiken, Management des Rechts- und Regulierungsumfelds und Lieferkettenmanagement.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt. Das NB-ESG-Quotient-Rating wie nachstehend als Gesamtwert ausgewiesen kann gegebenenfalls neben den vorstehend aufgeführten noch weitere ökologische und soziale Merkmale berücksichtigen.

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

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „NB- ESG-Quotient“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB China ESG Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („NB“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteten ESG-Daten erstellt. Ergänzend kommen interne qualitative Analysen hinzu, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analyistenteam des Sub-Investment-Managers genutzt wird. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergreift, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Darüber hinaus bemühte sich der Sub-Investment-Manager, konstruktiven Dialogen bei Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating Vorrang einzuräumen, um zu beurteilen, ob Bedenken angemessen berücksichtigt wurden.

| Bezugszeitraum  | Rating          | Bereich           | Kombinierte Abdeckung |
|-----------------|-----------------|-------------------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient | ES: B<br>G: 2,1 | ES: A-D<br>G: 1-4 |                       |

|                          |     |      |      |
|--------------------------|-----|------|------|
| <b>Daten von Dritten</b> | 6,3 | 0-10 | 99 % |
|--------------------------|-----|------|------|

Im Hinblick auf die NB-ESG-Quotient-Ratings der Aktienemittenten werden für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale („**ES**“) die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance („**G**“) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

## 2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums erfasste Climate Value-at-Risk („**CVaR**“) das Ausmaß der Risiken und der Chancen des Klimaübergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmen.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

|  |         |
|--|---------|
| Der CVaR prognostizierte, dass ein Szenario der Klimaerwärmung beim verwalteten Vermögen im Bezugszeitraum zu folgendem Wertverlust führen könnte. | -12,0 % |
| CVaR-Abdeckung im Bezugszeitraum.  | 97 %    |

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy und die sonstigen spezifischen Ausschlüsse identifiziert wurden, die im SFDR-Anhang des Portfolios angegeben sind, oder nicht mit diesen vereinbar waren. Zudem investierte das Portfolio nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit dieser vereinbar waren), wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischen Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

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

Ausnahmsweise wurden für den Bezugszeitraum 2022 die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgte (sie umfassen die Veröffentlichung der SFDR-Vorlagen für vorvertragliche Informationen).

1. NB-ESG-Quotient

|                            | <b>NB-ESG-Quotient-Rating</b> | <b>Rating der Daten durch externe Anbieter</b> | <b>Kombinierte Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| <b>Bereich</b>             | ES: A-D<br>G: 1-4             | 0-10   | 0-100 %                      |
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | ES: B<br>G: 1,5               | 6,2  | 100 %                        |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | ES: B<br>G: 1,6               | 6,2  | 97 %                         |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | ES: B<br>G: 2,1               | 6,3  | 99 %                         |

## 2. CVaR

|                            | CVaR    | Abdeckung |
|----------------------------|---------|-----------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | -9,8 %  | 93 %      |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | -16,3 % | 95 %      |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | -12,0 % | 97 %      |

## 3. Ausschlüsse

|                            | Gesamtzahl der Verstöße |
|----------------------------|-------------------------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 0                       |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 0                       |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 0                       |

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.

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

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager nicht in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst 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.

*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 EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

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

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



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

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

| <b>PAIs auf Produktebene</b>      |  |
|-----------------------------------|--|
| <b>Thema</b>                      | <b>Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen</b>   |
| <i>Treibhausgasemissionen</i>     | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind  |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen<br>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen<br>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbareren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat den Bloomberg Industry Classification Standard („**BICS**“) verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2024 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2024 – 31. Dezember 2024

| Größte Investitionen      | Sektor       | In % der Vermögenswerte | Land |
|---------------------------|--------------|-------------------------|------|
| AMERICAN TOWER CORP       | FINANZWERTEN | 8,1                     | USA  |
| PROLOGIS INC              | FINANZWERTEN | 8,0                     | USA  |
| EQUINIX INC               | FINANZWERTEN | 7,8                     | USA  |
| PUBLIC STORAGE REIT       | FINANZWERTEN | 5,6                     | USA  |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | FINANZWERTEN | 5,2                     | USA  |
| SIMON PROPERTY GROUP INC  | FINANZWERTEN | 4,8                     | USA  |
| WELLTOWER INC             | FINANZWERTEN | 4,5                     | USA  |
| IRON MOUNTAIN INC         | FINANZWERTEN | 4,0                     | USA  |
| VENTAS INC                | FINANZWERTEN | 4,0                     | USA  |
| SUN COMMUNITIES INC       | FINANZWERTEN | 3,6                     | USA  |
| REALTY INCOME CORP        | FINANZWERTEN | 3,1                     | USA  |
| SBA COMMUNICATIONS CORP   | FINANZWERTEN | 3,1                     | USA  |
| EXTRA SPACE STORAGE INC   | FINANZWERTEN | 3,1                     | USA  |
| CROWN CASTLE INC          | FINANZWERTEN | 2,6                     | USA  |
| CAMDEN PROPERTY TRUST     | FINANZWERTEN | 2,5                     | USA  |

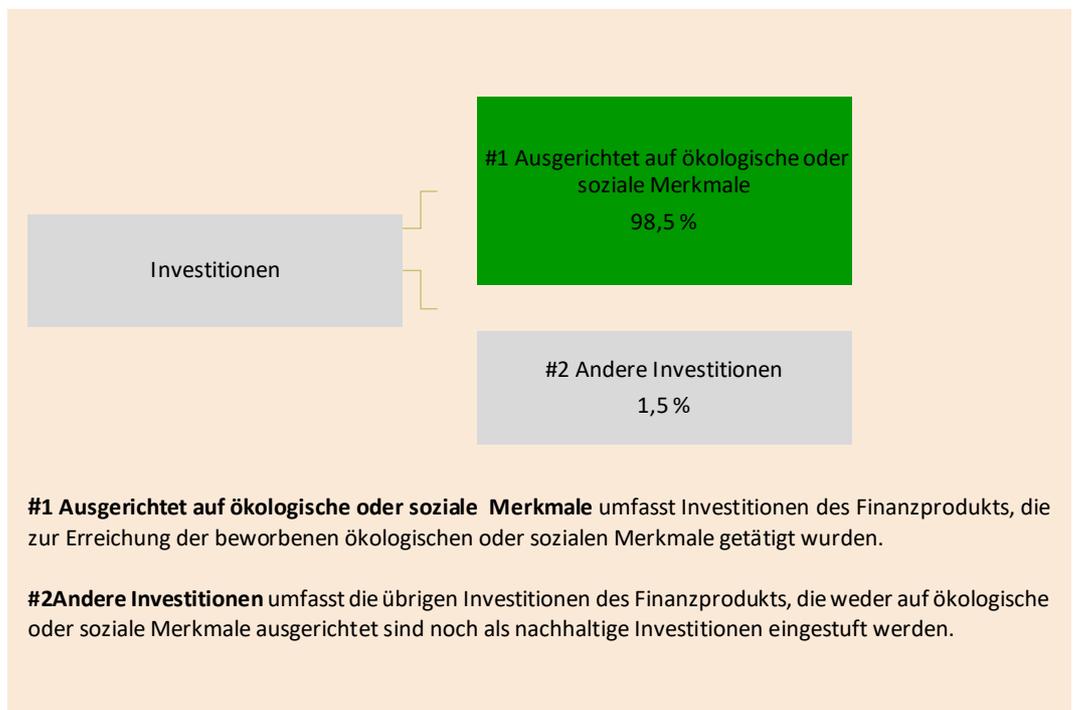


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### ● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Die Vermögensallokation des Portfolios im Bezugszeitraum wird in nachstehender Grafik dargestellt. Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen.



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

| Wirtschaftssektoren - BICS | In % der Vermögenswerte |
|----------------------------|-------------------------|
| FINANZWERTEN               | 99,5                    |
| ZYKLISCHE KONSUMGÜTER      | 0,5                     |



## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

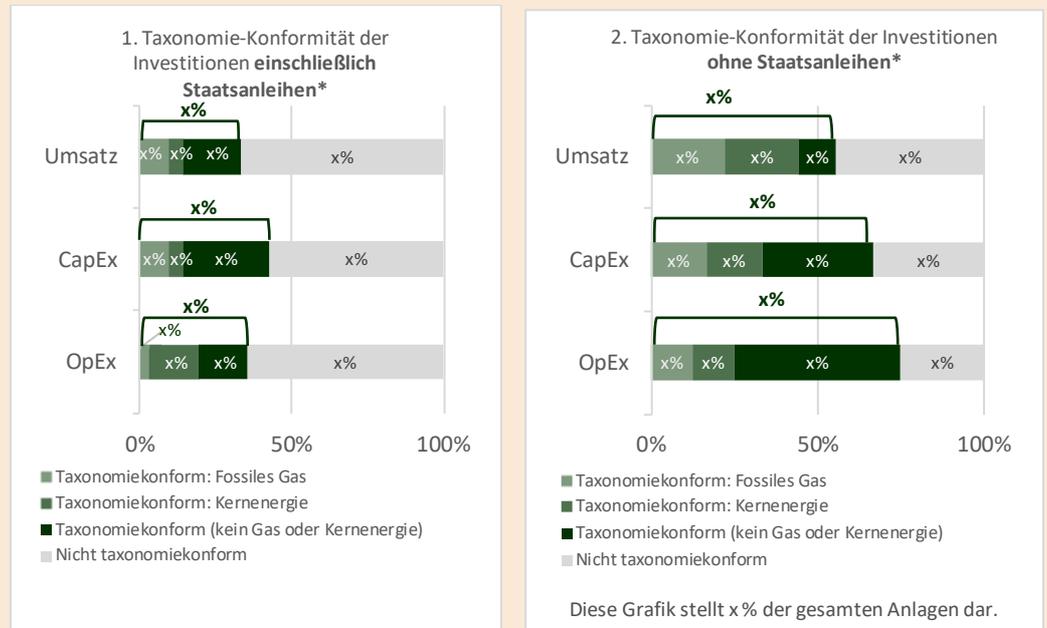
- Ja:
- In fossiles Gas  In Kernenergie
- Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten 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 Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



\* 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?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



### **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.



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

„Andere Investitionen“ umfasst die übrigen Investitionen des Portfolios, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren noch als nachhaltige Investitionen eingestuft wurden.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Emittentenanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten sowie Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde herangezogen, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung besser zu erkennen. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in seine Bewertung bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

### II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### III. ESG-Sektor-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



### **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***  
k.A.
- ***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?***  
k.A.
- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***  
k.A.
- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***  
k.A.

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

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman US Small Cap Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 549300CG2QDECVFZQ378

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser 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?

**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**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Sofem in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Klimarisiken, THG-Emissionen, Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Wasserbewirtschaftung, Energiemanagement, Abfallentsorgung, Kraftstoffeffizienz, Gelegenheiten für saubere Technologien, Management des Produktlebenszyklus, Materialbeschaffung und Chemikaliensicherheit.
- **Soziale Merkmale:** Betriebssicherheit und Krisenvorsorge, Zugang zu Finanzmitteln, Zugang zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen im Gemeinwesen, Datenschutz und -sicherheit, Gesundheit und Ernährung, Preistransparenz, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Vielfalt und Integration in der Belegschaft, Geschäftsethik, Produktsicherheit, -qualität und -integrität, Management systemischer Risiken, Management des Rechts- und Regulierungsumfelds und Lieferkettenmanagement. .

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

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

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB China ESG Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („NB“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektoorkriterium wurde unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analyistenteam für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Unternehmen wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss. Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes NB-ESG-Quotient-Rating aufweisen, um eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachen) zu erreichen.

| Bezugszeitraum    | Rating          | Bereich           | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|-----------------|-------------------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient   | ES: C<br>G: 2,4 | ES: A-D<br>G: 1-4 | 100 %                 |
| Daten von Dritten | 5,8             | 0-10              |                       |

Im Hinblick auf das NB-ESG-Quotient-Rating für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale („ES“) werden die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance („G“) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jedes im Portfolio gehaltene Unternehmen erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

## 2. ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy und die sonstigen spezifischen Ausschlüsse identifiziert wurden, die im SFDR-Anhang des Portfolios angegeben sind, oder nicht mit diesen vereinbar waren. Zudem investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („UNGC-Grundsätze“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („OECD-Leitsätze“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („UNGP“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („ILO-Normen“) verstießen.

Bei der Anwendung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

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

Ausnahmsweise wurden für den Bezugszeitraum 2022 die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgte (sie umfassen die Veröffentlichung der SFDR-Vorlagen für vorvertragliche Informationen).

1. NB-ESG-Quotient

|                            | <b>NB-ESG-Quotient-Rating</b> | <b>Rating der Daten durch externe Anbieter</b> | <b>Kombinierte Abdeckung</b> |
|----------------------------|-------------------------------|--|------------------------------|
| <b>Bereich</b>             | ES: A-D<br>G: 1-4             | 0-10   | 0-100 %                      |
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | ES: C<br>G: 2,3               | 5,4  | 100 %                        |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | ES: C<br>G: 2,3               | 5,6  | 99 %                         |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | ES: C<br>G: 2,4               | 5,8  | 100 %                        |

2. Ausschlüsse

|                            | <b>Gesamtzahl der Verstöße</b> |
|----------------------------|--------------------------------|
| <b>Bezugszeitraum 2022</b> | 0                              |
| <b>Bezugszeitraum 2023</b> | 0                              |
| <b>Bezugszeitraum 2024</b> | 0                              |

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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?**

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager nicht in Unternehmen investiert, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die ILO-Normen, die UNGC-Grundsätze und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*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 EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



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

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Unternehmen durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

| <b>PAIs auf Produktebene</b>      |  |
|-----------------------------------|--|
| <b>Thema</b>                      | <b>Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen</b>   |
| <i>Treibhausgasemissionen</i>     | PAI 1 - THG-Emissionen<br>PAI 2 - CO <sub>2</sub> -Fußabdruck<br>PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird<br>PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind  |
| <i>Soziales und Beschäftigung</i> | PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen<br>PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen<br>PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) |

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat den Bloomberg Industry Classification Standard („BICS“) verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2024 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2024 – 31. Dezember 2024

| Größte Investitionen       | Sektor                      | In % der Vermögenswerte | Land   |
|----------------------------|-----------------------------|-------------------------|--------|
| MANHATTAN ASSOCIATES INC   | TECHNOLOGIE                 | 2,2                     | USA    |
| FAIR ISAAC CORP            | TECHNOLOGIE                 | 2,2                     | USA    |
| KIRBY CORP                 | INDUSTRIE                   | 2,1                     | USA    |
| EAGLE MATERIALS INC        | INDUSTRIE                   | 1,9                     | USA    |
| SPS COMMERCE INC           | TECHNOLOGIE                 | 1,9                     | USA    |
| RBC BEARINGS INC           | INDUSTRIE                   | 1,9                     | USA    |
| CHEMED CORP                | NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 1,8                     | USA    |
| TETRA TECH INC             | INDUSTRIE                   | 1,8                     | USA    |
| CSW INDUSTRIALS INC        | INDUSTRIE                   | 1,7                     | USA    |
| KADANT INC                 | INDUSTRIE                   | 1,7                     | USA    |
| HAEMONETICS CORP/MASS      | NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 1,7                     | USA    |
| VALMONT INDUSTRIES         | INDUSTRIE                   | 1,7                     | USA    |
| LATTICE SEMICONDUCTOR CORP | TECHNOLOGIE                 | 1,7                     | USA    |
| FIRSTSERVICE CORP          | FINANZWERTEN                | 1,6                     | KANADA |
| TEXAS ROADHOUSE INC        | ZYKLISCHE KONSUMGÜTER       | 1,6                     | USA    |

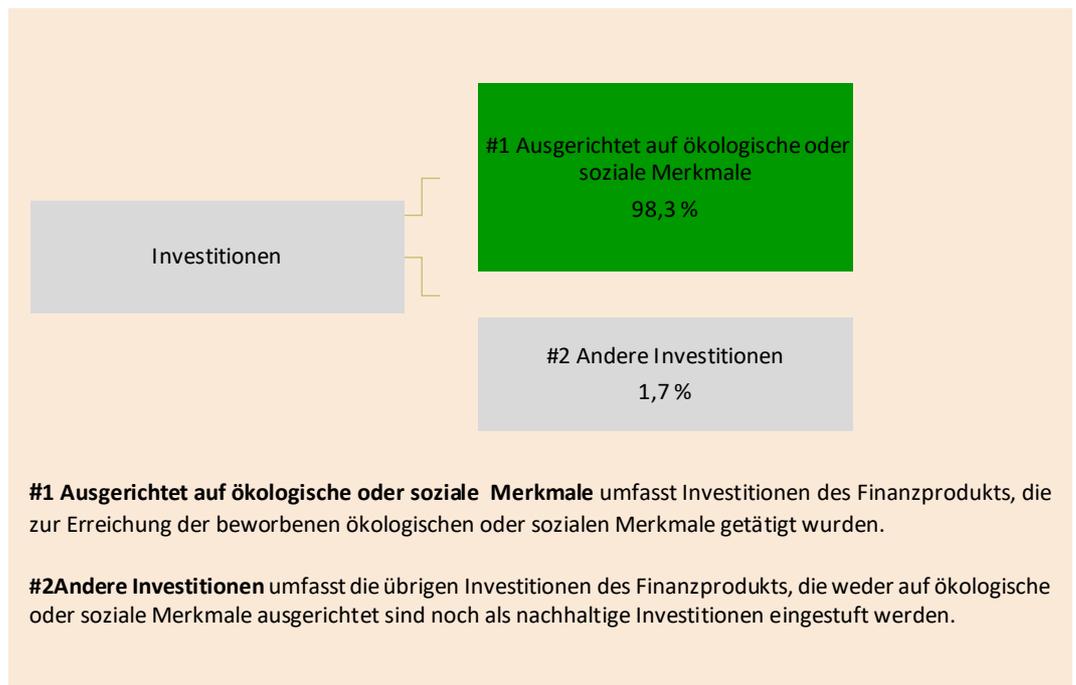


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Vermögensallokation des Portfolios im Bezugszeitraum wird in nachstehender Grafik dargestellt. Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnungen basierten auf Marktbewertungen des Portfolios und können auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder Dritten basieren.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.



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

| Wirtschaftssektoren - BICS  | In % der Vermögenswerte |
|-----------------------------|-------------------------|
| INDUSTRIE                   | 32,9                    |
| NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 17,1                    |
| TECHNOLOGIE                 | 17,1                    |
| FINANZWERTEN                | 12,4                    |
| ZYKLISCHE KONSUMGÜTER       | 10,8                    |
| ENERGIE                     | 5,4                     |
| KOMMUNIKATION               | 1,8                     |
| GRUNDSTOFFE                 | 1,7                     |
| VERSORGUNG                  | 0,8                     |



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

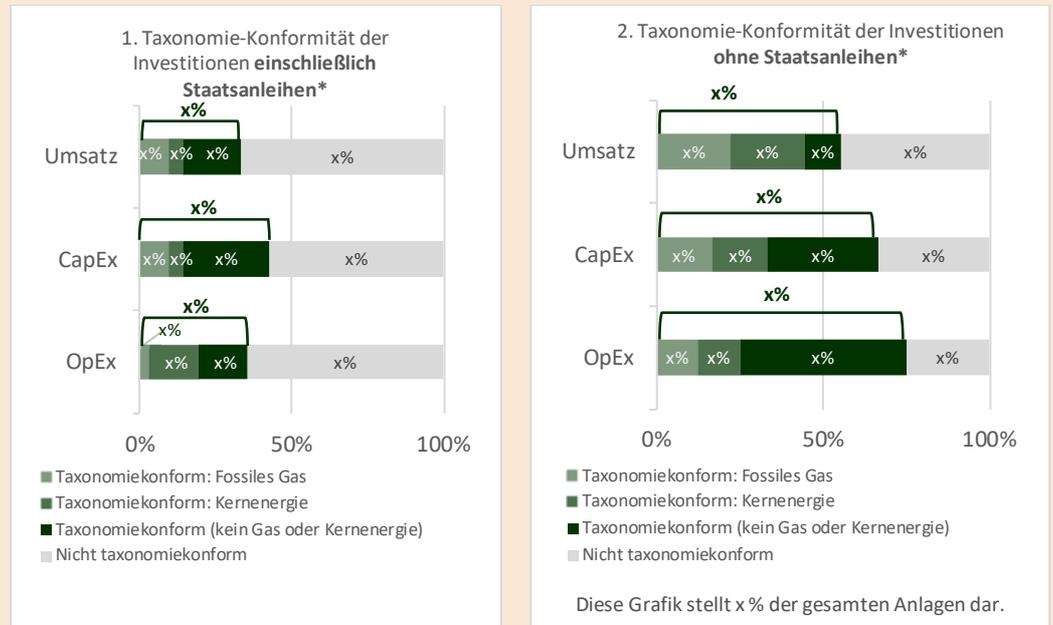
- Ja:
- In fossiles Gas  In Kernenergie
- Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten 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 Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. 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.



\* 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?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



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 nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.



### Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.



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

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

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### **I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:**

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten sowie Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde herangezogen, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung besser zu erkennen. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die Gesamtbetrachtung der Unternehmen bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

### **II. Mitwirkung:**

Der Sub-Investment-Manager arbeitete mit den Unternehmen mit einem soliden ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. ESG-Sektor-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wendete das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



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

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

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?**  
k.A.
- **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?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k.A.

**Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Neuberger Berman US Small Cap Intrinsic Value Fund (das „Portfolio“)

**Unternehmenskennung:** 5493006T4864Y1SNKA49

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser 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?

**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**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie [hier](#).

Das Portfolio wurde am 12. Dezember 2024 zum Artikel-8-Portfolio umklassifiziert. Diese regelmäßige Berichtsvorlage wurde daher auf der Grundlage der Portfoliopositionen zum 31. Dezember 2024 erstellt, da dies das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum ist, das auf die Umklassifizierung des Portfolios folgte (der „**Bezugszeitraum**“).

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



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

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- **Ökologische Merkmale:** Klimarisiken, THG-Emissionen, Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Wasserbewirtschaftung, Energiemanagement, Abfallentsorgung, Kraftstoffeffizienz, Gelegenheiten für saubere Technologien, Management des Produktlebenszyklus, Materialbeschaffung und Chemikaliensicherheit.
- **Soziale Merkmale:** Betriebssicherheit und Krisenvorsorge, Zugang zu Finanzmitteln, Zugang zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen im Gemeinwesen, Datenschutz und -sicherheit, Gesundheit und Ernährung, Preistransparenz, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Vielfalt und Integration in der Belegschaft, Geschäftsethik, Produktsicherheit, -qualität und -integrität, Management systemischer Risiken, Management des Rechts- und Regulierungsumfelds und Lieferkettenmanagement.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

### Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

#### 1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB China ESG Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („NB“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wurde unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Unternehmen wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss. Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes NB-ESG-Quotient-Rating aufweisen, um im Laufe der Zeit eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachen) zu erreichen. Da die Strategie in Unternehmen mit geringer Marktkapitalisierung investiert, weisen ihre Positionen in der Regel weniger vorteilhafte NB-ESG-Quotient-Ratings auf als Unternehmen mit hoher Marktkapitalisierung. Daher erfolgt eine langfristige Mitwirkung des Sub-Investment-Managers in den Unternehmen, in die investiert wird, was im Zeitverlauf zu Verbesserungen der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale führen kann.

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

| Bezugszeitraum    | Rating          | Bereich           | Kombinierte Abdeckung |
|-------------------|-----------------|-------------------|-----------------------|
| NB-ESG-Quotient   | ES: C<br>G: 2,4 | ES: A-D<br>G: 1-4 | 100 %                 |
| Daten von Dritten | 6,8             | 0-10              |                       |

Im Hinblick auf das NB-ESG-Quotient-Rating der Aktienemittenten werden für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale („ES“) die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance („G“) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jedes im Portfolio gehaltene Unternehmen erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewertung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

## 2. ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy und die sonstigen spezifischen Ausschlüsse identifiziert wurden, die im SFDR-Anhang des Portfolios angegeben sind, oder nicht mit diesen vereinbar waren.

Zudem investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Nicht zutreffend – dies ist der erste Bezugszeitraum.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

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

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager nicht in Unternehmen investiert, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die ILO-Normen, die UNGC-Grundsätze und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

*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 EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

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

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.

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



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

Nicht zutreffend – Dieses Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, wichtigste nachteilige Auswirkungen zu berücksichtigen.



### Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat den Bloomberg Industry Classification Standard („**BICS**“) verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Die wichtigsten vom Portfolio zum 31. Dezember 2024 gehaltenen Investitionen waren:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 31. Dezember 2024

| Größte Investitionen         | Sektor                      | In % der Vermögenswerte | Land            |
|------------------------------|-----------------------------|-------------------------|-----------------|
| KYNDRYL HOLDINGS INC         | TECHNOLOGIE                 | 4,0                     | USA             |
| CIENA CORP                   | KOMMUNIKATION               | 3,6                     | USA             |
| CRITEO SA-SPON ADR           | KOMMUNIKATION               | 3,5                     | FRANKREICH      |
| KBR INC                      | TECHNOLOGIE                 | 2,8                     | USA             |
| AERCAP HOLDINGS NV           | FINANZWERTEN                | 2,5                     | IRLAND          |
| ORMAT TECHNOLOGIES INC       | VERSORGUNG                  | 2,4                     | USA             |
| RESIDEO TECHNOLOGIES INC     | ZYKLISCHE KONSUMGÜTER       | 2,4                     | USA             |
| INTERNATIONAL GAME TECHNOLOG | ZYKLISCHE KONSUMGÜTER       | 2,3                     | USA             |
| VEECO INSTRUMENTS INC        | TECHNOLOGIE                 | 2,2                     | USA             |
| AVERY DENNISON CORP          | NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 2,1                     | USA             |
| TECHNIPFMC PLC               | ENERGIE                     | 2,1                     | GROSSBRITANNIEN |
| MACOM TECHNOLOGY SOLUTIONS   | TECHNOLOGIE                 | 2,0                     | USA             |
| OPENLANE INC                 | ZYKLISCHE KONSUMGÜTER       | 1,8                     | USA             |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC    | FINANZWERTEN                | 1,7                     | USA             |
| VISTRA CORP                  | VERSORGUNG                  | 1,6                     | USA             |

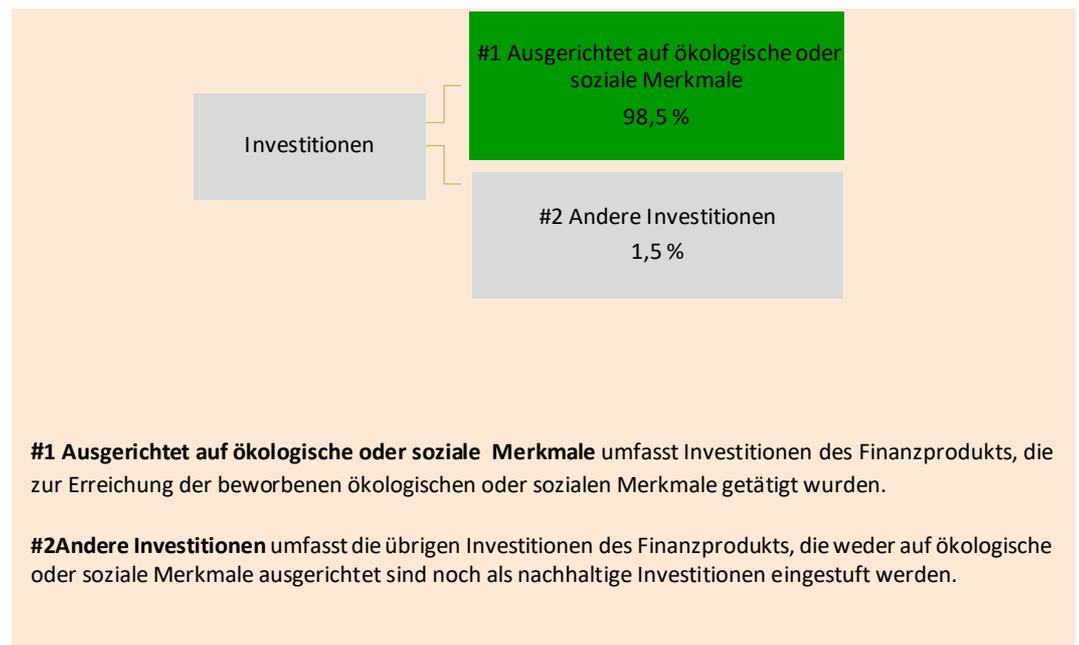


## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

### ● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Die Vermögensallokation des Portfolios im Bezugszeitraum wird in nachstehender Grafik dargestellt. Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder externen Anbietern beruhen.



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

| Wirtschaftssektoren - BICS  | In % der Vermögenswerte |
|-----------------------------|-------------------------|
| TECHNOLOGIE                 | 24,5                    |
| NICHT-ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 14,6                    |
| ZYKLISCHE KONSUMGÜTER       | 13,2                    |
| KOMMUNIKATION               | 11,8                    |
| INDUSTRIE                   | 10,6                    |
| VERSORGUNG                  | 10,5                    |

|              |     |
|--------------|-----|
| FINANZWERTEN | 7,7 |
| ENERGIE      | 6,2 |
| GRUNDSTOFFE  | 0,9 |



Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar er-möglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

### ● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

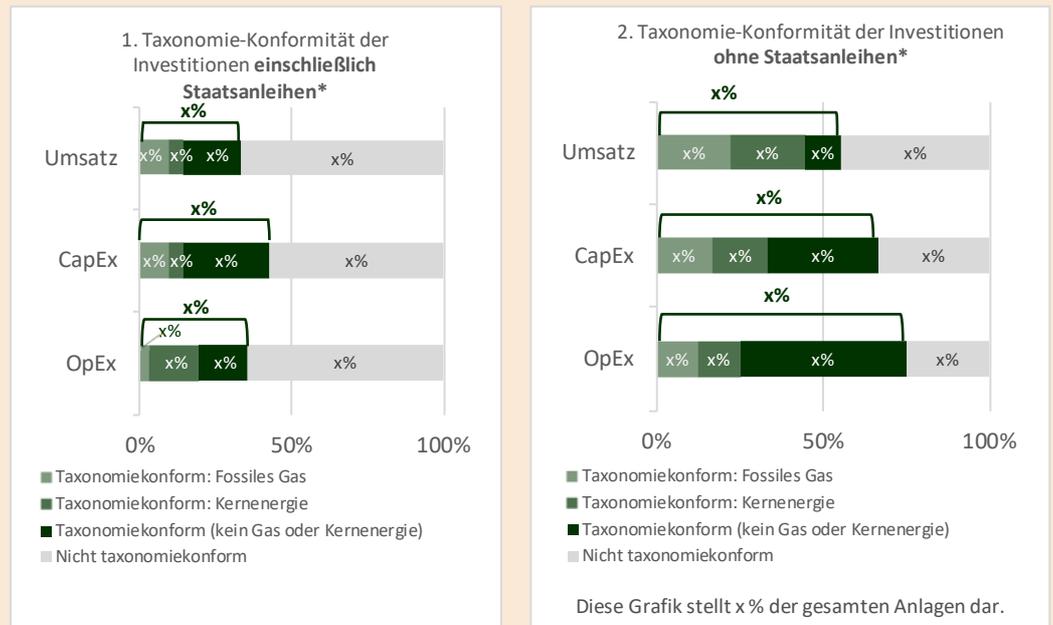
- Ja:
- In fossiles Gas  In Kernenergie
- Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten 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 Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität 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.



\* 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?**

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend – Dies war der erste Bezugszeitraum und das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



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 nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.



### Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.



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

„Andere Investitionen“ umfasst die übrigen Investitionen des Portfolios, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren noch als nachhaltige Investitionen eingestuft wurden.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.



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

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

### I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten sowie Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde herangezogen, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung besser zu erkennen. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient und das externe Rating) in die Gesamtbetrachtung der Unternehmen bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

### II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager trat in einen Dialog mit Unternehmen ein. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

### III. ESG-Sektor-Ausschluss- und Beteiligungspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschluss- und Beteiligungspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

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?**  
k.A.
- **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?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**  
k.A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**  
k.A.

## Zusätzliche Informationen

Dieses Dokument wird von der Neuberger Berman Asset Management Ireland Limited („NBAMIL“) herausgegeben, die durch die irische Zentralbank (Irish Central Bank, „CBI“) zugelassen ist und reguliert wird und in Irland in 2 Central Plaza Dame Street, Dublin 2, eingetragen ist. Vertreter und Zahlstelle in der Schweiz ist BNP Paribas Securities Services, succursale de Zurich, Selnaustrasse 16, 8002 Zürich, Schweiz. Erfüllungsort und Gerichtsstand für Anteile an den Teilfonds des Fonds, die in oder von der Schweiz aus angeboten oder vertrieben werden, ist der Sitz des Vertreters in der Schweiz. Der Verkaufsprospekt, die wesentlichen Anlegerinformationen, die Satzung der Gesellschaft, der letzte geprüfte Jahresabschluss und der danach veröffentlichte Halbjahresabschluss des Fonds sind kostenfrei vom Vertreter in der Schweiz zu beziehen.

Neuberger Berman Investment Funds plc (der „Fonds“) ist von der Central Bank of Ireland (die „Zentralbank“) als Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren gemäß den Vorschriften von 2011 zur Umsetzung der EG-Richtlinie über Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (European Communities (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2011 (S.I. 352 of 2011) of Ireland) in der jeweils gültigen Fassung („OGAW-Vorschriften“) zugelassen.

Dieses Dokument wurde ausschließlich für Informationszwecke zur Verfügung gestellt und/oder richtet sich nur an Personen, bei denen es sich um professionelle Kunden oder zulässige Gegenparteien handelt. Alle Informationen können sich ohne Mitteilung ändern. Kein Teil dieses Dokuments darf ohne die schriftliche Genehmigung von NBAMIL in irgendeiner Form vervielfältigt werden. Unternehmensdaten, wo relevant, einschließlich Zahlen zu Mitarbeitern und verwaltetem Vermögen, spiegeln die zusammengefassten Daten für die verschiedenen verbundenen Anlageberater wider, die Tochtergesellschaften der Neuberger Berman Group LLC (die „Gesellschaft“) sind. Die Daten aus der Historie/Zeitachse der Gesellschaft reichen zurück bis ins Jahr 1939, das Gründungsjahr von Neuberger & Berman (dem Vorgänger der Neuberger Berman Group LLC) und verdeutlichen die wesentlichen Expansionen des Unternehmens, einschließlich derer, die aus Übernahmen der verschiedenen verbundenen Anlageberater resultierten, die nun die Gesellschaft bilden. Zu den Anlageexperten auf die Bezug genommen wird, zählen Portfoliomanager, Researchanalysten/Partner, Händler und Produktspezialisten sowie ein Team aus spezialisierten Ökonomen/Strategen.

Neuberger Berman ist der Meinung, dass die Informationen zum Datum ihrer Erstellung richtig sind, aber Neuberger Berman gibt gegenüber dem Empfänger dieses Dokuments oder den Endnutzern diesbezüglich keinerlei Erklärungen oder Zusicherungen ab und übernimmt keinerlei Haftung für Handlungen, die auf Basis der hier enthaltenen Informationen durchgeführt werden. Entscheidungen sollten keinesfalls auf Grundlage der in diesem Dokument enthaltenen Informationen und Meinungen oder der Annahme, dass diese richtig oder vollständig sind, getroffen werden. Hierin zum Ausdruck gebrachte Meinungen entsprechen der Meinung der Neuberger Berman und können sich ohne Vorankündigung ändern. Der Fonds ist möglicherweise in manchen Ländern nicht zum Verkauf zugelassen und ist eventuell nicht für jeden Anlegertyp geeignet. Weitere Informationen sind dem aktuellen Verkaufsprospekt zu entnehmen. Zusätzliche Informationen finden Sie auf [www.nb.com/europe/literature.html](http://www.nb.com/europe/literature.html).

Festverzinsliche Wertpapiere unterliegen dem Risiko, dass ein Emittent seine mit der Verbindlichkeit verbundene Verpflichtung zu Kapital- und Zinszahlungen nicht erfüllen kann, und können infolge von Faktoren wie der Zinssensitivität, der Beurteilung der Kreditwürdigkeit des Emittenten durch den Markt und der allgemeinen Marktliquidität (Marktrisiko) Preisschwankungen unterliegen. Festverzinsliche Wertpapiere unterliegen ferner dem Risiko, dass ihr Bonitätsrating oder das ihrer Emittenten herabgesetzt wird, was einen erheblichen Wertverlust solcher Wertpapiere zur Folge haben kann.

Wertpapiere mit niedrigem Rating (Non-Investment-Grade oder High Yield) oder Wertpapiere ohne Rating reagieren mit größerer Wahrscheinlichkeit auf Entwicklungen, die den Markt und das Kreditrisiko beeinflussen, als Wertpapiere mit höheren Ratings, die vor allem auf Veränderungen des allgemeinen Zinsniveaus reagieren. Anleger sollten die relativen Risiken einer Anlage in Hochzinsspapieren sorgfältig analysieren und verstehen, dass solche Wertpapiere grundsätzlich nicht für eine kurzfristige Anlage geeignet sind. Anleger, die in einer anderen Währung als der Basiswährung des Fonds zeichnen, sind einem Währungsrisiko ausgesetzt. Schwankungen dieser Wechselkurse können die Kapitalrendite beeinträchtigen.

Die Performance in der Vergangenheit ist kein Indikator für künftige Ergebnisse. Einzelheiten zu den Anlagerisiken, insbesondere zum Liquiditäts-, Zins-, Kredit- und Währungsrisiko, sind dem aktuellen Verkaufsprospekt zu entnehmen. Bitte beachten Sie, dass Dividenden/Zinsen, die der Fonds vereinnahmt, Quellensteuern unterliegen können. Die Benchmark berücksichtigt keine steuerlichen Auswirkungen, und deshalb wurde dieser Abzug nicht in der hierin angegebenen Benchmarkrendite berücksichtigt. Das Anlageziel und die Performancebenchmark sind nur ein Ziel und keine Garantie für die Wertentwicklung des Fonds. Der Index wird nicht gemanagt und ein direktes Investment in diesen ist nicht möglich. Indexrenditen gehen von einer Wiederanlage von Dividenden und Veräußerungsgewinnen aus und berücksichtigen im Gegensatz zu Fondsrenditen keine Gebühren oder Kosten. Nachteilige Veränderungen der Wechselkurse können zu einer Verringerung der Rendite und einem Kapitalverlust führen. Die Anlagen jedes Portfolios können vollständig gegenüber seiner Basiswährung abgesichert sein, was die Währungsrisiken reduzieren, das Portfolio aber anderen Risiken aussetzen kann – wie etwa einem Ausfall einer Gegenpartei. Wie vorstehend erwähnt, sind weitere Informationen zu den spezifischen mit dieser Strategie verbundenen Risiken dem aktuellen Verkaufsprospekt zu entnehmen.

Neuberger Berman ist eine eingetragene Marke.